

**【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】      | 2023年4月25日提出                                                                                                                                          |
| 【計算期間】     | 第7期(自 2022年1月27日至 2023年1月26日)                                                                                                                         |
| 【ファンド名】    | eMAX I S 最適化バランス（マイゴールキーパー）<br>eMAX I S 最適化バランス（マイディフェンダー）<br>eMAX I S 最適化バランス（マイミッドフィルダー）<br>eMAX I S 最適化バランス（マイフォワード）<br>eMAX I S 最適化バランス（マイストライカー） |
| 【発行者名】     | 三菱ＵＦＪ国際投信株式会社 ※２０２３年１０月１日より三菱ＵＦＪア<br>セットマネジメント株式会社に変更                                                                                                 |
| 【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】

ファンドは、最適化バランス指数に連動する投資成果をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、各ファンドについて、5,000億円です。

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

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

商品分類表

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

属性区分表

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

※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

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「MR F及びMMFの運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。                                                         |
|         | MR F（マネー・リザーブ・ファンド）   | 一般社団法人投資信託協会が定める「MR F及びMMFの運営に関する規則」に規定するMR F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。 |

有価証券報告書（国内投資信託）

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

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

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

## [ファンドの目的・特色]

## ファンドの目的

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

## ファンドの特色

特色

1

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン(以下「イボットソン社」ということがあります。)が算出する最適化バランス指数に連動する投資成果をめざして運用を行います。

- 各ファンドの1口当たりの純資産額の変動率を最適化バランス指数(以下「ベンチマーク」という場合があります。)の変動率に連動させることを目的とした運用を行います。
- 最適化バランス指数は、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンがeMAXISシリーズのファンド\*を参照して算出する指数であり、5つの目標リスク水準別指数の総称です。目標リスク水準別の指数は、eMAXISシリーズにおける各ファンドの対象インデックスの長期間にわたるデータを用いて期待収益率、リスク(標準偏差)等をそれぞれ推計した上で最適化(目標リスク水準に対してリターンが最大化される)を行い決定される資産クラス別比率に応じて、eMAXISシリーズのファンドの基準価額(分配金再投資)の騰落率を乗じることで算出されます。そのため、ファンド名につきましても「最適化バランス」という名称を付与しております。

なお、各指数の資産クラス別比率の決定は、原則として年1回行います。

\*最適化バランス指数を算出するために参照したファンドは以下のとおりです。

<最適化バランス(6%)指数>

eMAXIS TOPIXインデックス、eMAXIS 先進国株式インデックス、eMAXIS 国内債券インデックス、eMAXIS 先進国債券インデックス、eMAXIS 国内リートインデックスおよびeMAXIS 先進国リートインデックス

<最適化バランス(9%)指数/最適化バランス(12%)指数/最適化バランス(16%)指数/最適化バランス(20%)指数>

eMAXIS TOPIXインデックス、eMAXIS 先進国株式インデックス、eMAXIS 新興国株式インデックス、eMAXIS 国内債券インデックス、eMAXIS 先進国債券インデックス、eMAXIS 新興国債券インデックス、eMAXIS 国内リートインデックスおよびeMAXIS 先進国リートインデックス

□ 標準偏差とは、リターンの振れ幅の大きさを定量的に測定する尺度です。標準偏差の値が大きいほど、ばらつきが広く、リスクが大きいとされ、逆に値が小さいほど、ばらつきが狭く、リスクは小さいとされます。

- お客さまのリスク許容度に応じて、目標リスク水準(標準偏差)の異なる5つのファンドをご用意しました。

| ファンド名      | ファンドが連動することをめざす指数 | 目標リスク水準<br>(年率標準偏差) |
|------------|-------------------|---------------------|
| マイゴールキーパー  | 最適化バランス(6%)指数     | 6%程度                |
| マイディフェンダー  | 最適化バランス(9%)指数     | 9%程度                |
| マイミッドフィルダー | 最適化バランス(12%)指数    | 12%程度               |
| マイフォワード    | 最適化バランス(16%)指数    | 16%程度               |
| マイストライカー   | 最適化バランス(20%)指数    | 20%程度               |

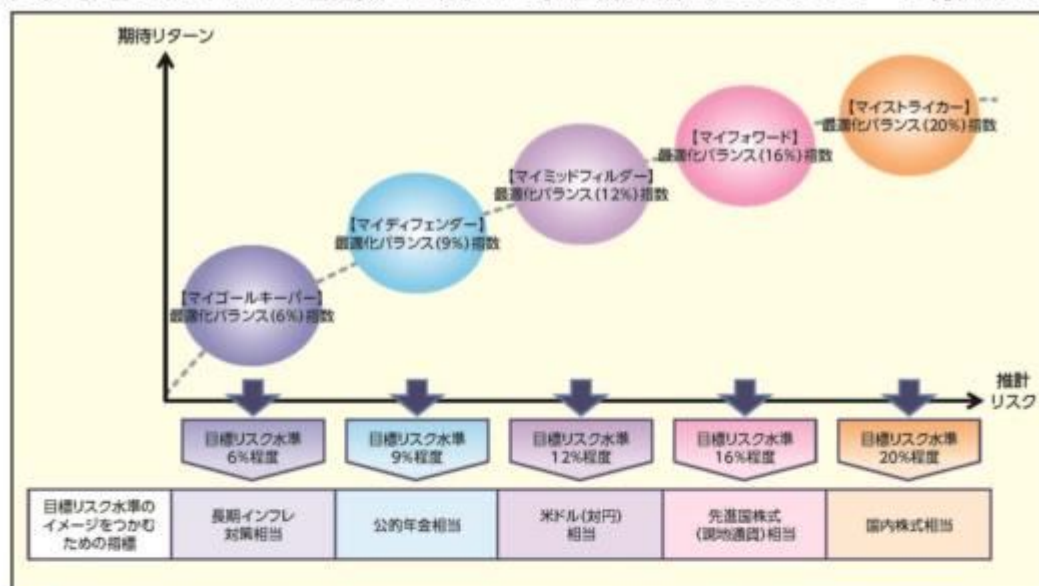
1 各ファンドの実際の基準価額の変動の大きさが、必ずしも目標リスク水準の順になることを保証するものではありません。

- 目標リスク水準は、各ファンドおよび各ファンドが連動することをめざす指数の価格変動リスク(標準偏差)の目処を表示したものであり、各ファンドのポートフォリオを構築する際の目標値として使用します。このため、各ファンドの実際のリスク水準が目標リスク水準を上回る場合や下回る場合があります。

1 一般に、リスクが大きい(小さい)ファンドほど期待されるリターンが大きく(小さく)なる傾向がありますが、必ずしもこのような関係にならない場合があります。



## &lt;(ご参考)各ファンドおよび各指数の目標リスク水準(標準偏差)とリスク・リターン特性のイメージ&gt;



❗ 上図は各ファンドのリスク・リターン特性のイメージ図です。あくまでイメージであり、リスク・リターン特性を正確に表すものではありません。また、ファンドの将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。

❗ 上図の目標リスク水準は年率標準偏差で記載しています。

❗ 上図の目標リスク水準のイメージをつかむための指標は例示であり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。

❗ 各指標の内容は下記の通りです(イボットソン社が相当と考える長期間にて測定)。

長期インフレ対策相当:将来の長期インフレ率を2%と仮定した場合に、当該水準のリターンを確保するのに必要だと考えられるリスク水準

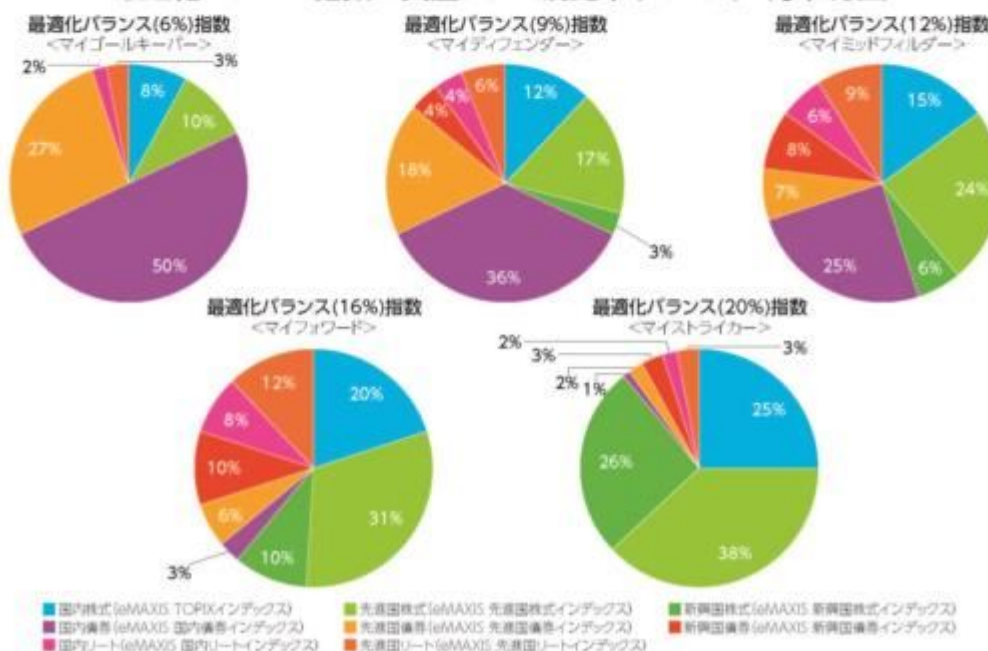
公的年金相当:年金積立金管理運用独立行政法人(GPIF)の基本ポートフォリオ(2022年12月末)のリスク水準

米ドル(対円)相当:日本円/米ドルの為替レートのリスク水準

先進国株式(現地通貨)相当:MSCI ワールド・インデックス(現地通貨ベース)のリスク水準

国内株式相当:TOPIXのリスク水準

## &lt;最適化バランス指数の資産クラス別比率(2023年1月末現在)&gt;



❗ < >内は各指数に連動をめざすファンド名です。

❗ 凡例における( )内は指数を算出する際に参照するファンド名です。各指数の資産クラス別比率の決定は、原則として年1回行います。

## 特色2

主として各マザーファンドの対象インデックスに採用されている日本を含む世界各国の株式、公社債（マイゴールキーパーは、新興国株式、新興国債券を除く）および不動産投資信託証券に投資を行います。

### ◆マイゴールキーパー

日本を含む先進国の株式、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に投資を行います。

### ◆マイディフェンダー／マイミッドフィルダー／マイフォワード／マイストライカー

日本を含む世界各国の株式（DR（預託証券）を含みます。）、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に投資を行います。

※実際の運用は各マザーファンドを通じて行います。

- ❗ 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株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。
- ❗ DR（預託証券）とは、Depositary Receiptの略で、ある国の企業の株式を当該国外の市場で流通させるため、現地法に従い発行した代替証券です。株式と同様に金融商品取引所等で取引されます。
- ❗ 資金動向および取引コスト等を勘案し、上場投資信託証券に直接投資することがあります。

### <各マザーファンドの運用目標>

| 資産クラス  | マザーファンド                | (ご参考)左記を投資対象とする<br>eMAXISシリーズのファンド | 運用目標                                                       |
|--------|------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------------|
| 国内株式   | TOPIXマザーファンド           | eMAXIS TOPIXインデックス                 | 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。                 |
| 先進国株式  | 外国株式インデックス<br>マザーファンド  | eMAXIS 先進国株式インデックス                 | 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。         |
| 新興国株式  | 新興国株式インデックス<br>マザーファンド | eMAXIS 新興国株式インデックス                 | MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)と連動した投資成果をめざして運用を行います。 |
| 国内債券   | 日本債券インデックス<br>マザーファンド  | eMAXIS 国内債券インデックス                  | NOMURA-BPI総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。                         |
| 先進国債券  | 外国債券インデックス<br>マザーファンド  | eMAXIS 先進国債券インデックス                 | FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。          |
| 新興国債券  | 新興国債券インデックス<br>マザーファンド | eMAXIS 新興国債券インデックス                 | JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。  |
| 国内リート  | 東証REIT指数<br>マザーファンド    | eMAXIS 国内リートインデックス                 | 東証REIT指数(配当込み)と連動する投資成果をめざして運用を行います。                       |
| 先進国リート | MUAM G-REIT<br>マザーファンド | eMAXIS 先進国リートインデックス                | S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。   |



## &lt;各マザーファンドの運用プロセス&gt;

## ステップ1：投資対象ユニバースの作成

ベンチマーク採用銘柄を主要投資対象とします。

## ステップ2：ポートフォリオ案の作成

モニタリング結果に加えて、ファンドの資金動向やベンチマーク構成の変動などを考慮してポートフォリオ案を作成します。

## ステップ3：売買執行

売買執行の際には、売買コストの抑制に留意します。

## ステップ4：モニタリング

一連の投資行動を分析し、その結果をポートフォリオに反映することで、運用の継続的な改善に努めます。

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

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

特色

3

原則として、為替ヘッジは行いません。

- 為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

## ■ ファンドの仕組み

運用は主に各マザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債（マイゴールキーパーは、新興国株式、新興国債券を除く）および不動産投資信託証券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。

<マイゴールキーパー>



## &lt;マイディフェンダー／マイミッドフィルダー／マイフォワード／マイストライカー&gt;



1 各ファンド間でのスイッチングが可能です。販売会社によっては、一部のファンドのみの取扱いとなる場合やスイッチングの取扱いを行わない場合があります。スイッチングを行う場合は、解約金の利益に対して税金がかかります。くわしくは販売会社にご確認ください。

## ■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。                                                                |
| 株式の一銘柄制限 | 同一銘柄の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   | デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 |

## ■分配方針

- 年1回の決算時(1月26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。

## ibbotson イボットソン・アソシエイツ・ジャパンについて

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社は、米国モーニングスターの日本法人です。

1977年に米国Ibbotson Associates, Inc. (現Morningstar Investment Management LLC)を創立したロジャー・G・イボットソン(イェール大学経営大学院教授)の理念は、金融経済学の研究成果を投資実務に役立たせることでした。それ以来、同社では資本市場の長期的なリターンとリスクの調査・研究をもとに、資産運用サービス(基本資産配分の策定、資産クラス別の期待リターン・リスクの推計、ファンドや株式のデータ、投資分析プラットフォーム、各種インデックスの提供、株式リサーチ・レポートの発行、投資情報誌の発行)を世界の投資家に提供しています。日本ではイボットソン・アソシエイツ・ジャパンが、金融機関や機関投資家を通じて投資家の皆様に同様のサービスを提供しています。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。





## 指数について

・最適化バランス指数は、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンがeMAXISシリーズのファンドを参照して算出する指数であり、以下の指数の総称です。なお、目標リスク水準別の指数は、eMAXISシリーズにおける各ファンドの対象インデックスの長期間にわたるデータを用いて期待収益率、リスク（標準偏差）等をそれぞれ推計した上で最適化（目標リスク水準に対してリターンが最大化される）を行い決定される資産クラス別比率に応じて、eMAXISシリーズのファンドの基準価額（分配金再投資）の騰落率を乗じることで算出されます。指数の資産クラス別比率の決定は、原則として年1回行います。

＜最適化バランス指数の名称と目標リスク水準＞

最適化バランス(6%)指数 年率標準偏差6%程度  
最適化バランス(9%)指数 年率標準偏差9%程度  
最適化バランス(12%)指数 年率標準偏差12%程度  
最適化バランス(16%)指数 年率標準偏差16%程度  
最適化バランス(20%)指数 年率標準偏差20%程度

なお、目標リスク水準とは各指数の価格変動リスク（標準偏差、年率）の目安を表示したものであり、各指数の資産クラス別比率を決定する際の目標値として使用しています。このため、各指数の実際のリスク水準が目標リスク水準を上回る場合や下回る場合があります。また、価格変動リスク（標準偏差、年率）とは、値動きの変動幅や変動率の大きさを示しています。

・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。

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

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

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

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

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

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

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

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

東証REIT指数の指数値及び東証REIT指数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、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証REIT指数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。

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

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

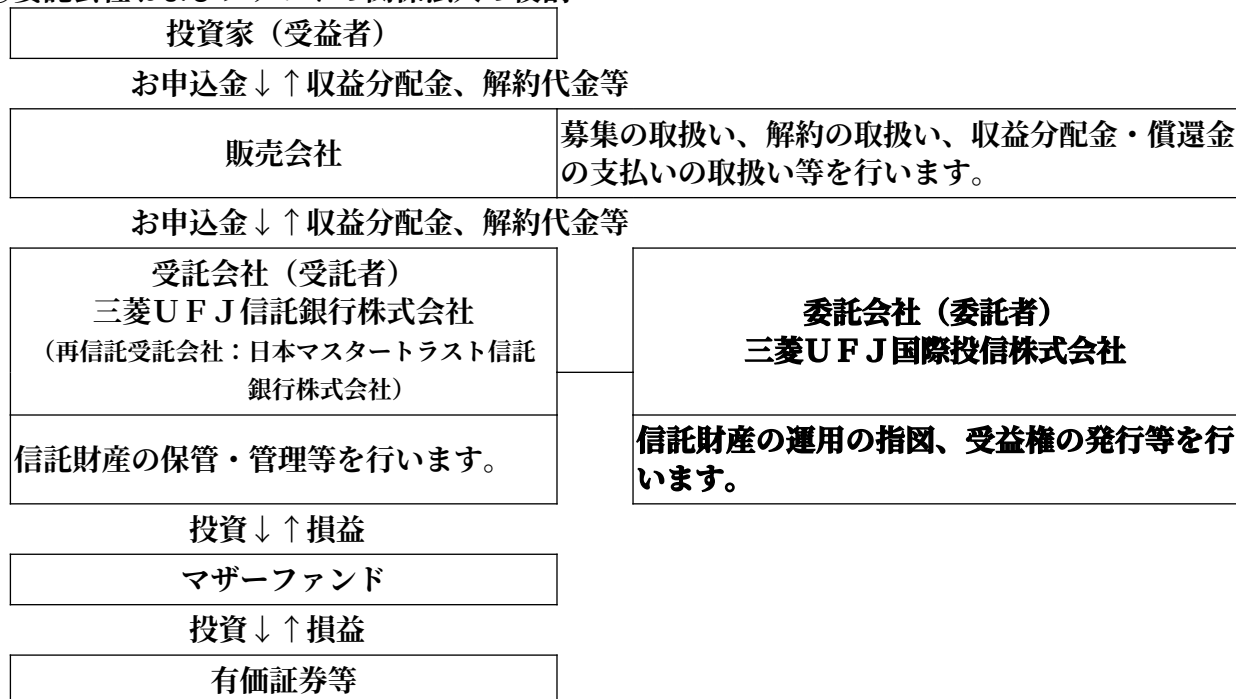
## （２）【ファンドの沿革】

2016年3月30日

設定日、信託契約締結、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

## ①委託会社およびファンドの関係法人の役割



## ②委託会社と関係法人との契約の概要

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

## ③委託会社の概況（2023年1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】

#### 「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

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、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G－REITマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として各マザーファンドの対象インデックスに採用されている、日本を含む先進国の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を最適化バランス（6％）指数の変動率に連動させることを目的とした運用を行います。なお、各マザーファンドは、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、NOMURA－BPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）およびS&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）を対象インデックスとし、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を各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うものです。このほか、日本を含む先進国の株式、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に直接投資することがあります。

国内株式、先進国株式、国内債券、先進国債券、国内不動産投資信託証券および先進国不動産投資信託証券への実質的な投資割合は、目標リスク水準（6％程度）に対し過去の市場データを用いて最適化を行い決定される、最適化バランス（6％）指数の各資産の構成比率となるよう運用を行います。

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。

最適化バランス（6％）指数との連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100％を超える場合があります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

#### 「eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）」

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G－REITマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として各マザーファンドの対象インデックスに採用されている、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を最適化バランス（9％）指数の変動率に連動させることを目的とした運用を行います。なお、各マザーファンドは、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）、NOMURA－BPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、JPモルガンGBI－EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）およびS&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）を対象インデックスとし、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を各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うものです。このほか、日本を含む世界各国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に直接投資することがあります。

国内株式、先進国株式、新興国株式、国内債券、先進国債券、新興国債券、国内不動産投資信託証券および先進国不動産投資信託証券への実質的な投資割合は、目標リスク水準（9％程度）に対し過去の市場データを用いて最適化を行い決定される、最適化バランス（9％）指数の各資産の構成比率となるよう運用を行います。

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。



最適化バランス（９％）指数との連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

#### 「eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）」

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G－REITマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として各マザーファンドの対象インデックスに採用されている、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の１口当たりの純資産額の変動率を最適化バランス（12％）指数の変動率に連動させることを目的とした運用を行います。なお、各マザーファンドは、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）、NOMURA－BPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、JPモルガンGBI－EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）およびS&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）を対象インデックスとし、信託財産の１口当たりの純資産額の変動率を各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うものです。このほか、日本を含む世界各国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に直接投資することがあります。

国内株式、先進国株式、新興国株式、国内債券、先進国債券、新興国債券、国内不動産投資信託証券および先進国不動産投資信託証券への実質的な投資割合は、目標リスク水準（12%程度）に対し過去の市場データを用いて最適化を行い決定される、最適化バランス（12％）指数の各資産の構成比率となるよう運用を行います。

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。

最適化バランス（12％）指数との連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

#### 「eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）」

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G－REITマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として各マザーファンドの対象インデックスに採用されている、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の１口当たりの純資産額の変動率を最適化バランス（16％）指数の変動率に連動させることを目的とした運用を行います。なお、各マザーファンドは、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）、NOMURA－BPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、JPモルガンGBI－EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）およびS&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）を対象インデックスとし、信託財産の１口当たりの純資産額の変動率を各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うものです。このほか、日本を含む世界各国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に直接投資することがあります。

国内株式、先進国株式、新興国株式、国内債券、先進国債券、新興国債券、国内不動産投資信託証券および先進国不動産投資信託証券への実質的な投資割合は、目標リスク水準（16%程度）に

対し過去の市場データを用いて最適化を行い決定される、最適化バランス（16％）指数の各資産の構成比率となるよう運用を行います。

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。

最適化バランス（16％）指数との連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100％を超える場合があります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

#### 「eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）」

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として各マザーファンドの対象インデックスに採用されている、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を最適化バランス（20％）指数の変動率に連動させることを目的とした運用を行います。なお、各マザーファンドは、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）およびS&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）を対象インデックスとし、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を各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うものです。このほか、日本を含む世界各国の株式（DR（預託証書）を含みます。以下同じ。）、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に直接投資することがあります。

国内株式、先進国株式、新興国株式、国内債券、先進国債券、新興国債券、国内不動産投資信託証券および先進国不動産投資信託証券への実質的な投資割合は、目標リスク水準（20％程度）に  
対し過去の市場データを用いて最適化を行い決定される、最適化バランス（20％）指数の各資産の構成比率となるよう運用を行います。

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。

最適化バランス（20％）指数との連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100％を超える場合があります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

## （2）【投資対象】

### ①投資の対象とする資産の種類

#### 「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

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。

ア. 有価証券先物取引等

イ. スワップ取引

ウ. 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

#### 「eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）／（マイミッドフィルダー）／（マイ

フォワード）／（マイストライカー）」

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ゝ。）
    - a. 有価証券先物取引等
    - b. スワップ取引
    - c. 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引
  - ハ. 約束手形
- ニ. 金銭債権
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ. 為替手形

## ②有価証券の指図範囲

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

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、日本債券インデックスマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、東証REIT指数マザーファンドおよびMUAM G-REITマザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から12. の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16. において同じ。）で16. で定めるものの以外のもの
16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16. において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りまゝ。）

19. 預託証券（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券

21. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）

22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの

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

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

「eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）／（マイミッドフィルダー）／（マイフォワード）／（マイストライカー）」

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）

11. コマーシャル・ペーパー

12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.から12.の証券または証書の性質を有するもの

14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16.において同じ。）で16.で定めるもの以外のもの

16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16.において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）

19. 預託証券（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券

21. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）



す。）

22. 外国の者に対する権利で21. の有価証券の性質を有するもの

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

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

### ③金融商品の指図範囲

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で5. の権利の性質を有するもの

7. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、1. から6. に該当するものを除きます。）

8. 外国の者に対する権利で7. の権利の性質を有するもの

9. 合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第2条第2項第3号で定めるものをいいます。）

10. 外国法人の社員権で9. の権利の性質を有するもの

11. 投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利（金融商品取引法第2条第2項第5号で定めるものをいいます。）

12. 外国の法令に基づく権利であって、11. の権利に類するもの

### 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。

## 新興国株式インデックスマザーファンド

### （基本方針）

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

### （運用方法）

#### ①投資対象

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

#### ②投資態度

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

株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

#### （投資制限）

- ①株式への投資割合に制限を設けません。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ③同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
- ⑤有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑥スワップ取引を行うことができます。
- ⑦金利先渡し取引および為替先渡し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。

#### 日本債券インデックスマザーファンド

##### （基本方針）

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

##### （運用方法）

###### ①投資対象

NOMURA-BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。

###### 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公社債に投資を行い、信託財産の１口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

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

・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

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

##### （投資制限）

- 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スワップ取引を行うことができます。

⑩デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

## 外国債券インデックスマザーファンド

### （基本方針）

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

### （運用方法）

#### ①投資対象

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

#### 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国債に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

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

・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引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スワップ取引を行うことができます。

⑩外国為替予約取引を行うことができます。

⑪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。

⑫外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

## 新興国債券インデックスマザーファンド

### （基本方針）

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

### （運用方法）

#### ①投資対象

新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。

#### ②投資態度

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

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

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引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5%以下とします。
- ⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
- ⑧有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑨スワップ取引を行うことができます。
- ⑩金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことができます。
- ⑪外国為替予約取引を行うことができます。
- ⑫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。
- ⑬外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

### 東証REIT指数マザーファンド

#### （基本方針）

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

#### （運用方法）

##### ①投資対象

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

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

原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。

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

市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投資信託証券への投資割合に制限を設けません。
- ③外貨建資産への投資は行いません。
- ④不動産投信指数先物取引を行うことができます。
- ⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。



**MUAM G－REITマザーファンド****（基本方針）**

この投資信託は、信託財産の成長を目指して運用を行います。

**（運用方法）****①投資対象**

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

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

銘柄選定にあたっては、時価総額および流動性等を勘案します。

原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。

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

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

市場動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

**（投資制限）**

①株式への直接投資は行いません。

②投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

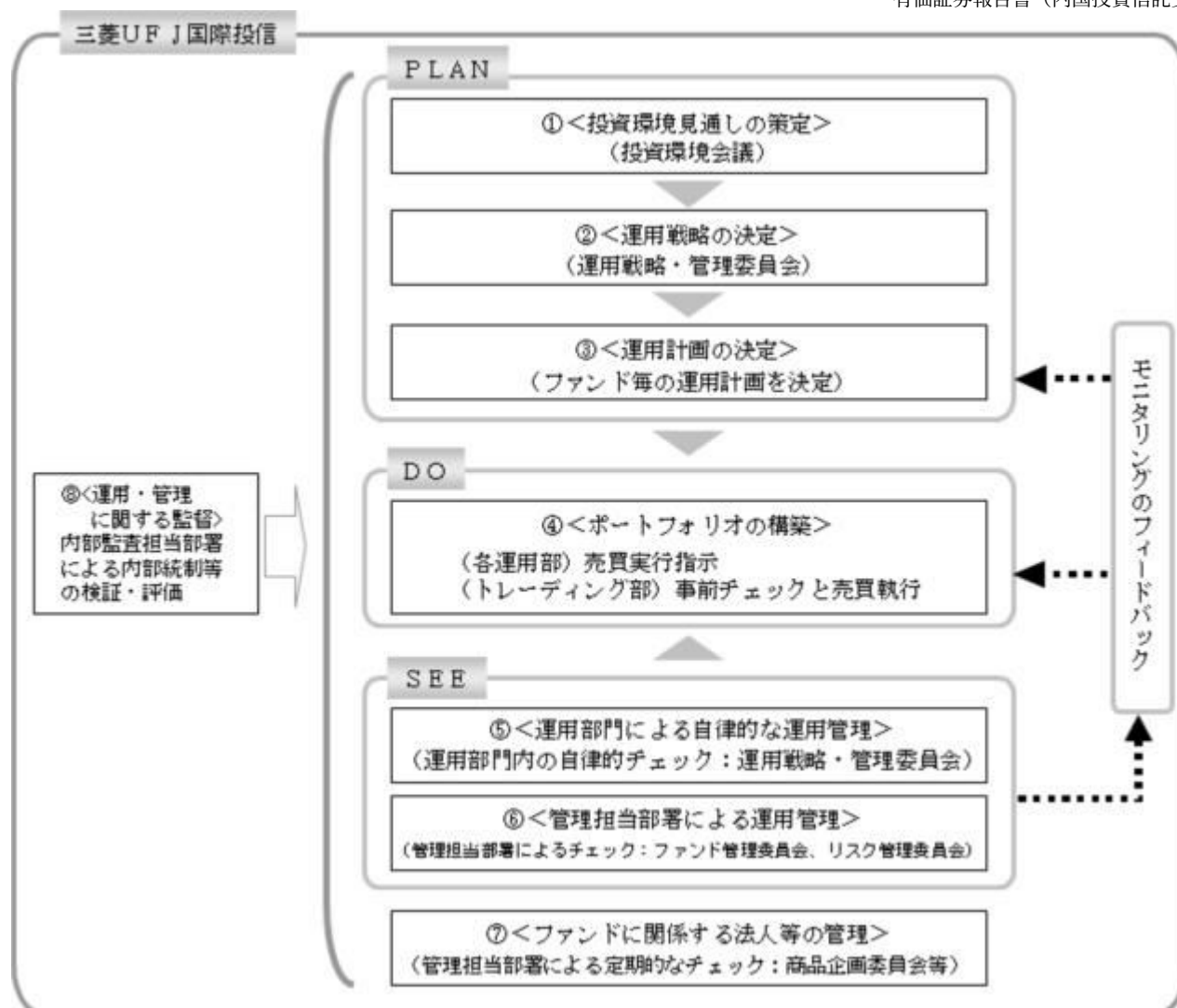
③外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

④不動産投信指数先物取引を行うことができます。

⑤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。

⑥外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

**（3）【運用体制】**



#### 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・管理委員会において、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運用部門による自律的な運用管理

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、運用部門内の管理担当部署は逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また、運用戦略・管理委員会を通じて運用状況のモニタリングを行い、運用部門内での自律的牽制により運用改善を図ります。

#### ⑥管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、（a）運用に関するパフォーマンス測定・分析、意図した運用成果が得られていない場合にはその原因の分析のほか、（b）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、（a）についてはファンド管理委員会における審議を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバックされ、（b）についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

#### ⑦ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に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、商品企画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（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

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。）の時価総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。

#### ③同一銘柄の株式

同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。

#### ④スワップ取引

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

#### 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の権利行使により取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券
  4. 売出しにより取得する株券
  5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債（信託約款において、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。）の新株予約権に限りま
  - す。）の行使により取得可能な株券
  6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（5. に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

#### ⑥外国為替予約取引

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

#### ⑦公社債の借入れ

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

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

#### ⑧有価証券の借入れ

「eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）／（マイミッドフィルダー）／（マイフォワード）／（マイストライカー）」

- 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。

#### ⑨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。

#### ⑩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。

#### ⑪金利先渡取引および為替先渡取引

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

- a. 委託会社は、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。

#### ⑫金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引

「eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）／（マイミッドフィルダー）／（マイフォワード）／（マイストライカー）」

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

#### ⑬有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、投資信託証券（金融商品取引所に上場されているものに限り、以下⑬において同じ。）および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
2. 投資信託証券の貸付は、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
3. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

- b. a. に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### ⑭有価証券の空売り



「eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）／（マイミッドフィルダー）／（マイフォワード）／（マイストライカー）」

- 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⑧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。

⑮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。

⑯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。

⑰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、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動し、また、不動産投資信託証券の価格は保有不動産等の価値やそこから得られる収益の増減等により変動するため、当ファンドはその影響を受け株式や公社債、不動産投資信託証券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。

保有不動産等の価値は、不動産市況、社会情勢等のマクロ的な要因の他、不動産の質や収益増減等の個別の要因によって変動しますが、災害等による保有不動産の滅失、劣化または毀損があった場合には、その影響を大きく受けることがあります。なお、保有不動産等から得られる収益は、賃料水準、稼働率、借入金利等の要因により変動します。

また、不動産投資信託証券は、株式と同様に上場市場で取引が行われ市場の需給を受けて価格

が決定しますが、利回りに着目して取引される傾向もあるため、公社債と同様に、金利の影響を受けることがあります。よって、金利の上昇局面では、不動産投資信託証券に対する投資価値が相対的に低下し、不動産投資信託証券の市場価格が下落する場合があります。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。

#### ②為替変動リスク

実質的な主要投資対象である海外の株式や公社債、不動産投資信託証券は外貨建資産であり、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、不動産投資信託証券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。

また、不動産投資信託証券は、株式と比べ市場規模が小さく、また、一般的に取引量も少ないため、流動性リスクも高い傾向にあります。

#### ⑤カントリーリスク

「eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）／（マイミッドフィルダー）／（マイフォワード）／（マイストライカー）」

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

#### ※留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・有価証券の貸付等においては、取引先の倒産等による決済不履行リスクを伴い、ファンドが損失を被る可能性があります。
- ・当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・当ファンドは、最適化バランス指数の動きに連動することをめざして運用を行います。信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、

売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因によりカイ離を生じることがあります。

- ・不動産投資信託証券および不動産投資信託証券が保有する不動産に係る法律、税制、会計などの制度変更が、不動産投資信託証券の価格や配当率に影響を及ぼすことがあります。不動産投資信託証券の投資口数が増加する場合、1口当たりの不動産投資信託証券の収益性が低下することがあります。

## （２）投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行い、ファンド管理委員会およびリスク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。リスク管理委員会は、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、法令等遵守のための管理態勢の状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

### ②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。

### ③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。

### マイゴールキーパー



- 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。

### マイディフェンダー



- 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。

## マイミッドフィルダー



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

## マイフワード



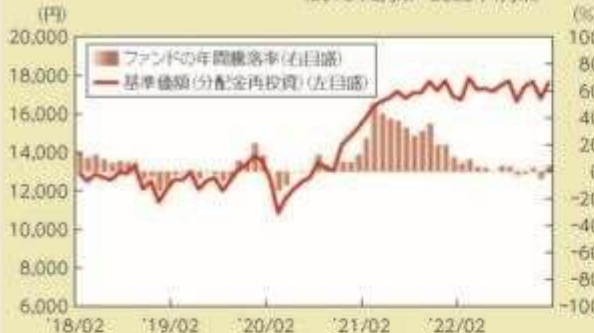
- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

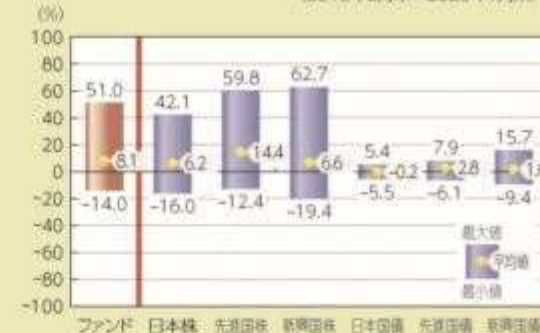


## マイストライカー

● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移  
(2018年2月末～2023年1月末)



● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較  
(2018年2月末～2023年1月末)



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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

### 代表的な資産クラスの指数について

| 資産クラス | 指数名                           | 注記等                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-------|-------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 日本株   | 東証株価指数(TOPIX)<br>(配当込み)       | 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、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JPX新研又は株式会社JPX新研の関連会社(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。                                                                                |
| 先進国株  | MSCIコクサイ・インデックス<br>(配当込み)     | MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。                                                                                                                                                                                                               |
| 新興国株  | MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み) | MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。                                                                                                                                                                                                    |
| 日本国債  | NOMURA-BPI(国債)                | NOMURA-BPI(国債)とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表しているわが国の代表的な国債パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(総合)のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。                                                                                                     |
| 先進国債  | FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本)      | FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 |
| 新興国債  | JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド   | JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債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】

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

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。

「eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）／（マイミッドフィルダー）」

かかりません。

ただし、解約時に信託財産留保額（当該基準価額の0.05％）が差し引かれます。

※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。

「eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）／（マイストライカー）」

かかりません。

ただし、解約時に信託財産留保額（当該基準価額の0.10％）が差し引かれます。

※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0.55％（税抜0.5％）以内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。
- ・信託報酬率ならびに配分（委託会社および販売会社、受託会社）は、ファンドの純資産総額に応じて以下の通りとなります。

| ファンドの純資産総額に応じて          | 信託報酬率<br>(税込 年率) | 配分（税抜 年率） |                 |       |
|-------------------------|------------------|-----------|-----------------|-------|
|                         |                  | 合計        | 委託会社および<br>販売会社 | 受託会社  |
| 500億円未満の部分              | 0.550％           | 0.50％     | 0.44％           | 0.06％ |
| 500億円以上<br>1,000億円未満の部分 | 0.528％           | 0.48％     | 0.43％           | 0.05％ |
| 1,000億円以上の部分            | 0.506％           | 0.46％     | 0.42％           | 0.04％ |

委託会社および販売会社への配分（税抜）は、次の通りです。

| 各販売会社における取扱純資産総額に応じて | 委託会社                                      | 販売会社  |
|----------------------|-------------------------------------------|-------|
| 50億円未満の部分            | 信託報酬率から<br>販売会社および<br>受託会社の配分率<br>を差し引いた率 | 0.22％ |
| 50億円以上100億円未満の部分     |                                           | 0.23％ |
| 100億円以上の部分           |                                           | 0.24％ |

※上記各支払先への配分には、別途消費税等相当額がかかります。

各支払先が信託報酬の対価として提供する役務の内容は以下の通りです。

| 支払先  | 対価として提供する役務の内容                          |
|------|-----------------------------------------|
| 委託会社 | 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 | 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 | 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         |

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

#### （４）【その他の手数料等】

- ・ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外国株式インデックスマザーファンド、新興国株式インデックスマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、新興国債券インデックスマザーファンド、東証ＲＥＩＴ指数マザーファンドおよびMUAM G－R E I T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。ファンドは「つみたてNISA（非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISA、ジュニアNISAおよびつみたてNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

## 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2023年1月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## 5【運用状況】

## 【eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）】

## （１）【投資状況】

令和 5年 1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   | 4,097,983,219 | 98.79   |

|                          |   |               |        |
|--------------------------|---|---------------|--------|
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | — | 50,294,283    | 1.21   |
| 純資産総額                    |   | 4,148,277,502 | 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 5年 1月31日現在

| 国／<br>地域 | 種類        | 銘柄名                   | 数量            | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|-----------|-----------------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本       | 親投資信託受益証券 | 日本債券インデックスマザーファンド     | 1,597,383,907 | 1.2794          | 2,043,776,469   | 1.2719          | 2,031,712,591   | 48.98           |
| 日本       | 親投資信託受益証券 | 外国債券インデックスマザーファンド     | 495,920,340   | 2.2451          | 1,113,390,755   | 2.2448          | 1,113,241,979   | 26.84           |
| 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     | 89,466,478    | 4.5887          | 410,534,828     | 4.6321          | 414,417,672     | 9.99            |
| 日本       | 親投資信託受益証券 | TOPIXマザーファンド          | 141,586,096   | 2.3413          | 331,495,527     | 2.3377          | 330,985,816     | 7.98            |
| 日本       | 親投資信託受益証券 | MUAM G-R E I Tマザーファンド | 55,347,294    | 2.2264          | 123,225,216     | 2.2702          | 125,649,426     | 3.03            |
| 日本       | 親投資信託受益証券 | 東証REIT指数マザーファンド       | 23,965,309    | 3.4199          | 81,958,961      | 3.4206          | 81,975,735      | 1.98            |

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

#### b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 5年 1月31日現在

| 種類        | 投資比率 (%) |
|-----------|----------|
| 親投資信託受益証券 | 98.79    |
| 合計        | 98.79    |

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

### 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5年1月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

|                       | 純資産総額         |               | 基準価額<br>(1万口当たりの純資産価額) |        |
|-----------------------|---------------|---------------|------------------------|--------|
|                       | (分配落)         | (分配付)         | (分配落)                  | (分配付)  |
| 第1計算期間末日（平成29年 1月26日） | 79,528,322    | 79,528,322    | 9,992                  | 9,992  |
| 第2計算期間末日（平成30年 1月26日） | 578,287,926   | 578,287,926   | 10,536                 | 10,536 |
| 第3計算期間末日（平成31年 1月28日） | 913,675,754   | 913,675,754   | 10,279                 | 10,279 |
| 第4計算期間末日（令和 2年 1月27日） | 1,722,503,476 | 1,722,503,476 | 10,891                 | 10,891 |
| 第5計算期間末日（令和 3年 1月26日） | 2,301,813,870 | 2,301,813,870 | 11,132                 | 11,132 |
| 第6計算期間末日（令和 4年 1月26日） | 3,575,041,678 | 3,575,041,678 | 11,514                 | 11,514 |
| 第7計算期間末日（令和 5年 1月26日） | 4,149,837,678 | 4,149,837,678 | 11,324                 | 11,324 |
| 令和 4年 1月末日            | 3,583,527,347 | —             | 11,546                 | —      |
| 2月末日                  | 3,636,844,313 | —             | 11,440                 | —      |
| 3月末日                  | 3,818,499,632 | —             | 11,738                 | —      |
| 4月末日                  | 3,705,688,285 | —             | 11,659                 | —      |
| 5月末日                  | 3,703,909,528 | —             | 11,610                 | —      |
| 6月末日                  | 3,766,029,325 | —             | 11,573                 | —      |
| 7月末日                  | 3,910,798,950 | —             | 11,733                 | —      |
| 8月末日                  | 4,015,377,871 | —             | 11,692                 | —      |
| 9月末日                  | 3,973,352,385 | —             | 11,445                 | —      |
| 10月末日                 | 4,127,939,042 | —             | 11,714                 | —      |
| 11月末日                 | 4,108,554,673 | —             | 11,569                 | —      |
| 12月末日                 | 4,031,791,208 | —             | 11,195                 | —      |
| 令和 5年 1月末日            | 4,148,277,502 | —             | 11,306                 | —      |

## 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         |

## ③【収益率の推移】

|  | 収益率（％） |
|--|--------|
|--|--------|

|        |       |
|--------|-------|
| 第1計算期間 | △0.08 |
| 第2計算期間 | 5.44  |
| 第3計算期間 | △2.43 |
| 第4計算期間 | 5.95  |
| 第5計算期間 | 2.21  |
| 第6計算期間 | 3.43  |
| 第7計算期間 | △1.65 |

（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 | 102,471,260   | 22,880,671  | 79,590,589    |
| 第2計算期間 | 637,544,173   | 168,268,377 | 548,866,385   |
| 第3計算期間 | 738,319,664   | 398,273,566 | 888,912,483   |
| 第4計算期間 | 1,608,931,662 | 916,191,895 | 1,581,652,250 |
| 第5計算期間 | 1,457,352,249 | 971,248,466 | 2,067,756,033 |
| 第6計算期間 | 1,937,700,542 | 900,611,546 | 3,104,845,029 |
| 第7計算期間 | 1,422,813,306 | 863,086,379 | 3,664,571,956 |

#### 【eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）】

##### （１）【投資状況】

令和 5年 1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   | 2,954,233,504 | 95.28   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 146,480,674   | 4.72    |
| 純資産総額                    |      | 3,100,714,178 | 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 5年 1月31日現在

| 国／<br>地域 | 種類        | 銘柄名                | 数量          | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|-----------|--------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本       | 親投資信託受益証券 | 日本債券インデックスマザーファンド  | 846,238,769 | 1.2794          | 1,082,677,882   | 1.2719          | 1,076,331,090   | 34.71           |
| 日本       | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックスマザーファンド  | 107,692,208 | 4.5887          | 494,167,235     | 4.6321          | 498,841,076     | 16.09           |
| 日本       | 親投資信託受益証券 | 外国債券インデックスマザーファンド  | 214,670,494 | 2.2451          | 481,965,432     | 2.2448          | 481,892,324     | 15.54           |
| 日本       | 親投資信託受益証券 | ＴＯＰＩＸマザーファンド       | 158,633,670 | 2.3413          | 371,409,012     | 2.3377          | 370,837,930     | 11.96           |
| 日本       | 親投資信託受益証券 | MUAM G－REITマザーファンド | 82,773,088  | 2.2264          | 184,286,004     | 2.2702          | 187,911,464     | 6.06            |
| 日本       | 親投資信託受益証券 | 新興国債券インデックスマザーファンド | 83,597,555  | 1.4770          | 123,473,588     | 1.4795          | 123,682,582     | 3.99            |
| 日本       | 親投資信託受益証券 | 東証REIT指数マザーファンド    | 35,670,793  | 3.4199          | 121,990,544     | 3.4206          | 122,015,514     | 3.94            |
| 日本       | 親投資信託受益証券 | 新興国株式インデックスマザーファンド | 29,580,018  | 3.1049          | 91,842,998      | 3.1346          | 92,721,524      | 2.99            |

（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 5年 1月31日現在

| 種類        | 投資比率（%） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 95.28   |
| 合計        | 95.28   |

（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5年1月末日、同日前１年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

|          |               | 純資産総額       |             | 基準価額<br>(1万口当たりの純資産価額) |        |
|----------|---------------|-------------|-------------|------------------------|--------|
|          |               | (分配落)       | (分配付)       | (分配落)                  | (分配付)  |
| 第1計算期間末日 | (平成29年 1月26日) | 104,038,196 | 104,038,196 | 10,247                 | 10,247 |
| 第2計算期間末日 | (平成30年 1月26日) | 546,855,605 | 546,855,605 | 11,145                 | 11,145 |
| 第3計算期間末日 | (平成31年 1月28日) | 815,892,066 | 815,892,066 | 10,692                 | 10,692 |

|          |               |               |               |        |        |
|----------|---------------|---------------|---------------|--------|--------|
| 第4計算期間末日 | (令和 2年 1月27日) | 1,412,965,035 | 1,412,965,035 | 11,624 | 11,624 |
| 第5計算期間末日 | (令和 3年 1月26日) | 1,686,114,151 | 1,686,114,151 | 12,025 | 12,025 |
| 第6計算期間末日 | (令和 4年 1月26日) | 2,660,796,064 | 2,660,796,064 | 12,728 | 12,728 |
| 第7計算期間末日 | (令和 5年 1月26日) | 3,094,444,575 | 3,094,444,575 | 12,754 | 12,754 |
|          | 令和 4年 1月末日    | 2,683,409,747 | —             | 12,792 | —      |
|          | 2月末日          | 2,693,400,275 | —             | 12,684 | —      |
|          | 3月末日          | 2,843,991,844 | —             | 13,172 | —      |
|          | 4月末日          | 2,814,372,361 | —             | 13,011 | —      |
|          | 5月末日          | 2,846,148,646 | —             | 12,959 | —      |
|          | 6月末日          | 2,844,099,364 | —             | 12,873 | —      |
|          | 7月末日          | 2,939,353,921 | —             | 13,091 | —      |
|          | 8月末日          | 3,053,651,048 | —             | 13,108 | —      |
|          | 9月末日          | 3,004,055,811 | —             | 12,687 | —      |
|          | 10月末日         | 3,135,661,398 | —             | 13,089 | —      |
|          | 11月末日         | 3,066,073,111 | —             | 12,997 | —      |
|          | 12月末日         | 2,996,497,368 | —             | 12,528 | —      |
|          | 令和 5年 1月末日    | 3,100,714,178 | —             | 12,764 | —      |

## 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         |

## ③【収益率の推移】

|        | 収益率（％） |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 2.47   |
| 第2計算期間 | 8.76   |
| 第3計算期間 | △4.06  |
| 第4計算期間 | 8.71   |
| 第5計算期間 | 3.44   |
| 第6計算期間 | 5.84   |
| 第7計算期間 | 0.20   |

（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 | 160,337,325 | 58,805,087  | 101,532,238   |
| 第2計算期間 | 549,171,328 | 160,032,694 | 490,670,872   |
| 第3計算期間 | 529,756,983 | 257,351,087 | 763,076,768   |
| 第4計算期間 | 935,152,642 | 482,620,593 | 1,215,608,817 |
| 第5計算期間 | 832,042,163 | 645,464,516 | 1,402,186,464 |
| 第6計算期間 | 989,014,237 | 300,622,413 | 2,090,578,288 |
| 第7計算期間 | 727,844,011 | 392,262,071 | 2,426,160,228 |

【eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）】

（１）【投資状況】

令和 5年 1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   | 8,297,902,726 | 93.25   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 600,587,280   | 6.75    |
| 純資産総額                    |      | 8,898,490,006 | 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 5年 1月31日現在

| 国／地域 | 種類        | 銘柄名                | 数量            | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(％) |
|------|-----------|--------------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 日本債券インデックスマザーファンド  | 1,656,377,855 | 1.2795          | 2,119,335,466   | 1.2719          | 2,106,746,993   | 23.68           |
| 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  | 411,965,979   | 4.5899          | 1,890,917,627   | 4.6321          | 1,908,267,611   | 21.44           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | TOPIXマザーファンド       | 566,158,953   | 2.3413          | 1,325,547,957   | 2.3377          | 1,323,509,784   | 14.87           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | MUAM G－REITマザーファンド | 356,389,357   | 2.2264          | 793,465,265     | 2.2702          | 809,075,118     | 9.09            |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 新興国債券インデックスマザーファンド | 475,504,903   | 1.4770          | 702,320,741     | 1.4795          | 703,509,503     | 7.91            |



|    |           |                    |             |        |             |        |             |      |
|----|-----------|--------------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|------|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 新興国株式インデックスマザーファンド | 169,834,647 | 3.1049 | 527,319,596 | 3.1346 | 532,363,684 | 5.98 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド    | 151,177,661 | 3.4199 | 517,012,482 | 3.4206 | 517,118,307 | 5.81 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国債券インデックスマザーファンド  | 176,992,038 | 2.2450 | 397,359,158 | 2.2448 | 397,311,726 | 4.46 |

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

## b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 5年 1月31日現在

| 種類        | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 93.25   |
| 合計        | 93.25   |

（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5年1月末日、同日前１年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

|                       | 純資産総額         |               | 基準価額<br>(1万口当たりの純資産価額) |        |
|-----------------------|---------------|---------------|------------------------|--------|
|                       | (分配落)         | (分配付)         | (分配落)                  | (分配付)  |
| 第1計算期間末日（平成29年 1月26日） | 239,586,416   | 239,586,416   | 10,516                 | 10,516 |
| 第2計算期間末日（平成30年 1月26日） | 1,592,675,860 | 1,592,675,860 | 11,791                 | 11,791 |
| 第3計算期間末日（平成31年 1月28日） | 2,562,665,122 | 2,562,665,122 | 11,125                 | 11,125 |
| 第4計算期間末日（令和 2年 1月27日） | 3,618,196,941 | 3,618,196,941 | 12,386                 | 12,386 |
| 第5計算期間末日（令和 3年 1月26日） | 4,870,796,900 | 4,870,796,900 | 12,872                 | 12,872 |
| 第6計算期間末日（令和 4年 1月26日） | 6,882,109,383 | 6,882,109,383 | 13,895                 | 13,895 |
| 第7計算期間末日（令和 5年 1月26日） | 8,835,402,651 | 8,835,402,651 | 14,136                 | 14,136 |
| 令和 4年 1月末日            | 6,943,538,170 | —             | 13,996                 | —      |
| 2月末日                  | 7,049,755,202 | —             | 13,885                 | —      |
| 3月末日                  | 7,541,805,845 | —             | 14,565                 | —      |
| 4月末日                  | 7,511,271,918 | —             | 14,325                 | —      |
| 5月末日                  | 7,675,892,172 | —             | 14,268                 | —      |

|            |               |   |        |   |
|------------|---------------|---|--------|---|
| 6月末日       | 7,787,595,290 | — | 14,129 | — |
| 7月末日       | 8,046,444,603 | — | 14,396 | — |
| 8月末日       | 8,266,653,715 | — | 14,478 | — |
| 9月末日       | 8,089,643,876 | — | 13,872 | — |
| 10月末日      | 8,572,888,901 | — | 14,405 | — |
| 11月末日      | 8,639,803,030 | — | 14,371 | — |
| 12月末日      | 8,488,826,937 | — | 13,812 | — |
| 令和 5年 1月末日 | 8,898,490,006 | — | 14,176 | — |

## 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         |

## ③【収益率の推移】

|        | 収益率（％） |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 5.16   |
| 第2計算期間 | 12.12  |
| 第3計算期間 | △5.64  |
| 第4計算期間 | 11.33  |
| 第5計算期間 | 3.92   |
| 第6計算期間 | 7.94   |
| 第7計算期間 | 1.73   |

（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 | 260,488,787   | 32,652,572  | 227,836,215   |
| 第2計算期間 | 1,456,517,138 | 333,642,454 | 1,350,710,899 |
| 第3計算期間 | 1,396,610,241 | 443,890,186 | 2,303,430,954 |
| 第4計算期間 | 1,574,849,626 | 957,094,193 | 2,921,186,387 |

|        |               |             |               |
|--------|---------------|-------------|---------------|
| 第5計算期間 | 1,787,720,269 | 924,966,032 | 3,783,940,624 |
| 第6計算期間 | 2,017,199,558 | 848,198,851 | 4,952,941,331 |
| 第7計算期間 | 1,870,039,961 | 572,529,165 | 6,250,452,127 |

【eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）】

（１）【投資状況】

令和 5年 1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   | 4,989,567,311 | 91.10   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 487,408,351   | 8.90    |
| 純資産総額                    |      | 5,476,975,662 | 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 5年 1月31日現在

| 国／地域 | 種類        | 銘柄名                | 数量          | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|-----------|--------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックスマザーファンド  | 323,230,669 | 4.5897          | 1,483,532,527   | 4.6321          | 1,497,236,781   | 27.34           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | TOPIXマザーファンド       | 464,289,690 | 2.3413          | 1,087,041,452   | 2.3377          | 1,085,370,008   | 19.82           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | MUAM-GREITマザーファンド  | 292,525,824 | 2.2264          | 651,279,495     | 2.2702          | 664,092,125     | 12.13           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 新興国株式インデックスマザーファンド | 174,313,712 | 3.1049          | 541,226,645     | 3.1346          | 546,403,761     | 9.98            |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 新興国債券インデックスマザーファンド | 365,022,368 | 1.4770          | 539,138,037     | 1.4795          | 540,050,593     | 9.86            |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 東証REIT指数マザーファンド    | 122,994,999 | 3.4199          | 420,630,597     | 3.4206          | 420,716,693     | 7.68            |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 外国債券インデックスマザーファンド  | 57,296,220  | 2.2450          | 128,633,330     | 2.2448          | 128,618,554     | 2.35            |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 日本債券インデックスマザーファンド  | 84,188,062  | 1.2795          | 107,718,626     | 1.2719          | 107,078,796     | 1.96            |

（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 5年 1月31日現在

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

|           |       |
|-----------|-------|
| 親投資信託受益証券 | 91.10 |
| 合計        | 91.10 |

（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5年1月末日、同日前１年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

|                       | 純資産総額         |               | 基準価額<br>(1万口当たりの純資産価額) |        |
|-----------------------|---------------|---------------|------------------------|--------|
|                       | (分配落)         | (分配付)         | (分配落)                  | (分配付)  |
| 第1計算期間末日（平成29年 1月26日） | 188,359,324   | 188,359,324   | 10,764                 | 10,764 |
| 第2計算期間末日（平成30年 1月26日） | 973,394,215   | 973,394,215   | 12,500                 | 12,500 |
| 第3計算期間末日（平成31年 1月28日） | 1,462,678,215 | 1,462,678,215 | 11,535                 | 11,535 |
| 第4計算期間末日（令和 2年 1月27日） | 2,028,368,456 | 2,028,368,456 | 13,213                 | 13,213 |
| 第5計算期間末日（令和 3年 1月26日） | 2,779,715,457 | 2,779,715,457 | 13,876                 | 13,876 |
| 第6計算期間末日（令和 4年 1月26日） | 4,174,041,793 | 4,174,041,793 | 15,356                 | 15,356 |
| 第7計算期間末日（令和 5年 1月26日） | 5,433,899,506 | 5,433,899,506 | 15,921                 | 15,921 |
| 令和 4年 1月末日            | 4,232,749,050 | —             | 15,518                 | —      |
| 2月末日                  | 4,269,211,775 | —             | 15,383                 | —      |
| 3月末日                  | 4,655,294,962 | —             | 16,385                 | —      |
| 4月末日                  | 4,622,399,989 | —             | 16,032                 | —      |
| 5月末日                  | 4,714,223,215 | —             | 15,959                 | —      |
| 6月末日                  | 4,766,168,563 | —             | 15,780                 | —      |
| 7月末日                  | 5,036,592,911 | —             | 16,140                 | —      |
| 8月末日                  | 5,088,153,970 | —             | 16,281                 | —      |
| 9月末日                  | 4,931,829,254 | —             | 15,412                 | —      |
| 10月末日                 | 5,273,870,103 | —             | 16,183                 | —      |
| 11月末日                 | 5,328,445,085 | —             | 16,195                 | —      |
| 12月末日                 | 5,193,260,745 | —             | 15,446                 | —      |
| 令和 5年 1月末日            | 5,476,975,662 | —             | 16,011                 | —      |

### 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         |

## ③【収益率の推移】

|        | 収益率（％） |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 7.64   |
| 第2計算期間 | 16.12  |
| 第3計算期間 | △7.72  |
| 第4計算期間 | 14.54  |
| 第5計算期間 | 5.01   |
| 第6計算期間 | 10.66  |
| 第7計算期間 | 3.67   |

（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 | 215,753,311   | 40,763,565  | 174,989,746   |
| 第2計算期間 | 829,352,524   | 225,629,350 | 778,712,920   |
| 第3計算期間 | 779,203,269   | 289,913,679 | 1,268,002,510 |
| 第4計算期間 | 798,079,346   | 530,976,262 | 1,535,105,594 |
| 第5計算期間 | 1,029,073,218 | 560,968,918 | 2,003,209,894 |
| 第6計算期間 | 1,171,870,790 | 456,890,240 | 2,718,190,444 |
| 第7計算期間 | 1,108,556,067 | 413,734,207 | 3,413,012,304 |

## 【eMAX I S 最適化バランス（マイストライカー）】

## （１）【投資状況】

令和 5年 1月31日現在  
（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計          | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券                | 日本   | 7,845,539,376 | 93.34   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 559,373,935   | 6.66    |
| 純資産総額                    |      | 8,404,913,311 | 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 5年 1月31日現在

| 国／地域 | 種類        | 銘柄名                   | 数量          | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|-----------|-----------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックスマザーファンド     | 629,662,932 | 4.5903          | 2,890,372,841   | 4.6321          | 2,916,661,667   | 34.70           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 新興国株式インデックスマザーファンド    | 696,262,061 | 3.1049          | 2,161,824,074   | 3.1346          | 2,182,503,056   | 25.97           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | TOPIXマザーファンド          | 889,907,062 | 2.3413          | 2,083,539,405   | 2.3377          | 2,080,335,738   | 24.75           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | MUAM G-R E I Tマザーファンド | 112,281,211 | 2.2264          | 249,982,889     | 2.2702          | 254,900,805     | 3.03            |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 新興国債券インデックスマザーファンド    | 111,616,987 | 1.4770          | 164,858,289     | 1.4795          | 165,137,332     | 1.96            |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 東証REIT指数マザーファンド       | 48,039,012  | 3.4199          | 164,288,617     | 3.4206          | 164,322,244     | 1.96            |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 外国債券インデックスマザーファンド     | 18,194,405  | 2.2451          | 40,848,258      | 2.2448          | 40,842,800      | 0.49            |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 日本債券インデックスマザーファンド     | 32,106,089  | 1.2795          | 41,079,740      | 1.2719          | 40,835,734      | 0.49            |

（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 5年 1月31日現在

| 種類        | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 93.34   |
| 合計        | 93.34   |

（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5年1月末日、同日前１年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

|                       | 純資産総額         |               | 基準価額<br>(1万口当たりの純資産価額) |        |
|-----------------------|---------------|---------------|------------------------|--------|
|                       | (分配落)         | (分配付)         | (分配落)                  | (分配付)  |
| 第1計算期間末日（平成29年 1月26日） | 182,414,441   | 182,414,441   | 11,152                 | 11,152 |
| 第2計算期間末日（平成30年 1月26日） | 2,145,447,863 | 2,145,447,863 | 13,714                 | 13,714 |
| 第3計算期間末日（平成31年 1月28日） | 3,008,888,114 | 3,008,888,114 | 12,038                 | 12,038 |
| 第4計算期間末日（令和 2年 1月27日） | 3,277,796,593 | 3,277,796,593 | 13,812                 | 13,812 |
| 第5計算期間末日（令和 3年 1月26日） | 4,503,577,169 | 4,503,577,169 | 15,541                 | 15,541 |
| 第6計算期間末日（令和 4年 1月26日） | 6,580,279,930 | 6,580,279,930 | 16,750                 | 16,750 |
| 第7計算期間末日（令和 5年 1月26日） | 8,332,473,177 | 8,332,473,177 | 17,502                 | 17,502 |
| 令和 4年 1月末日            | 6,661,718,531 | —             | 16,905                 | —      |
| 2月末日                  | 6,683,796,425 | —             | 16,750                 | —      |
| 3月末日                  | 7,235,507,143 | —             | 17,857                 | —      |
| 4月末日                  | 7,064,740,460 | —             | 17,258                 | —      |
| 5月末日                  | 7,261,750,603 | —             | 17,319                 | —      |
| 6月末日                  | 7,308,989,911 | —             | 17,173                 | —      |
| 7月末日                  | 7,605,537,379 | —             | 17,472                 | —      |
| 8月末日                  | 7,776,821,879 | —             | 17,704                 | —      |
| 9月末日                  | 7,484,866,530 | —             | 16,657                 | —      |
| 10月末日                 | 7,951,930,045 | —             | 17,428                 | —      |
| 11月末日                 | 8,088,848,487 | —             | 17,665                 | —      |
| 12月末日                 | 7,855,342,240 | —             | 16,805                 | —      |
| 令和 5年 1月末日            | 8,404,913,311 | —             | 17,612                 | —      |

## 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         |

## ③【収益率の推移】

|        | 収益率（％） |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 11.52  |
| 第2計算期間 | 22.97  |
| 第3計算期間 | △12.22 |
| 第4計算期間 | 14.73  |
| 第5計算期間 | 12.51  |
| 第6計算期間 | 7.77   |
| 第7計算期間 | 4.48   |

（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 | 182,226,207   | 18,654,277    | 163,571,930   |
| 第2計算期間 | 1,905,710,622 | 504,850,166   | 1,564,432,386 |
| 第3計算期間 | 1,752,807,683 | 817,772,802   | 2,499,467,267 |
| 第4計算期間 | 1,151,729,676 | 1,278,059,271 | 2,373,137,672 |
| 第5計算期間 | 1,813,569,711 | 1,288,759,235 | 2,897,948,148 |
| 第6計算期間 | 2,073,770,424 | 1,043,131,929 | 3,928,586,643 |
| 第7計算期間 | 1,544,412,998 | 712,265,698   | 4,760,733,943 |

（参考）

## ＴＯＰＩＸマザーファンド

## 投資状況

令和 5年 1月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計            | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|-----------------|---------|
| 株式                       | 日本   | 848,824,396,230 | 98.82   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 10,158,742,345  | 1.18    |
| 純資産総額                    |      | 858,983,138,575 | 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 5年 1月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類    | 建別 | 国／地域 | 時価合計          | 投資比率（％） |
|----------|----|------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | 日本   | 5,966,010,000 | 0.69    |

（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 5年 1月31日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名               | 業種     | 数量         | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|----|-------------------|--------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本   | 株式 | トヨタ自動車            | 輸送用機器  | 16,425,900 | 2,146.56        | 35,259,217,980  | 1,896.50        | 31,151,719,350  | 3.63            |
| 日本   | 株式 | ソニーグループ           | 電気機器   | 2,116,100  | 12,377.30       | 26,191,606,702  | 11,580.00       | 24,504,438,000  | 2.85            |
| 日本   | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業    | 18,706,400 | 784.46          | 14,674,545,659  | 952.70          | 17,821,587,280  | 2.07            |
| 日本   | 株式 | キーエンス             | 電気機器   | 299,300    | 55,341.24       | 16,563,633,172  | 59,280.00       | 17,742,504,000  | 2.07            |
| 日本   | 株式 | 日本電信電話            | 情報・通信業 | 3,844,400  | 3,704.49        | 14,241,546,871  | 3,892.00        | 14,962,404,800  | 1.74            |
| 日本   | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ   | 銀行業    | 2,153,000  | 4,211.95        | 9,068,336,456   | 5,652.00        | 12,168,756,000  | 1.42            |
| 日本   | 株式 | 武田薬品工業            | 医薬品    | 2,655,100  | 3,681.10        | 9,773,694,087   | 4,090.00        | 10,859,359,000  | 1.26            |
| 日本   | 株式 | ソフトバンクグループ        | 情報・通信業 | 1,734,700  | 5,450.14        | 9,454,373,577   | 6,144.00        | 10,657,996,800  | 1.24            |
| 日本   | 株式 | 任天堂               | その他製品  | 1,888,600  | 6,359.07        | 12,009,752,635  | 5,625.00        | 10,623,375,000  | 1.24            |
| 日本   | 株式 | 第一三共              | 医薬品    | 2,613,700  | 3,093.55        | 8,085,614,430   | 4,064.00        | 10,622,076,800  | 1.24            |
| 日本   | 株式 | 日立製作所             | 電気機器   | 1,469,200  | 6,316.58        | 9,280,319,336   | 6,782.00        | 9,964,114,400   | 1.16            |
| 日本   | 株式 | 信越化学工業            | 化学     | 505,700    | 18,595.44       | 9,403,717,084   | 19,075.00       | 9,646,227,500   | 1.12            |
| 日本   | 株式 | 東京エレクトロン          | 電気機器   | 211,000    | 58,868.39       | 12,421,231,000  | 45,170.00       | 9,530,870,000   | 1.11            |
| 日本   | 株式 | リクルートホールディングス     | サービス業  | 2,276,700  | 5,243.78        | 11,938,526,954  | 4,144.00        | 9,434,644,800   | 1.10            |
| 日本   | 株式 | KDDI              | 情報・通信業 | 2,318,400  | 4,148.71        | 9,618,387,758   | 4,059.00        | 9,410,385,600   | 1.10            |
| 日本   | 株式 | HOYA              | 精密機器   | 638,900    | 13,973.88       | 8,927,915,781   | 14,200.00       | 9,072,380,000   | 1.06            |
| 日本   | 株式 | 三井物産              | 卸売業    | 2,315,900  | 3,385.89        | 7,841,404,585   | 3,820.00        | 8,846,738,000   | 1.03            |
| 日本   | 株式 | みずほフィナンシャルグループ    | 銀行業    | 4,260,900  | 1,635.09        | 6,966,983,861   | 2,027.50        | 8,638,974,750   | 1.01            |
| 日本   | 株式 | 三菱商事              | 卸売業    | 1,978,900  | 4,588.27        | 9,079,731,081   | 4,336.00        | 8,580,510,400   | 1.00            |
| 日本   | 株式 | 伊藤忠商事             | 卸売業    | 1,950,300  | 4,136.11        | 8,066,668,498   | 4,183.00        | 8,158,104,900   | 0.95            |
| 日本   | 株式 | ダイキン工業            | 機械     | 360,700    | 22,827.80       | 8,233,987,815   | 22,470.00       | 8,104,929,000   | 0.94            |
| 日本   | 株式 | 東京海上ホールディングス      | 保険業    | 2,966,700  | 2,488.76        | 7,383,409,106   | 2,714.00        | 8,051,623,800   | 0.94            |
| 日本   | 株式 | 本田技研工業            | 輸送用機器  | 2,431,700  | 3,427.66        | 8,335,062,635   | 3,207.00        | 7,798,461,900   | 0.91            |
| 日本   | 株式 | ソフトバンク            | 情報・通信業 | 4,819,700  | 1,505.78        | 7,257,416,703   | 1,486.50        | 7,164,484,050   | 0.83            |
| 日本   | 株式 | オリエンタルランド         | サービス業  | 325,500    | 22,879.96       | 7,447,428,482   | 21,580.00       | 7,024,290,000   | 0.82            |

|    |    |                 |      |           |           |               |           |               |      |
|----|----|-----------------|------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 日本 | 株式 | ファナック           | 電気機器 | 293,600   | 21,857.69 | 6,417,418,177 | 22,905.00 | 6,724,908,000 | 0.78 |
| 日本 | 株式 | 村田製作所           | 電気機器 | 907,200   | 8,226.43  | 7,463,020,657 | 7,394.00  | 6,707,836,800 | 0.78 |
| 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス | 小売業  | 1,090,800 | 5,490.49  | 5,989,036,982 | 6,127.00  | 6,683,331,600 | 0.78 |
| 日本 | 株式 | SMC             | 機械   | 98,000    | 68,038.17 | 6,667,741,007 | 65,350.00 | 6,404,300,000 | 0.75 |
| 日本 | 株式 | 富士通             | 電気機器 | 301,000   | 18,274.42 | 5,500,601,795 | 18,510.00 | 5,571,510,000 | 0.65 |

（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 5年 1月31日現在

| 種類 | 業種         | 投資比率（％） |
|----|------------|---------|
| 株式 | 水産・農林業     | 0.09    |
|    | 鉱業         | 0.30    |
|    | 建設業        | 1.93    |
|    | 食料品        | 3.37    |
|    | 繊維製品       | 0.46    |
|    | パルプ・紙      | 0.18    |
|    | 化学         | 6.13    |
|    | 医薬品        | 5.31    |
|    | 石油・石炭製品    | 0.48    |
|    | ゴム製品       | 0.70    |
|    | ガラス・土石製品   | 0.71    |
|    | 鉄鋼         | 0.84    |
|    | 非鉄金属       | 0.74    |
|    | 金属製品       | 0.56    |
|    | 機械         | 5.18    |
|    | 電気機器       | 17.19   |
|    | 輸送用機器      | 7.33    |
|    | 精密機器       | 2.58    |
|    | その他製品      | 2.28    |
|    | 電気・ガス業     | 1.23    |
|    | 陸運業        | 2.95    |
|    | 海運業        | 0.59    |
|    | 空運業        | 0.51    |
|    | 倉庫・運輸関連業   | 0.14    |
|    | 情報・通信業     | 8.81    |
|    | 卸売業        | 5.85    |
|    | 小売業        | 4.48    |
|    | 銀行業        | 6.50    |
|    | 証券、商品先物取引業 | 0.75    |
|    | 保険業        | 2.38    |
|    | その他金融業     | 1.13    |

|    |       |       |
|----|-------|-------|
|    | 不動産業  | 1.88  |
|    | サービス業 | 5.26  |
|    | 小計    | 98.82 |
| 合計 |       | 98.82 |

（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 5年 1月31日現在

| 資産の種類    | 取引所名  | 資産の名称         | 建別 | 数量  | 通貨 | 簿価金額（円）       | 評価金額（円）       | 投資比率（％） |
|----------|-------|---------------|----|-----|----|---------------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 大阪取引所 | TOPIX 23年03月限 | 買建 | 302 | 円  | 5,790,691,100 | 5,966,010,000 | 0.69    |

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

外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

令和 5年 1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    | 1,416,532,460,162 | 68.06   |
|       | イギリス    | 93,797,309,769    | 4.51    |
|       | カナダ     | 75,057,326,175    | 3.61    |
|       | フランス    | 69,793,966,974    | 3.35    |
|       | スイス     | 62,561,432,840    | 3.01    |
|       | ドイツ     | 52,509,819,442    | 2.52    |
|       | オーストラリア | 48,207,089,575    | 2.32    |
|       | オランダ    | 37,082,753,894    | 1.78    |
|       | スウェーデン  | 20,943,271,551    | 1.01    |
|       | デンマーク   | 17,685,501,799    | 0.85    |
|       | 香港      | 17,056,315,022    | 0.82    |
|       | スペイン    | 15,939,434,454    | 0.77    |
|       | イタリア    | 11,162,454,519    | 0.54    |
|       | シンガポール  | 7,383,200,775     | 0.35    |
|       | フィンランド  | 6,144,046,220     | 0.30    |
|       | ベルギー    | 5,167,947,952     | 0.25    |
|       | アイルランド  | 4,515,385,571     | 0.22    |

|                          |          |                   |        |
|--------------------------|----------|-------------------|--------|
|                          | ノルウェー    | 4,407,686,696     | 0.21   |
|                          | イスラエル    | 2,758,031,717     | 0.13   |
|                          | ルクセンブルグ  | 1,459,875,747     | 0.07   |
|                          | オーストリア   | 1,233,314,251     | 0.06   |
|                          | ニュージーランド | 1,215,710,768     | 0.06   |
|                          | ポルトガル    | 1,096,326,506     | 0.05   |
|                          | 小計       | 1,973,710,662,379 | 94.83  |
| 投資証券                     | アメリカ     | 40,266,512,010    | 1.93   |
|                          | オーストラリア  | 2,769,079,166     | 0.13   |
|                          | シンガポール   | 953,481,338       | 0.05   |
|                          | イギリス     | 951,324,443       | 0.05   |
|                          | フランス     | 912,582,685       | 0.04   |
|                          | 香港       | 706,164,462       | 0.03   |
|                          | カナダ      | 243,453,797       | 0.01   |
|                          | ベルギー     | 210,305,205       | 0.01   |
|                          | 小計       | 47,012,903,106    | 2.26   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —        | 60,614,094,522    | 2.91   |
| 純資産総額                    |          | 2,081,337,660,007 | 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 5年 1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    | 44,115,185,058 | 2.12    |
|          | 買建 | カナダ     | 2,299,523,374  | 0.11    |
|          | 買建 | ドイツ     | 7,778,656,882  | 0.37    |
|          | 買建 | オーストラリア | 2,355,536,179  | 0.11    |
|          | 買建 | イギリス    | 2,879,645,183  | 0.14    |
|          | 買建 | スイス     | 1,880,394,687  | 0.09    |

（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 5年 1月31日現在



| 国／<br>地域 | 種類 | 銘柄名                         | 業種                     | 数量        | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|----|-----------------------------|------------------------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 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     | 5,025,400 | 19,004.46       | 95,505,026,262  | 18,657.21       | 93,759,943,134  | 4.50            |
| アメリカ     | 株式 | MICROSOFT CORP              | ソフトウェア・サービス            | 2,215,502 | 33,626.00       | 74,498,485,660  | 31,666.37       | 70,156,914,265  | 3.37            |
| アメリカ     | 株式 | AMAZON.COM INC              | 小売                     | 2,866,864 | 13,793.60       | 39,544,396,192  | 13,118.75       | 37,609,696,468  | 1.81            |
| アメリカ     | 株式 | ALPHABET INC-CL A           | メディア・娯楽                | 2,387,610 | 13,868.33       | 33,112,173,868  | 12,647.76       | 30,197,922,551  | 1.45            |
| アメリカ     | 株式 | NVIDIA CORP                 | 半導体・半導体製造装置            | 778,463   | 21,447.91       | 16,696,406,191  | 25,000.66       | 19,462,089,875  | 0.94            |
| アメリカ     | 株式 | EXXON MOBIL CORP            | エネルギー                  | 1,302,862 | 11,734.80       | 15,288,835,290  | 14,816.17       | 19,303,429,048  | 0.93            |
| アメリカ     | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP INC      | ヘルスケア機器・サービス           | 292,541   | 64,370.36       | 18,830,970,337  | 63,381.02       | 18,541,547,352  | 0.89            |
| アメリカ     | 株式 | TESLA INC                   | 自動車・自動車部品              | 832,993   | 30,692.41       | 25,566,563,158  | 21,744.13       | 18,112,708,248  | 0.87            |
| 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 | 822,125   | 22,891.50       | 18,819,682,178  | 21,136.14       | 17,376,549,098  | 0.83            |
| アメリカ     | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO         | 銀行                     | 916,911   | 15,643.71       | 14,343,890,464  | 18,152.29       | 16,644,035,385  | 0.80            |
| アメリカ     | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 各種金融                   | 406,797   | 40,084.51       | 16,306,261,738  | 40,097.34       | 16,311,479,695  | 0.78            |
| アメリカ     | 株式 | ALPHABET INC-CL C           | メディア・娯楽                | 1,226,634 | 14,191.22       | 17,407,435,284  | 12,779.53       | 15,675,813,975  | 0.75            |
| アメリカ     | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES     | ソフトウェア・サービス            | 511,158   | 25,960.04       | 13,269,683,031  | 29,890.67       | 15,278,858,674  | 0.73            |
| アメリカ     | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO/THE     | 家庭用品・パーソナル用品           | 746,140   | 19,601.41       | 14,625,401,536  | 18,397.57       | 13,727,166,387  | 0.66            |
| アメリカ     | 株式 | META PLATFORMS INC-CLASS A  | メディア・娯楽                | 713,286   | 23,149.76       | 16,512,404,466  | 19,186.91       | 13,685,760,135  | 0.66            |
| スイス      | 株式 | NESTLE SA-REG               | 食品・飲料・タバコ              | 859,270   | 16,823.46       | 14,455,898,073  | 15,683.05       | 13,475,975,061  | 0.65            |
| アメリカ     | 株式 | CHEVRON CORP                | エネルギー                  | 581,439   | 21,322.72       | 12,397,864,947  | 22,727.87       | 13,214,872,331  | 0.63            |
| アメリカ     | 株式 | HOME DEPOT INC              | 小売                     | 320,089   | 37,483.42       | 11,998,032,905  | 40,998.89       | 13,123,294,597  | 0.63            |
| アメリカ     | 株式 | MASTERCARD INC - A          | ソフトウェア・サービス            | 269,766   | 42,863.36       | 11,563,078,958  | 48,420.02       | 13,062,076,842  | 0.63            |
| 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 | 252,567   | 39,146.82       | 9,887,196,096   | 44,425.03       | 11,220,297,815  | 0.54            |
| アメリカ     | 株式 | MERCK & CO. INC.            | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 792,132   | 11,971.89       | 9,483,321,456   | 13,841.56       | 10,964,344,428  | 0.53            |
| オランダ     | 株式 | ASML HOLDING NV             | 半導体・半導体製造装置            | 126,914   | 72,738.93       | 9,231,589,275   | 85,417.30       | 10,840,651,720  | 0.52            |
| 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 | 552,744   | 19,806.76       | 10,948,072,069  | 19,002.95       | 10,503,769,635  | 0.50            |
| アメリカ     | 株式 | BANK OF AMERICA CORP        | 銀行                     | 2,261,221 | 4,584.18        | 10,365,848,801  | 4,605.59        | 10,414,259,087  | 0.50            |
| アメリカ     | 株式 | COCA-COLA CO/THE            | 食品・飲料・タバコ              | 1,284,384 | 8,283.91        | 10,639,733,822  | 7,911.70        | 10,161,661,920  | 0.49            |

|       |    |                              |                        |           |           |                |            |               |      |
|-------|----|------------------------------|------------------------|-----------|-----------|----------------|------------|---------------|------|
| 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 | 1,755,039 | 6,448.17  | 11,316,794,285 | 5,681.96   | 9,972,076,314 | 0.48 |
| フランス  | 株式 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 耐久消費財・アパレル             | 86,553    | 84,411.80 | 7,306,094,978  | 113,078.12 | 9,787,251,213 | 0.47 |
| アメリカ  | 株式 | BROADCOM INC                 | 半導体・半導体製造装置            | 126,199   | 72,443.38 | 9,142,282,627  | 75,861.78  | 9,573,680,964 | 0.46 |
| アメリカ  | 株式 | PEPSICO INC                  | 食品・飲料・タバコ              | 431,475   | 22,355.24 | 9,645,728,357  | 22,112.05  | 9,540,799,190 | 0.46 |
| デンマーク | 株式 | NOVO NORDISK A/S-B           | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 517,205   | 14,691.88 | 7,598,715,540  | 18,297.34  | 9,463,478,321 | 0.45 |

（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 5年 1月31日現在

| 種類 | 業種                     | 投資比率（％） |
|----|------------------------|---------|
| 株式 | エネルギー                  | 5.61    |
|    | 素材                     | 4.50    |
|    | 資本財                    | 6.49    |
|    | 商業・専門サービス              | 1.17    |
|    | 運輸                     | 1.80    |
|    | 自動車・自動車部品              | 1.73    |
|    | 耐久消費財・アパレル             | 1.71    |
|    | 消費者サービス                | 1.95    |
|    | メディア・娯楽                | 4.96    |
|    | 小売                     | 4.45    |
|    | 食品・生活必需品小売り            | 1.48    |
|    | 食品・飲料・タバコ              | 4.10    |
|    | 家庭用品・パーソナル用品           | 1.73    |
|    | ヘルスケア機器・サービス           | 4.68    |
|    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 8.76    |
|    | 銀行                     | 6.16    |
|    | 各種金融                   | 4.79    |
|    | 保険                     | 3.35    |
|    | 不動産                    | 0.36    |
|    | ソフトウェア・サービス            | 10.12   |
|    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 5.92    |
|    | 電気通信サービス               | 1.44    |
|    | 公益事業                   | 3.05    |
|    | 半導体・半導体製造装置            | 4.48    |

|      |   |       |
|------|---|-------|
| 小計   |   | 94.83 |
| 投資証券 | — | 2.26  |
| 合計   |   | 97.09 |

（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 5年 1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 EMINI2303 | 買建 | 1,677 | アメリカドル    | 334,305,691.81 | 43,616,863,610 | 338,125,125 | 44,115,185,058 | 2.12    |
|          | カナダ     | モントリオール取引所        | SP/TSE602303 | 買建 | 95    | カナダドル     | 23,238,061.25  | 2,264,084,308  | 23,601,800  | 2,299,523,374  | 0.11    |
|          | ドイツ     | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO ST 2303 | 買建 | 1,319 | ユーロ       | 54,342,596.17  | 7,692,737,913  | 54,949,540  | 7,778,656,882  | 0.37    |
|          | オーストラリア | シドニー先物取引所         | SPI 200 2303 | 買建 | 138   | オーストラリアドル | 25,013,329.5   | 2,299,475,380  | 25,623,150  | 2,355,536,179  | 0.11    |
|          | イギリス    | インターコンチネンタル取引所    | FTSE100 2303 | 買建 | 230   | イギリスポンド   | 17,802,262.5   | 2,870,970,873  | 17,856,050  | 2,879,645,183  | 0.14    |
|          | スイス     | ユーレックス・チューリッヒ取引所  | SWISS IX2303 | 買建 | 118   | スイスフラン    | 13,227,128.3   | 1,865,818,717  | 13,330,460  | 1,880,394,687  | 0.09    |

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

新興国株式インデックスマザーファンド

投資状況

令和 5年 1月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類 | 国／地域    | 時価合計           | 投資比率（％） |
|-------|---------|----------------|---------|
| 株式    | 香港      | 98,012,074,017 | 24.60   |
|       | 台湾      | 56,075,407,476 | 14.08   |
|       | インド     | 49,826,946,211 | 12.51   |
|       | 韓国      | 45,970,399,967 | 11.54   |
|       | 中国      | 19,975,451,971 | 5.01    |
|       | ブラジル    | 19,510,619,945 | 4.90    |
|       | サウジアラビア | 14,924,136,440 | 3.75    |
|       | 南アフリカ   | 13,623,279,588 | 3.42    |

|                          |          |                 |        |
|--------------------------|----------|-----------------|--------|
|                          | アメリカ     | 11,996,313,810  | 3.01   |
|                          | メキシコ     | 9,173,463,399   | 2.30   |
|                          | タイ       | 8,348,805,011   | 2.10   |
|                          | インドネシア   | 6,986,083,712   | 1.75   |
|                          | マレーシア    | 5,797,936,437   | 1.46   |
|                          | アラブ首長国連邦 | 4,296,908,889   | 1.08   |
|                          | カタール     | 3,628,827,599   | 0.91   |
|                          | クウェート    | 3,367,701,776   | 0.85   |
|                          | フィリピン    | 2,862,228,802   | 0.72   |
|                          | ポーランド    | 2,709,960,590   | 0.68   |
|                          | トルコ      | 2,204,712,363   | 0.55   |
|                          | チリ       | 2,151,337,248   | 0.54   |
|                          | ギリシャ     | 1,314,708,650   | 0.33   |
|                          | ハンガリー    | 729,150,138     | 0.18   |
|                          | チェコ      | 574,162,985     | 0.14   |
|                          | コロンビア    | 419,298,946     | 0.11   |
|                          | 小計       | 384,479,915,970 | 96.52  |
| 投資証券                     | メキシコ     | 337,237,166     | 0.08   |
|                          | 南アフリカ    | 177,166,850     | 0.04   |
|                          | 小計       | 514,404,016     | 0.13   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —        | 13,350,196,438  | 3.35   |
| 純資産総額                    |          | 398,344,516,424 | 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 5年 1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 | 13,448,064,780 | 3.38    |

（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 5年 1月31日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|----|-----|----|----|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
|------|----|-----|----|----|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|

|         |    |                              |                        |            |           |                |           |                |      |
|---------|----|------------------------------|------------------------|------------|-----------|----------------|-----------|----------------|------|
| 台湾      | 株式 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 半導体・半導体製造装置            | 10,550,000 | 2,217.66  | 23,396,384,446 | 2,354.23  | 24,837,134,940 | 6.24 |
| 香港      | 株式 | TENCENT HOLDINGS LTD         | メディア・娯楽                | 2,672,200  | 5,466.75  | 14,608,268,502 | 6,446.88  | 17,227,352,736 | 4.32 |
| 韓国      | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 2,039,544  | 6,837.86  | 13,946,135,823 | 6,716.13  | 13,697,842,645 | 3.44 |
| 香港      | 株式 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD    | 小売                     | 6,354,600  | 1,458.57  | 9,268,666,990  | 1,814.85  | 11,532,645,810 | 2.90 |
| 香港      | 株式 | MEITUAN-CLASS B              | 小売                     | 2,158,320  | 2,792.77  | 6,027,693,820  | 2,888.77  | 6,234,900,858  | 1.57 |
| インド     | 株式 | RELIANCE INDUSTRIES LTD      | エネルギー                  | 1,300,298  | 4,000.84  | 5,202,296,685  | 3,799.19  | 4,940,088,911  | 1.24 |
| ブラジル    | 株式 | VALE SA                      | 素材                     | 1,648,829  | 1,998.55  | 3,295,272,585  | 2,418.50  | 3,987,699,918  | 1.00 |
| 香港      | 株式 | JD.COM INC - CL A            | 小売                     | 926,683    | 3,582.14  | 3,319,511,049  | 3,952.71  | 3,662,909,161  | 0.92 |
| インド     | 株式 | INFOSYS LTD                  | ソフトウェア・サービス            | 1,434,786  | 2,448.17  | 3,512,601,382  | 2,477.46  | 3,554,636,402  | 0.89 |
| 香港      | 株式 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H    | 銀行                     | 41,128,550 | 89.60     | 3,685,290,138  | 85.58     | 3,519,822,438  | 0.88 |
| インド     | 株式 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE  | 各種金融                   | 734,245    | 3,649.86  | 2,679,897,822  | 4,263.60  | 3,130,528,450  | 0.79 |
| インド     | 株式 | ICICI BANK LTD               | 銀行                     | 2,179,817  | 1,196.05  | 2,607,174,552  | 1,325.83  | 2,890,077,672  | 0.73 |
| 香港      | 株式 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 保険                     | 2,713,000  | 795.38    | 2,157,892,378  | 1,013.98  | 2,750,941,305  | 0.69 |
| アメリカ    | 株式 | PINDUODUO INC-ADR            | 小売                     | 216,913    | 5,997.06  | 1,300,842,276  | 12,675.16 | 2,749,407,089  | 0.69 |
| サウジアラビア | 株式 | AL RAJHI BANK                | 銀行                     | 838,054    | 3,557.89  | 2,981,706,827  | 2,850.93  | 2,389,240,833  | 0.60 |
| 南アフリカ   | 株式 | NASPERS LTD-N SHS            | 小売                     | 93,328     | 13,162.17 | 1,228,399,042  | 25,194.62 | 2,351,363,785  | 0.59 |
| 台湾      | 株式 | HON HAI PRECISION INDUSTRY   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 5,349,272  | 448.83    | 2,400,948,927  | 425.32    | 2,275,164,991  | 0.57 |
| 韓国      | 株式 | SK HYNIX INC                 | 半導体・半導体製造装置            | 235,432    | 11,301.03 | 2,660,624,351  | 9,623.27  | 2,265,625,703  | 0.57 |
| インド     | 株式 | TATA CONSULTANCY SVCS LTD    | ソフトウェア・サービス            | 391,025    | 5,421.15  | 2,119,805,313  | 5,528.17  | 2,161,655,216  | 0.54 |
| 香港      | 株式 | BAIDU INC-CLASS A            | メディア・娯楽                | 952,974    | 1,846.64  | 1,759,805,321  | 2,266.06  | 2,159,501,027  | 0.54 |
| 韓国      | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 353,242    | 6,064.44  | 2,142,217,841  | 6,079.52  | 2,147,545,336  | 0.54 |
| 台湾      | 株式 | MEDIATEK INC                 | 半導体・半導体製造装置            | 659,236    | 3,407.96  | 2,246,655,455  | 3,204.00  | 2,112,197,682  | 0.53 |
| 香港      | 株式 | NETEASE INC                  | メディア・娯楽                | 851,095    | 2,368.26  | 2,015,617,108  | 2,342.65  | 1,993,821,957  | 0.50 |
| インドネシア  | 株式 | BANK CENTRAL ASIA TBK PT     | 銀行                     | 23,929,000 | 67.76     | 1,621,572,866  | 75.69     | 1,811,186,010  | 0.45 |
| 韓国      | 株式 | SAMSUNG SDI CO LTD           | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 24,143     | 62,253.42 | 1,502,984,530  | 72,890.69 | 1,759,800,170  | 0.44 |
| 香港      | 株式 | WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 1,560,000  | 918.64    | 1,433,085,200  | 1,115.55  | 1,740,258,000  | 0.44 |
| 香港      | 株式 | IND & COMM BK OF CHINA-H     | 銀行                     | 24,524,350 | 73.34     | 1,798,833,995  | 69.93     | 1,714,987,796  | 0.43 |
| 香港      | 株式 | BANK OF CHINA LTD-H          | 銀行                     | 34,128,000 | 49.63     | 1,693,856,935  | 50.11     | 1,710,375,912  | 0.43 |
| メキシコ    | 株式 | AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L | 電気通信サービス               | 11,733,400 | 131.01    | 1,537,275,573  | 138.36    | 1,623,533,275  | 0.41 |
| サウジアラビア | 株式 | THE SAUDI NATIONAL BANK      | 銀行                     | 951,255    | 2,539.07  | 2,415,303,468  | 1,643.03  | 1,562,942,405  | 0.39 |

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

## b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 5年 1月31日現在

| 種類   | 業種                     | 投資比率（％） |
|------|------------------------|---------|
| 株式   | エネルギー                  | 4.43    |
|      | 素材                     | 8.48    |
|      | 資本財                    | 3.67    |
|      | 商業・専門サービス              | 0.07    |
|      | 運輸                     | 1.90    |
|      | 自動車・自動車部品              | 3.16    |
|      | 耐久消費財・アパレル             | 1.60    |
|      | 消費者サービス                | 1.38    |
|      | メディア・娯楽                | 7.06    |
|      | 小売                     | 8.02    |
|      | 食品・生活必需品小売り            | 1.33    |
|      | 食品・飲料・タバコ              | 3.81    |
|      | 家庭用品・パーソナル用品           | 0.79    |
|      | ヘルスケア機器・サービス           | 1.02    |
|      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 2.91    |
|      | 銀行                     | 14.66   |
|      | 各種金融                   | 3.13    |
|      | 保険                     | 2.66    |
|      | 不動産                    | 1.75    |
|      | ソフトウェア・サービス            | 2.44    |
|      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 7.86    |
|      | 電気通信サービス               | 2.83    |
|      | 公益事業                   | 2.60    |
|      | 半導体・半導体製造装置            | 8.99    |
|      | 小計                     | 96.52   |
| 投資証券 | —                      | 0.13    |
| 合計   |                        | 96.65   |

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類    | 地域   | 取引所名        | 資産の名称        | 建別 | 数量    | 通貨     | 簿価金額         | 簿価金額（円）        | 評価金額        | 評価金額（円）        | 投資比率（%） |
|----------|------|-------------|--------------|----|-------|--------|--------------|----------------|-------------|----------------|---------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | ニューヨーク証券取引所 | MINI MS 2303 | 買建 | 1,968 | アメリカドル | 98,678,857.8 | 12,874,630,577 | 103,074,000 | 13,448,064,780 | 3.38    |

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

日本債券インデックスマザーファンド

投資状況

令和 5年 1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   | 570,978,227,120 | 83.99   |
| 地方債証券                    | 日本   | 37,315,015,494  | 5.49    |
| 特殊債券                     | 日本   | 34,483,964,873  | 5.07    |
| 社債券                      | 日本   | 40,686,008,000  | 5.98    |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | △3,661,235,089  | △0.53   |
| 純資産総額                    |      | 679,801,980,398 | 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 5年 1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   | 879,360,000 | 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 5年 1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363回利付国債（10年） | 13,990,000,000 | 98.86   | 13,830,761,200 | 96.43   | 13,490,976,700 | 0.100000 | 2031/6/20   | 1.98    |



|    |      |                |               |        |               |        |               |          |            |      |
|----|------|----------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|----------|------------|------|
| 日本 | 国債証券 | 第１３７回利付国債（２０年） | 8,382,000,000 | 112.77 | 9,452,471,980 | 109.96 | 9,217,182,480 | 1.700000 | 2032/6/20  | 1.36 |
| 日本 | 国債証券 | 第３５９回利付国債（１０年） | 7,870,000,000 | 99.18  | 7,805,713,200 | 97.43  | 7,667,741,000 | 0.100000 | 2030/6/20  | 1.13 |
| 日本 | 国債証券 | 第３６４回利付国債（１０年） | 7,890,000,000 | 98.44  | 7,767,610,500 | 96.25  | 7,594,203,900 | 0.100000 | 2031/9/20  | 1.12 |
| 日本 | 国債証券 | 第１４９回利付国債（５年）  | 7,130,000,000 | 100.03 | 7,132,817,800 | 99.80  | 7,115,740,000 | 0.005000 | 2026/9/20  | 1.05 |
| 日本 | 国債証券 | 第３５６回利付国債（１０年） | 7,130,000,000 | 99.56  | 7,098,644,400 | 98.25  | 7,005,367,600 | 0.100000 | 2029/9/20  | 1.03 |
| 日本 | 国債証券 | 第３５０回利付国債（１０年） | 6,730,000,000 | 100.17 | 6,742,094,500 | 99.41  | 6,690,696,800 | 0.100000 | 2028/3/20  | 0.98 |
| 日本 | 国債証券 | 第１５４回利付国債（５年）  | 6,480,000,000 | 99.98  | 6,479,227,300 | 99.74  | 6,463,605,600 | 0.100000 | 2027/9/20  | 0.95 |
| 日本 | 国債証券 | 第１４４回利付国債（５年）  | 6,380,000,000 | 100.43 | 6,407,434,000 | 100.22 | 6,394,418,800 | 0.100000 | 2025/6/20  | 0.94 |
| 日本 | 国債証券 | 第３４５回利付国債（１０年） | 6,340,000,000 | 100.46 | 6,369,164,000 | 100.05 | 6,343,677,200 | 0.100000 | 2026/12/20 | 0.93 |
| 日本 | 国債証券 | 第３５８回利付国債（１０年） | 6,280,000,000 | 99.28  | 6,235,114,000 | 97.85  | 6,145,105,600 | 0.100000 | 2030/3/20  | 0.90 |
| 日本 | 国債証券 | 第３４６回利付国債（１０年） | 6,130,000,000 | 100.46 | 6,158,198,000 | 99.95  | 6,127,425,400 | 0.100000 | 2027/3/20  | 0.90 |
| 日本 | 国債証券 | 第４３４回利付国債（２年）  | 6,100,000,000 | 100.13 | 6,107,934,000 | 100.06 | 6,103,904,000 | 0.005000 | 2024/3/1   | 0.90 |
| 日本 | 国債証券 | 第３４９回利付国債（１０年） | 6,090,000,000 | 100.23 | 6,104,398,500 | 99.58  | 6,064,909,200 | 0.100000 | 2027/12/20 | 0.89 |
| 日本 | 国債証券 | 第３６５回利付国債（１０年） | 6,300,000,000 | 96.25  | 6,063,876,000 | 96.14  | 6,057,324,000 | 0.100000 | 2031/12/20 | 0.89 |
| 日本 | 国債証券 | 第１５３回利付国債（５年）  | 6,040,000,000 | 99.92  | 6,035,634,100 | 99.43  | 6,005,753,200 | 0.005000 | 2027/6/20  | 0.88 |
| 日本 | 国債証券 | 第３５３回利付国債（１０年） | 5,950,000,000 | 99.91  | 5,944,826,000 | 98.90  | 5,884,609,500 | 0.100000 | 2028/12/20 | 0.87 |
| 日本 | 国債証券 | 第３６１回利付国債（１０年） | 6,050,000,000 | 98.97  | 5,988,151,400 | 96.85  | 5,859,788,000 | 0.100000 | 2030/12/20 | 0.86 |
| 日本 | 国債証券 | 第１４５回利付国債（５年）  | 5,810,000,000 | 100.42 | 5,834,775,000 | 100.23 | 5,823,711,600 | 0.100000 | 2025/9/20  | 0.86 |
| 日本 | 国債証券 | 第３４７回利付国債（１０年） | 5,700,000,000 | 100.40 | 5,723,199,000 | 99.84  | 5,691,279,000 | 0.100000 | 2027/6/20  | 0.84 |
| 日本 | 国債証券 | 第１４３回利付国債（５年）  | 5,380,000,000 | 100.42 | 5,402,596,000 | 100.23 | 5,392,589,200 | 0.100000 | 2025/3/20  | 0.79 |
| 日本 | 国債証券 | 第３６２回利付国債（１０年） | 5,510,000,000 | 97.05  | 5,347,762,000 | 96.64  | 5,325,304,800 | 0.100000 | 2031/3/20  | 0.78 |
| 日本 | 国債証券 | 第３５４回利付国債（１０年） | 5,380,000,000 | 99.79  | 5,368,824,500 | 98.70  | 5,310,436,600 | 0.100000 | 2029/3/20  | 0.78 |
| 日本 | 国債証券 | 第３６０回利付国債（１０年） | 5,430,000,000 | 98.91  | 5,371,033,600 | 97.13  | 5,274,159,000 | 0.100000 | 2030/9/20  | 0.78 |
| 日本 | 国債証券 | 第１４１回利付国債（５年）  | 5,240,000,000 | 100.34 | 5,257,836,800 | 100.21 | 5,251,108,800 | 0.100000 | 2024/9/20  | 0.77 |
| 日本 | 国債証券 | 第１５０回利付国債（５年）  | 5,230,000,000 | 99.98  | 5,229,416,400 | 99.69  | 5,213,787,000 | 0.005000 | 2026/12/20 | 0.77 |
| 日本 | 国債証券 | 第３５７回利付国債（１０年） | 5,250,000,000 | 99.12  | 5,204,123,200 | 98.02  | 5,146,207,500 | 0.100000 | 2029/12/20 | 0.76 |
| 日本 | 国債証券 | 第１４２回利付国債（２０年） | 4,610,000,000 | 113.49 | 5,232,081,200 | 110.88 | 5,111,752,400 | 1.800000 | 2032/12/20 | 0.75 |
| 日本 | 国債証券 | 第１３４回利付国債（２０年） | 4,545,000,000 | 114.82 | 5,218,794,050 | 110.76 | 5,034,451,050 | 1.800000 | 2032/3/20  | 0.74 |
| 日本 | 国債証券 | 第３４８回利付国債（１０年） | 4,970,000,000 | 100.34 | 4,986,942,100 | 99.74  | 4,957,425,900 | 0.100000 | 2027/9/20  | 0.73 |

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

## b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 5年 1月31日現在

| 種類    | 投資比率（％） |
|-------|---------|
| 国債証券  | 83.99   |
| 地方債証券 | 5.49    |
| 特殊債券  | 5.07    |
| 社債券   | 5.98    |
| 合計    | 100.54  |

（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 5年 1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23年03月限 | 買建 | 6  | 円  | 885,546,600 | 879,360,000 | 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。

#### 外国債券インデックスマザーファンド

#### 投資状況

令和 5年 1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    | 192,727,565,517 | 49.08   |
|       | フランス    | 33,725,173,359  | 8.59    |
|       | イタリア    | 29,927,364,637  | 7.62    |
|       | ドイツ     | 25,810,713,182  | 6.57    |
|       | スペイン    | 19,197,806,870  | 4.89    |
|       | イギリス    | 19,188,159,517  | 4.89    |
|       | 中国      | 15,419,538,917  | 3.93    |
|       | カナダ     | 8,099,729,157   | 2.06    |
|       | ベルギー    | 7,205,463,683   | 1.84    |
|       | オーストラリア | 6,443,675,873   | 1.64    |
|       | オランダ    | 6,182,434,664   | 1.57    |
|       | オーストリア  | 4,540,624,908   | 1.16    |
|       | メキシコ    | 3,131,605,537   | 0.80    |
|       | アイルランド  | 2,536,092,748   | 0.65    |

|                          |          |                 |        |
|--------------------------|----------|-----------------|--------|
|                          | フィンランド   | 2,234,064,557   | 0.57   |
|                          | マレーシア    | 2,232,510,402   | 0.57   |
|                          | シンガポール   | 1,736,026,973   | 0.44   |
|                          | ポーランド    | 1,686,464,698   | 0.43   |
|                          | イスラエル    | 1,310,132,031   | 0.33   |
|                          | デンマーク    | 1,273,252,644   | 0.32   |
|                          | ニュージーランド | 808,112,382     | 0.21   |
|                          | スウェーデン   | 772,345,071     | 0.20   |
|                          | ノルウェー    | 717,232,894     | 0.18   |
|                          | 小計       | 386,906,090,221 | 98.54  |
| コール・ローン、その他資産<br>(負債控除後) | —        | 5,740,238,203   | 1.46   |
| 純資産総額                    |          | 392,646,328,424 | 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。

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 5年 1月31日現在

| 国／<br>地域 | 種類   | 銘柄名                    | 数量         | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|------|------------------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|-----------------|-----------------|
| アメリカ     | 国債証券 | 1.875 T-NOTE<br>320215 | 17,060,000 | 11,432.08       | 1,950,313,316   | 11,394.21       | 1,943,852,238   | 1.875000  | 2032/2/15       | 0.50            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.75 T-NOTE<br>320815  | 15,810,000 | 12,164.68       | 1,923,235,993   | 12,219.33       | 1,931,876,220   | 2.750000  | 2032/8/15       | 0.49            |
| アメリカ     | 国債証券 | 1.125 T-NOTE<br>310215 | 17,460,000 | 10,950.57       | 1,911,970,397   | 10,935.52       | 1,909,342,923   | 1.125000  | 2031/2/15       | 0.49            |
| アメリカ     | 国債証券 | 1.375 T-NOTE<br>311115 | 16,700,000 | 11,235.52       | 1,876,332,908   | 10,949.79       | 1,828,616,039   | 1.375000  | 2031/11/15      | 0.47            |
| アメリカ     | 国債証券 | 1.625 T-NOTE<br>310515 | 15,460,000 | 11,516.92       | 1,780,516,941   | 11,302.98       | 1,747,441,168   | 1.625000  | 2031/5/15       | 0.45            |
| アメリカ     | 国債証券 | 1.25 T-NOTE<br>310815  | 16,020,000 | 11,095.13       | 1,777,441,033   | 10,901.38       | 1,746,401,099   | 1.250000  | 2031/8/15       | 0.44            |
| アメリカ     | 国債証券 | 0.875 T-NOTE<br>301115 | 16,180,000 | 10,968.86       | 1,774,762,700   | 10,738.80       | 1,737,538,204   | 0.875000  | 2030/11/15      | 0.44            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.875 T-NOTE<br>320515 | 13,830,000 | 12,910.27       | 1,785,491,148   | 12,368.14       | 1,710,514,907   | 2.875000  | 2032/5/15       | 0.44            |
| アメリカ     | 国債証券 | 0.625 T-NOTE<br>300815 | 15,160,000 | 10,740.31       | 1,628,231,163   | 10,576.22       | 1,603,355,615   | 0.625000  | 2030/8/15       | 0.41            |
| アメリカ     | 国債証券 | 0.75 T-NOTE<br>260331  | 13,100,000 | 12,033.24       | 1,576,355,501   | 11,834.54       | 1,550,325,570   | 0.750000  | 2026/3/31       | 0.39            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.5 T-NOTE 240515      | 11,950,000 | 12,921.99       | 1,544,178,998   | 12,691.26       | 1,516,606,222   | 2.500000  | 2024/5/15       | 0.39            |
| フランス     | 国債証券 | 0 0.A.T 240325         | 10,800,000 | 13,787.74       | 1,489,076,152   | 13,722.21       | 1,481,998,747   | 0.000000  | 2024/3/25       | 0.38            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2 T-NOTE 240531        | 11,730,000 | 12,877.79       | 1,510,565,554   | 12,600.80       | 1,478,074,164   | 2.000000  | 2024/5/31       | 0.38            |
| アメリカ     | 国債証券 | 0.375 T-NOTE<br>240915 | 12,000,000 | 12,312.93       | 1,477,552,364   | 12,223.15       | 1,466,778,398   | 0.375000  | 2024/9/15       | 0.37            |
| アメリカ     | 国債証券 | 0.25 T-NOTE<br>240315  | 11,400,000 | 12,356.31       | 1,408,619,518   | 12,415.03       | 1,415,314,096   | 0.250000  | 2024/3/15       | 0.36            |

|      |      |                        |            |           |               |           |               |          |            |      |
|------|------|------------------------|------------|-----------|---------------|-----------|---------------|----------|------------|------|
| アメリカ | 国債証券 | 3.125 T-NOTE<br>281115 | 10,280,000 | 12,950.34 | 1,331,295,657 | 12,670.36 | 1,302,514,012 | 3.125000 | 2028/11/15 | 0.33 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.25 T-NOTE<br>280531  | 11,250,000 | 11,340.49 | 1,275,805,619 | 11,522.13 | 1,296,239,836 | 1.250000 | 2028/5/31  | 0.33 |
| アメリカ | 国債証券 | 2.125 T-NOTE<br>240331 | 10,160,000 | 12,935.89 | 1,314,287,099 | 12,665.27 | 1,286,791,773 | 2.125000 | 2024/3/31  | 0.33 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.125 T-NOTE<br>280831 | 11,300,000 | 11,468.30 | 1,295,918,635 | 11,375.35 | 1,285,414,903 | 1.125000 | 2028/8/31  | 0.33 |
| アメリカ | 国債証券 | 2.625 T-NOTE<br>290215 | 10,420,000 | 12,253.98 | 1,276,864,722 | 12,307.50 | 1,282,441,507 | 2.625000 | 2029/2/15  | 0.33 |
| アメリカ | 国債証券 | 2.25 T-NOTE<br>251115  | 10,290,000 | 12,624.77 | 1,299,089,186 | 12,446.37 | 1,280,732,426 | 2.250000 | 2025/11/15 | 0.33 |
| アメリカ | 国債証券 | 2 T-NOTE 261115        | 10,450,000 | 12,239.00 | 1,278,975,502 | 12,207.60 | 1,275,695,139 | 2.000000 | 2026/11/15 | 0.32 |
| アメリカ | 国債証券 | 2.75 T-NOTE<br>280215  | 9,990,000  | 12,801.33 | 1,278,853,110 | 12,477.72 | 1,246,524,499 | 2.750000 | 2028/2/15  | 0.32 |
| アメリカ | 国債証券 | 0.125 T-NOTE<br>240215 | 10,000,000 | 12,440.38 | 1,244,038,202 | 12,437.07 | 1,243,707,309 | 0.125000 | 2024/2/15  | 0.32 |
| フランス | 国債証券 | 1.5 O.A.T 310525       | 9,560,000  | 13,818.80 | 1,321,077,407 | 12,987.08 | 1,241,565,083 | 1.500000 | 2031/5/25  | 0.32 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.625 T-NOTE<br>260515 | 10,170,000 | 12,237.13 | 1,244,516,371 | 12,140.84 | 1,234,723,950 | 1.625000 | 2026/5/15  | 0.31 |
| アメリカ | 国債証券 | 0.625 T-NOTE<br>300515 | 11,390,000 | 10,775.36 | 1,227,314,066 | 10,628.71 | 1,210,611,001 | 0.625000 | 2030/5/15  | 0.31 |
| アメリカ | 国債証券 | 0.375 T-NOTE<br>251130 | 10,150,000 | 11,958.90 | 1,213,828,407 | 11,794.79 | 1,197,171,572 | 0.375000 | 2025/11/30 | 0.30 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.625 T-NOTE<br>260215 | 9,760,000  | 12,331.49 | 1,203,553,844 | 12,181.61 | 1,188,925,819 | 1.625000 | 2026/2/15  | 0.30 |
| アメリカ | 国債証券 | 2.75 T-NOTE<br>240215  | 9,260,000  | 13,045.45 | 1,208,008,846 | 12,779.06 | 1,183,340,957 | 2.750000 | 2024/2/15  | 0.30 |

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 5年 1月31日現在

| 種類   | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.54   |
| 合計   | 98.54   |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

新興国債券インデックスマザーファンド

投資状況

令和 5年 1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                     | タイ      | 6,643,648,250  | 10.21   |
|                          | ブラジル    | 6,352,807,791  | 9.76    |
|                          | マレーシア   | 6,333,998,694  | 9.73    |
|                          | メキシコ    | 6,324,931,577  | 9.72    |
|                          | 中国      | 6,321,400,836  | 9.72    |
|                          | インドネシア  | 6,316,276,150  | 9.71    |
|                          | 南アフリカ   | 5,927,361,130  | 9.11    |
|                          | ポーランド   | 4,548,587,443  | 6.99    |
|                          | チェコ     | 3,471,114,778  | 5.33    |
|                          | コロンビア   | 2,375,111,339  | 3.65    |
|                          | ルーマニア   | 2,072,351,176  | 3.18    |
|                          | ハンガリー   | 1,979,174,007  | 3.04    |
|                          | チリ      | 1,458,397,233  | 2.24    |
|                          | ペルー     | 1,382,224,760  | 2.12    |
|                          | エジプト    | 531,270,859    | 0.82    |
|                          | トルコ     | 529,775,103    | 0.81    |
|                          | セルビア    | 189,991,712    | 0.29    |
|                          | ウルグアイ   | 73,665,749     | 0.11    |
|                          | フィリピン   | 43,764,171     | 0.07    |
|                          | ドミニカ共和国 | 35,507,488     | 0.05    |
| 小計                       |         | 62,911,360,246 | 96.69   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —       | 2,155,779,169  | 3.31    |
| 純資産総額                    |         | 65,067,139,415 | 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 5年 1月31日現在

| 国／<br>地域  | 種類   | 銘柄名                         | 数量          | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(％) | 償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(％) |
|-----------|------|-----------------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|-----------------|-----------------|
| ブラジル      | 国債証券 | BRAZIL-LTN 240101           | 73,000,000  | 2,266.75        | 1,654,734,560   | 2,269.60        | 1,656,814,468   | —         | 2024/1/1        | 2.55            |
| 南アフリ<br>カ | 国債証券 | 8 SOUTH AFRICA<br>300131    | 132,000,000 | 689.23          | 909,783,929     | 687.72          | 907,801,289     | 8.000000  | 2030/1/31       | 1.40            |
| ブラジル      | 国債証券 | 10 (IN)BRAZIL NT<br>270101  | 36,270,000  | 2,364.23        | 857,509,573     | 2,355.28        | 854,263,383     | 10.000000 | 2027/1/1        | 1.31            |
| ブラジル      | 国債証券 | BRAZIL-LTN 260101           | 46,400,000  | 1,793.07        | 831,988,026     | 1,786.18        | 828,791,579     | —         | 2026/1/1        | 1.27            |
| ブラジル      | 国債証券 | BRAZIL-LTN 240701           | 37,200,000  | 2,138.47        | 795,511,647     | 2,137.36        | 795,100,824     | —         | 2024/7/1        | 1.22            |
| 南アフリ<br>カ | 国債証券 | 10.5 SOUTH AFRICA<br>261221 | 97,500,000  | 809.09          | 788,866,265     | 809.26          | 789,036,141     | 10.500000 | 2026/12/21      | 1.21            |

|           |      |                             |             |          |             |          |             |           |            |      |
|-----------|------|-----------------------------|-------------|----------|-------------|----------|-------------|-----------|------------|------|
| メキシコ      | 国債証券 | 7.75 MEXICAN BONO<br>310529 | 119,800,000 | 661.11   | 792,011,052 | 656.95   | 787,028,096 | 7.750000  | 2031/5/29  | 1.21 |
| 南アフリ<br>カ | 国債証券 | 8.75 SOUTH AFRICA<br>480228 | 127,900,000 | 601.77   | 769,671,889 | 595.54   | 761,699,497 | 8.750000  | 2048/2/28  | 1.17 |
| メキシコ      | 国債証券 | 5.75 MEXICAN BONO<br>260305 | 118,200,000 | 632.03   | 747,067,789 | 629.69   | 744,298,732 | 5.750000  | 2026/3/5   | 1.14 |
| ブラジル      | 国債証券 | 10 (IN)BRAZIL NTN<br>250101 | 29,100,000  | 2,454.26 | 714,191,995 | 2,450.09 | 712,976,851 | 10.000000 | 2025/1/1   | 1.10 |
| チェコ       | 国債証券 | 0.25 CZECH REPUBL<br>270210 | 143,500,000 | 497.27   | 713,593,122 | 494.28   | 709,292,141 | 0.250000  | 2027/2/10  | 1.09 |
| メキシコ      | 国債証券 | 8 MEXICAN BONOS<br>240905   | 103,000,000 | 672.21   | 692,381,730 | 671.93   | 692,098,079 | 8.000000  | 2024/9/5   | 1.06 |
| 南アフリ<br>カ | 国債証券 | 8.25 SOUTH AFRICA<br>320331 | 101,700,000 | 662.17   | 673,432,568 | 659.75   | 670,969,309 | 8.250000  | 2032/3/31  | 1.03 |
| マレーシ<br>ア | 国債証券 | 3.955 MALAYSIAGOV<br>250915 | 20,500,000  | 3,115.43 | 638,664,989 | 3,112.95 | 638,156,007 | 3.955000  | 2025/9/15  | 0.98 |
| 南アフリ<br>カ | 国債証券 | 8.875 SOUTH AFRIC<br>350228 | 96,000,000  | 655.28   | 629,073,648 | 648.45   | 622,512,912 | 8.875000  | 2035/2/28  | 0.96 |
| メキシコ      | 国債証券 | 7.5 MEXICAN BONOS<br>270603 | 93,200,000  | 663.32   | 618,215,233 | 660.40   | 615,494,843 | 7.500000  | 2027/6/3   | 0.95 |
| ブラジル      | 国債証券 | BRAZIL-LTN 250701           | 30,500,000  | 1,911.85 | 583,114,693 | 1,903.08 | 580,440,125 | —         | 2025/7/1   | 0.89 |
| チェコ       | 国債証券 | 1.75 CZECH REPUBL<br>320623 | 121,200,000 | 475.58   | 576,409,917 | 467.12   | 566,155,433 | 1.750000  | 2032/6/23  | 0.87 |
| ブラジル      | 国債証券 | 10(IN) BRAZIL NTN<br>290101 | 24,700,000  | 2,279.84 | 563,121,056 | 2,265.94 | 559,688,666 | 10.000000 | 2029/1/1   | 0.86 |
| 南アフリ<br>カ | 国債証券 | 8.5 SOUTH AFRICA<br>370131  | 91,600,000  | 617.21   | 565,366,929 | 610.45   | 559,172,521 | 8.500000  | 2037/1/31  | 0.86 |
| メキシコ      | 国債証券 | 8.5 MEXICAN BONOS<br>290531 | 79,000,000  | 691.93   | 546,627,055 | 688.46   | 543,887,414 | 8.500000  | 2029/5/31  | 0.84 |
| メキシコ      | 国債証券 | 10 MEXICAN BONOS<br>241205  | 73,700,000  | 698.57   | 514,849,101 | 696.78   | 513,533,575 | 10.000000 | 2024/12/5  | 0.79 |
| タイ        | 国債証券 | 2 THAILAND 311217           | 127,100,000 | 386.66   | 491,455,853 | 385.50   | 489,979,694 | 2.000000  | 2031/12/17 | 0.75 |
| ポーランド     | 国債証券 | 2.75 POLAND 291025          | 19,200,000  | 2,506.46 | 481,240,604 | 2,505.93 | 481,139,609 | 2.750000  | 2029/10/25 | 0.74 |
| 南アフリ<br>カ | 国債証券 | 8.75 SOUTH AFRICA<br>440131 | 79,600,000  | 602.11   | 479,282,942 | 594.67   | 473,364,762 | 8.750000  | 2044/1/31  | 0.73 |
| チェコ       | 国債証券 | CZECH REPUBLIC<br>241212    | 86,000,000  | 537.60   | 462,337,621 | 537.33   | 462,107,842 | —         | 2024/12/12 | 0.71 |
| メキシコ      | 国債証券 | 7.75 MEXICAN BONO<br>421113 | 72,600,000  | 631.75   | 458,654,514 | 626.88   | 455,120,154 | 7.750000  | 2042/11/13 | 0.70 |
| マレーシ<br>ア | 国債証券 | 3.502MALAYSIAGOV<br>270531  | 14,600,000  | 3,073.17 | 448,684,063 | 3,069.26 | 448,112,962 | 3.502000  | 2027/5/31  | 0.69 |
| マレーシ<br>ア | 国債証券 | 4.059 MALAYSIAGOV<br>240930 | 14,400,000  | 3,114.17 | 448,440,690 | 3,111.56 | 448,065,784 | 4.059000  | 2024/9/30  | 0.69 |
| マレーシ<br>ア | 国債証券 | 3.885 MALAYSIAGOV<br>290815 | 14,450,000  | 3,104.37 | 448,581,684 | 3,100.14 | 447,971,251 | 3.885000  | 2029/8/15  | 0.69 |

（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 5年 1月31日現在

| 種類   | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 国債証券 | 96.69   |
| 合計   | 96.69   |

（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

該当事項はありません。

東証REIT指数マザーファンド

投資状況

令和 5年 1月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計           | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|----------------|---------|
| 投資証券                     | 日本   | 76,753,201,850 | 98.25   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 1,370,028,645  | 1.75    |
| 純資産総額                    |      | 78,123,230,495 | 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 5年 1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（％） |
|-------------|----|------|---------------|---------|
| 不動産投信指数先物取引 | 買建 | 日本   | 1,460,672,500 | 1.87    |

（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 5年 1月31日現在

| 国／地域 | 種類   | 銘柄名              | 数量     | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(％) |
|------|------|------------------|--------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本   | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人     | 8,747  | 569,034.99      | 4,977,349,059   | 567,000         | 4,959,549,000   | 6.35            |
| 日本   | 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 7,498  | 560,038.81      | 4,199,171,007   | 557,000         | 4,176,386,000   | 5.35            |
| 日本   | 投資証券 | 日本都市ファンド投資法人     | 37,831 | 101,005.65      | 3,821,144,991   | 100,300         | 3,794,449,300   | 4.86            |
| 日本   | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人   | 12,638 | 291,633.61      | 3,685,665,671   | 294,300         | 3,719,363,400   | 4.76            |

|    |      |                         |        |            |               |         |               |      |
|----|------|-------------------------|--------|------------|---------------|---------|---------------|------|
| 日本 | 投資証券 | 野村不動産マスターファンド投資法人       | 24,247 | 152,402.12 | 3,695,294,398 | 151,900 | 3,683,119,300 | 4.71 |
| 日本 | 投資証券 | G L P投資法人               | 24,200 | 144,417.47 | 3,494,902,810 | 146,700 | 3,550,140,000 | 4.54 |
| 日本 | 投資証券 | 大和ハウスリート投資法人            | 11,302 | 276,536.6  | 3,125,416,763 | 282,800 | 3,196,205,600 | 4.09 |
| 日本 | 投資証券 | オリックス不動産投資法人            | 14,940 | 179,008.01 | 2,674,379,710 | 178,700 | 2,669,778,000 | 3.42 |
| 日本 | 投資証券 | ユナイテッド・アーバン投資法人         | 16,772 | 149,510.85 | 2,507,596,049 | 147,800 | 2,478,901,600 | 3.17 |
| 日本 | 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人         | 7,497  | 324,504.52 | 2,432,810,424 | 317,500 | 2,380,297,500 | 3.05 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパン・ホテル・リート投資法人        | 24,180 | 83,596.93  | 2,021,373,841 | 82,200  | 1,987,596,000 | 2.54 |
| 日本 | 投資証券 | インヴィンシブル投資法人            | 33,002 | 55,699.89  | 1,838,207,864 | 55,300  | 1,825,010,600 | 2.34 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プライムリアルティ投資法人         | 5,128  | 356,517.17 | 1,828,220,055 | 352,000 | 1,805,056,000 | 2.31 |
| 日本 | 投資証券 | 産業ファンド投資法人              | 11,205 | 146,702.53 | 1,643,801,889 | 143,900 | 1,612,399,500 | 2.06 |
| 日本 | 投資証券 | 積水ハウス・リート投資法人           | 22,531 | 71,005     | 1,599,813,658 | 71,000  | 1,599,701,000 | 2.05 |
| 日本 | 投資証券 | アクティビア・プロパティーズ投資法人      | 3,959  | 391,017.96 | 1,548,040,128 | 389,000 | 1,540,051,000 | 1.97 |
| 日本 | 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人      | 2,589  | 580,038.87 | 1,501,720,652 | 583,000 | 1,509,387,000 | 1.93 |
| 日本 | 投資証券 | 日本ロジスティクスファンド投資法人       | 5,056  | 303,991.36 | 1,536,980,333 | 296,100 | 1,497,081,600 | 1.92 |
| 日本 | 投資証券 | ラサールロジポート投資法人           | 9,179  | 155,611.75 | 1,428,360,260 | 157,300 | 1,443,856,700 | 1.85 |
| 日本 | 投資証券 | フロンティア不動産投資法人           | 2,782  | 504,022.91 | 1,402,191,740 | 501,000 | 1,393,782,000 | 1.78 |
| 日本 | 投資証券 | ケネディクス・オフィス投資法人         | 4,363  | 311,505.19 | 1,359,097,184 | 308,500 | 1,345,985,500 | 1.72 |
| 日本 | 投資証券 | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人     | 2,962  | 447,029.6  | 1,324,101,691 | 453,500 | 1,343,267,000 | 1.72 |
| 日本 | 投資証券 | 森ヒルズリート投資法人             | 8,817  | 151,599.89 | 1,336,656,276 | 147,600 | 1,301,389,200 | 1.67 |
| 日本 | 投資証券 | イオンリート投資法人              | 8,300  | 147,753.23 | 1,226,351,869 | 143,600 | 1,191,880,000 | 1.53 |
| 日本 | 投資証券 | 大和証券リビング投資法人            | 10,390 | 108,505.72 | 1,127,374,531 | 108,700 | 1,129,393,000 | 1.45 |
| 日本 | 投資証券 | ヒューリックリート投資法人           | 7,015  | 154,012.5  | 1,080,397,739 | 155,200 | 1,088,728,000 | 1.39 |
| 日本 | 投資証券 | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 5,499  | 197,002    | 1,083,314,042 | 193,600 | 1,064,606,400 | 1.36 |
| 日本 | 投資証券 | 三菱地所物流リート投資法人           | 2,576  | 403,532.13 | 1,039,498,772 | 408,500 | 1,052,296,000 | 1.35 |
| 日本 | 投資証券 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人      | 3,488  | 292,958.47 | 1,021,839,160 | 288,900 | 1,007,683,200 | 1.29 |
| 日本 | 投資証券 | 東急リアル・エステート投資法人         | 5,027  | 199,101.2  | 1,000,881,768 | 195,800 | 984,286,600   | 1.26 |

（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 5年 1月31日現在

| 種類   | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 投資証券 | 98.25   |
| 合計   | 98.25   |

（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 5年 1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（％） |
|-------------|-------|----------------|----|-----|----|---------------|---------------|---------|
| 不動産投信指数先物取引 | 大阪取引所 | 東証REIT 23年03月限 | 買建 | 805 | 円  | 1,459,867,500 | 1,460,672,500 | 1.87    |

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

MUAM G-REITマザーファンド

投資状況

令和 5年 1月31日現在  
（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域     | 時価合計           | 投資比率（％） |
|--------------------------|----------|----------------|---------|
| 投資証券                     | アメリカ     | 69,468,735,337 | 74.47   |
|                          | オーストラリア  | 6,286,924,185  | 6.74    |
|                          | イギリス     | 4,518,749,233  | 4.84    |
|                          | シンガポール   | 3,323,438,087  | 3.56    |
|                          | カナダ      | 1,732,671,991  | 1.86    |
|                          | フランス     | 1,707,403,769  | 1.83    |
|                          | 香港       | 1,399,281,318  | 1.50    |
|                          | ベルギー     | 983,265,758    | 1.05    |
|                          | スペイン     | 371,474,855    | 0.40    |
|                          | ニュージーランド | 356,827,120    | 0.38    |
|                          | 韓国       | 210,051,911    | 0.23    |
|                          | オランダ     | 168,305,087    | 0.18    |
|                          | イスラエル    | 108,830,970    | 0.12    |
|                          | ドイツ      | 44,386,899     | 0.05    |
|                          | アイルランド   | 37,507,221     | 0.04    |
|                          | イタリア     | 8,775,340      | 0.01    |
|                          | 小計       | 90,726,629,081 | 97.26   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —        | 2,553,076,411  | 2.74    |
| 純資産総額                    |          | 93,279,705,492 | 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 5年 1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（％） |
|-------------|----|------|---------------|---------|
| 不動産投信指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 2,427,344,771 | 2.60    |

（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 5年 1月31日現在

| 国／<br>地域 | 種類   | 銘柄名                          | 数量        | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|------|------------------------------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| アメリカ     | 投資証券 | PROLOGIS INC                 | 472,084   | 15,241.75       | 7,195,389,768   | 16,672.76       | 7,870,943,846   | 8.44            |
| アメリカ     | 投資証券 | EQUINIX INC                  | 47,332    | 88,654.03       | 4,196,172,902   | 94,572.48       | 4,476,304,822   | 4.80            |
| アメリカ     | 投資証券 | PUBLIC STORAGE               | 80,863    | 36,255.07       | 2,931,693,986   | 38,996.17       | 3,153,347,966   | 3.38            |
| アメリカ     | 投資証券 | REALTY INCOME CORP           | 321,253   | 8,424.12        | 2,706,274,324   | 8,841.95        | 2,840,503,574   | 3.05            |
| アメリカ     | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 167,486   | 15,790.97       | 2,644,767,535   | 16,432.69       | 2,752,246,606   | 2.95            |
| アメリカ     | 投資証券 | WELLTOWER INC                | 242,052   | 8,975.01        | 2,172,419,794   | 9,722.62        | 2,353,380,681   | 2.52            |
| アメリカ     | 投資証券 | VICI PROPERTIES INC          | 492,750   | 4,166.45        | 2,053,021,591   | 4,420.32        | 2,178,114,454   | 2.34            |
| アメリカ     | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC     | 147,108   | 13,499.11       | 1,985,827,223   | 14,486.08       | 2,131,018,860   | 2.28            |
| オーストラリア  | 投資証券 | GOODMAN GROUP                | 879,207   | 1,632.43        | 1,435,250,237   | 1,851.47        | 1,627,825,560   | 1.75            |
| アメリカ     | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 71,608    | 21,411.35       | 1,533,224,551   | 22,606.53       | 1,618,808,894   | 1.74            |
| アメリカ     | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 76,668    | 19,146.96       | 1,467,959,445   | 20,533.36       | 1,574,252,304   | 1.69            |
| アメリカ     | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL           | 174,120   | 7,798.26        | 1,357,833,901   | 8,096.96        | 1,409,844,103   | 1.51            |
| アメリカ     | 投資証券 | VENTAS INC                   | 205,027   | 6,134.57        | 1,257,752,705   | 6,690.50        | 1,371,733,472   | 1.47            |
| アメリカ     | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC      | 68,540    | 18,834.23       | 1,290,898,156   | 19,961.90       | 1,368,189,311   | 1.47            |
| アメリカ     | 投資証券 | MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 59,123    | 20,560.30       | 1,215,586,969   | 21,103.52       | 1,247,703,561   | 1.34            |
| アメリカ     | 投資証券 | INVITATION HOMES INC         | 297,406   | 3,872.77        | 1,151,785,322   | 4,148.94        | 1,233,921,434   | 1.32            |
| アメリカ     | 投資証券 | SUN COMMUNITIES INC          | 63,433    | 18,684.82       | 1,185,234,421   | 19,262.59       | 1,221,883,922   | 1.31            |
| アメリカ     | 投資証券 | WP CAREY INC                 | 106,770   | 10,319.25       | 1,101,786,871   | 11,058.63       | 1,180,730,694   | 1.27            |
| 香港       | 投資証券 | LINK REIT                    | 1,083,400 | 999.62          | 1,082,989,931   | 1,070.59        | 1,159,882,623   | 1.24            |
| アメリカ     | 投資証券 | IRON MOUNTAIN INC            | 148,828   | 6,628.37        | 986,487,689     | 7,105.39        | 1,057,481,906   | 1.13            |
| アメリカ     | 投資証券 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 275,996   | 3,440.94        | 949,686,781     | 3,540.95        | 977,289,637     | 1.05            |
| アメリカ     | 投資証券 | ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 33,166    | 28,040.71       | 929,998,416     | 28,643.38       | 949,986,467     | 1.02            |
| アメリカ     | 投資証券 | KIMCO REALTY CORP            | 317,921   | 2,820.90        | 896,823,508     | 2,884.69        | 917,104,070     | 0.98            |
| アメリカ     | 投資証券 | GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 131,848   | 6,641.47        | 875,665,111     | 6,865.33        | 905,180,214     | 0.97            |
| アメリカ     | 投資証券 | HOST HOTELS & RESORTS INC    | 368,586   | 2,107.45        | 776,777,877     | 2,417.60        | 891,096,868     | 0.96            |
| アメリカ     | 投資証券 | CAMDEN PROPERTY TRUST        | 54,577    | 14,693.88       | 801,948,146     | 15,627.69       | 852,912,797     | 0.91            |
| アメリカ     | 投資証券 | UDR INC                      | 156,776   | 5,114.14        | 801,775,668     | 5,396.23        | 846,000,797     | 0.91            |
| イギリス     | 投資証券 | SEGRO PLC                    | 621,717   | 1,292.62        | 803,647,087     | 1,354.02        | 841,819,067     | 0.90            |
| アメリカ     | 投資証券 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 89,637    | 8,581.52        | 769,221,907     | 8,826.29        | 791,162,650     | 0.85            |
| アメリカ     | 投資証券 | REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 93,968    | 7,360.54        | 691,655,604     | 8,124.36        | 763,430,509     | 0.82            |

（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 5年 1月31日現在

| 種類   | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 投資証券 | 97.26   |

|    |       |
|----|-------|
| 合計 | 97.26 |
|----|-------|

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

令和 5年 1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（％） |
|-------------------------|------|----------|------------|----|-----|--------|--------------|---------------|------------|---------------|---------|
| 不動産<br>投信指<br>数先物<br>取引 | アメリカ | シカゴ商品取引所 | DJREIT2303 | 買建 | 526 | アメリカドル | 17,833,732.1 | 2,326,767,027 | 18,604,620 | 2,427,344,771 | 2.60    |

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

《参考情報》

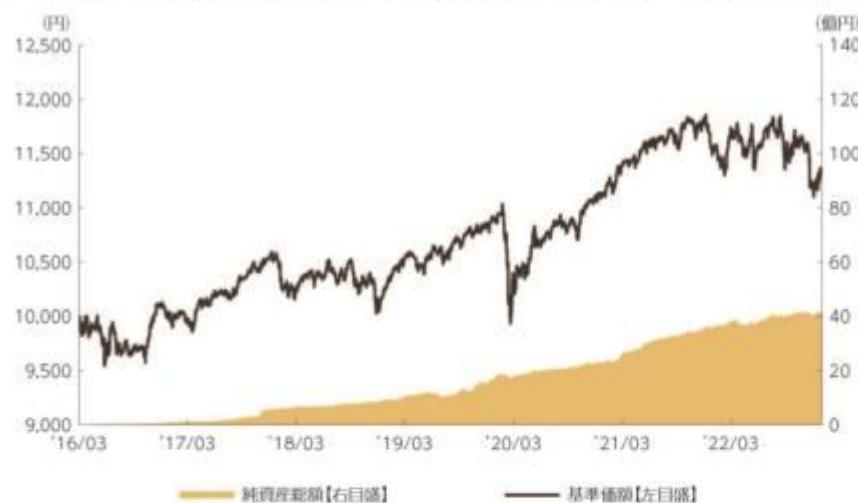


## 運用実績

2023年1月31日現在

### マイゴールキーパー

#### ■基準価額・純資産の推移 2016年3月30日(設定日)～2023年1月31日



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

#### ■基準価額・純資産

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 11,306円 |
| 純資産総額 | 41.4億円  |

●純資産総額は表示桁未満切捨て

#### ■分配の推移

|         |    |
|---------|----|
| 2023年1月 | 0円 |
| 2022年1月 | 0円 |
| 2021年1月 | 0円 |
| 2020年1月 | 0円 |
| 2019年1月 | 0円 |
| 2018年1月 | 0円 |
| 設定来累計   | 0円 |

●分配金は1万口当たり、税引前

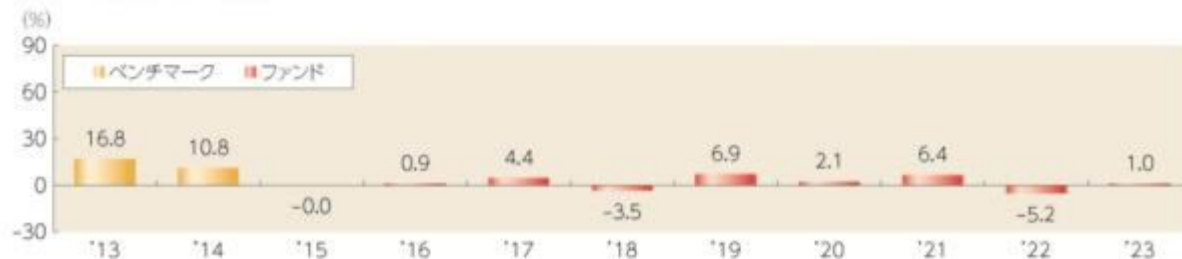
#### ■主要な資産の状況

| 資産別構成   | 比率     | 組入上位通貨      | 比率    | 組入上位銘柄         | 種類  | 業種/種別             | 国・地域 | 比率   |
|---------|--------|-------------|-------|----------------|-----|-------------------|------|------|
| 国内株式    | 7.9%   | 1 円         | 60.1% | APPLE INC      | 株式  | テクノロジー/ハードウェア/半導体 | アメリカ | 0.5% |
| 国内債券    | 49.2%  | 2 アメリカドル    | 22.9% | MICROSOFT CORP | 株式  | ソフトウェア・サービス       | アメリカ | 0.3% |
| 国内リート   | 1.9%   | 3 ユーロ       | 10.3% | トヨタ自動車         | 株式  | 輸送用機器             | 日本   | 0.3% |
| 外国株式    | 9.5%   | 4 イギリスポンド   | 1.9%  | ソニーグループ        | 株式  | 電気機器              | 日本   | 0.2% |
| 外国債券    | 26.4%  | 5 中国元       | 1.1%  | 第363回利付国債(10年) | 債券  | 国債                | 日本   | 1.0% |
| 外国リート   | 3.2%   | 6 カナダドル     | 1.0%  | 第137回利付国債(20年) | 債券  | 国債                | 日本   | 0.7% |
|         |        | 7 オーストラリアドル | 0.9%  | 第359回利付国債(10年) | 債券  | 国債                | 日本   | 0.6% |
| コールローン他 |        | 8 スイスフラン    | 0.3%  | PROLOGIS INC   | リート |                   | アメリカ | 0.3% |
| (負債控除後) | 1.9%   | 9 シンガポールドル  | 0.3%  | EQUINIX INC    | リート |                   | アメリカ | 0.2% |
| 合計      | 100.0% | 10 メキシコペソ   | 0.2%  | 日本ビルファンド投資法人   | リート |                   | 日本   | 0.1% |

| その他資産の状況        | 比率   |
|-----------------|------|
| 株価指数先物取引(買建)    | 0.3% |
| 債券先物取引(買建)      | 0.1% |
| 不動産投信指数先物取引(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)
- コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。
- 国内株式の業種は、東京証券取引所の33業種分類によるもの
- 外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。
- 「国・地域」は原則、発行通貨ベースで分類しています。(ただし、発行通貨がユーロの場合は発行地)

#### ■年間収益率の推移

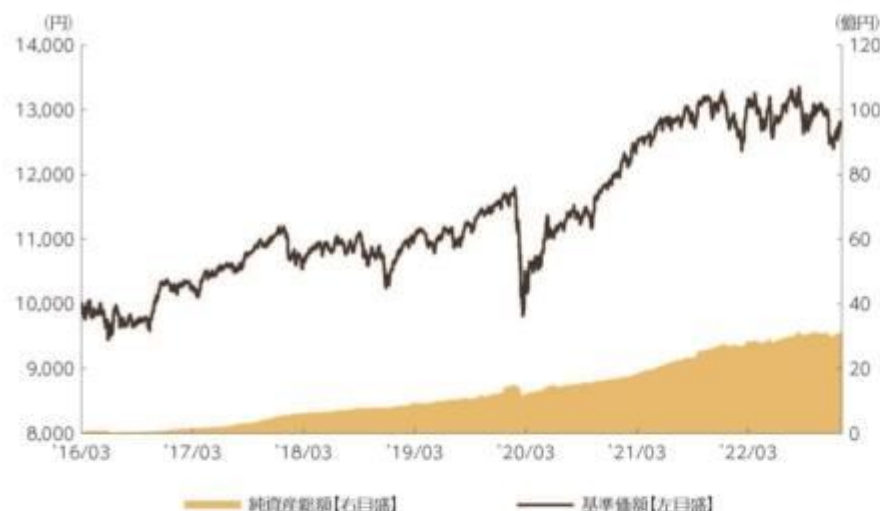


- 収益率は基準価額で計算
- 2016年は設定日から年末までの、2023年は年初から1月31日までの収益率を表示
- 2015年以前はベンチマークの年間収益率を表示

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

## マイディフェンダー

## ■基準価額・純資産の推移 2016年3月30日(設定日)～2023年1月31日



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

## ■基準価額・純資産

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 12,764円 |
| 純資産総額 | 31.0億円  |

・純資産総額は表示桁未満切捨て

## ■分配の推移

|         |    |
|---------|----|
| 2023年1月 | 0円 |
| 2022年1月 | 0円 |
| 2021年1月 | 0円 |
| 2020年1月 | 0円 |
| 2019年1月 | 0円 |
| 2018年1月 | 0円 |
| 設定来累計   | 0円 |

・分配金は1万口当たり、税引前

## ■主要な資産の状況

| 資産別構成              | 比率     | 組入上位通貨      | 比率    | 組入上位銘柄         | 種類  | 業種／種別              | 国・地域 | 比率   |
|--------------------|--------|-------------|-------|----------------|-----|--------------------|------|------|
| 国内株式               | 11.8%  | 1 円         | 55.3% | APPLE INC      | 株式  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | アメリカ | 0.7% |
| 国内債券               | 34.9%  | 2 アメリカドル    | 24.2% | MICROSOFT CORP | 株式  | ソフトウェア・サービス        | アメリカ | 0.5% |
| 国内リート              | 3.9%   | 3 ユーロ       | 7.2%  | トヨタ自動車         | 株式  | 輸送用機器              | 日本   | 0.4% |
| 外国株式               | 18.1%  | 4 イギリスポンド   | 1.8%  | ソニーグループ        | 株式  | 電気機器               | 日本   | 0.3% |
| 外国債券               | 19.2%  | 5 中国元       | 1.2%  | 第363回利付国債(10年) | 債券  | 国債                 | 日本   | 0.7% |
| 外国リート              | 6.3%   | 6 オーストラリアドル | 1.1%  | 第137回利付国債(20年) | 債券  | 国債                 | 日本   | 0.5% |
|                    |        | 7 カナダドル     | 1.0%  | 第359回利付国債(10年) | 債券  | 国債                 | 日本   | 0.4% |
|                    |        | 8 香港ドル      | 1.0%  | PROLOGIS INC   | リート | ー                  | アメリカ | 0.5% |
| コールローン他<br>(負債控除後) | 5.8%   | 9 メキシコペソ    | 0.6%  | EQUINIX INC    | リート | ー                  | アメリカ | 0.3% |
| 合計                 | 100.0% | 10 ブラジルレアル  | 0.5%  | 日本ビルファンド投資法人   | リート | ー                  | 日本   | 0.2% |

| その他資産の状況        | 比率   |
|-----------------|------|
| 株価指数先物取引（買建）    | 0.7% |
| 債券先物取引（買建）      | 0.0% |
| 不動産投資指数先物取引（買建） | 0.2% |

- ・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- ・コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。
- ・国内株式の業種は、東京証券取引所の33業種分類によるもの
- ・外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。
- ・「国・地域」は原則、発行通貨ベースで分類しています。(ただし、発行通貨がユーロの場合は発行地)

## ■年間収益率の推移



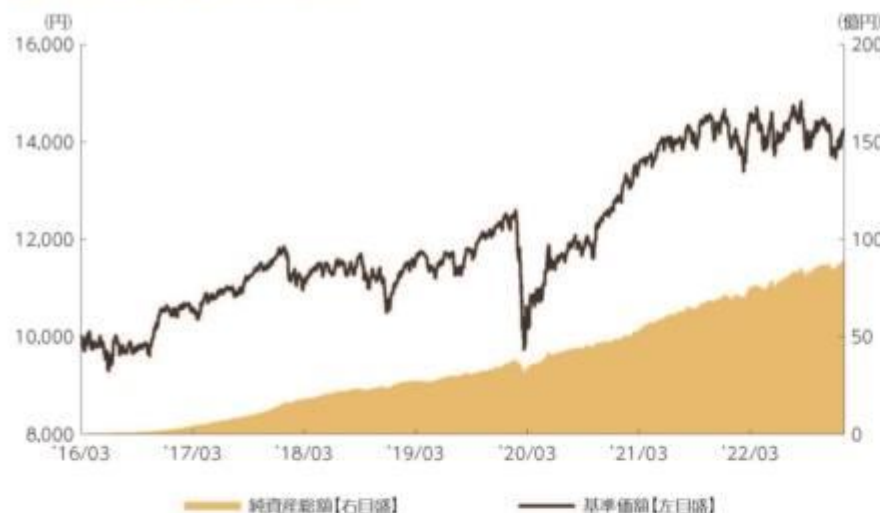
- ・収益率は基準価額で計算
- ・2016年は設定日から年末までの、2023年は年初から1月31日までの収益率を表示
- ・2015年以前はベンチマークの年間収益率を表示

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



## マイミッドフィルダー

## ■基準価額・純資産の推移 2016年3月30日(設定日)～2023年1月31日



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

## ■基準価額・純資産

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 14,176円 |
| 純資産総額 | 88.9億円  |

・純資産総額は表示桁未満切捨て

## ■分配の推移

|         |    |
|---------|----|
| 2023年1月 | 0円 |
| 2022年1月 | 0円 |
| 2021年1月 | 0円 |
| 2020年1月 | 0円 |
| 2019年1月 | 0円 |
| 2018年1月 | 0円 |
| 設定来累計   | 0円 |

・分配金は1万口当たり、税引前

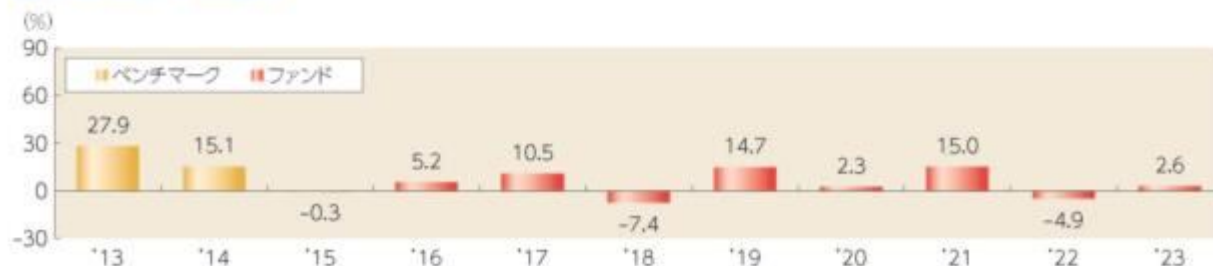
## ■主要な資産の状況

| 資産別構成   | 比率     | 組入上位通貨      | 比率    | 組入上位銘柄         | 種類  | 業種/種別              | 国・地域 | 比率   |
|---------|--------|-------------|-------|----------------|-----|--------------------|------|------|
| 国内株式    | 14.7%  | 1 円         | 51.1% | APPLE INC      | 株式  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | アメリカ | 1.0% |
| 国内債券    | 23.8%  | 2 アメリカドル    | 25.0% | MICROSOFT CORP | 株式  | ソフトウェア・サービス        | アメリカ | 0.7% |
| 国内リート   | 5.7%   | 3 ユーロ       | 4.1%  | トヨタ自動車         | 株式  | 輸送用機器              | 日本   | 0.5% |
| 外国株式    | 26.1%  | 4 香港ドル      | 1.8%  | ソニーグループ        | 株式  | 電気機器               | 日本   | 0.4% |
| 外国債券    | 12.0%  | 5 イギリスポンド   | 1.7%  | 第363回利付国債(10年) | 債券  | 国債                 | 日本   | 0.5% |
| 外国リート   | 9.3%   | 6 中国元       | 1.3%  | 第137回利付国債(20年) | 債券  | 国債                 | 日本   | 0.3% |
|         |        | 7 オーストラリアドル | 1.2%  | 第359回利付国債(10年) | 債券  | 国債                 | 日本   | 0.3% |
| コールローン他 |        | 8 ブラジルレアル   | 1.1%  | PROLOGIS INC   | リート | —                  | アメリカ | 0.8% |
| (負債控除後) | 8.4%   | 9 カナダドル     | 1.1%  | EQUINIX INC    | リート | —                  | アメリカ | 0.5% |
| 合計      | 100.0% | 10 メキシコペソ   | 1.0%  | 日本ビルファンド投資法人   | リート | —                  | 日本   | 0.4% |

| その他資産の状況         | 比率   |
|------------------|------|
| 株指指数先物取引 (買建)    | 0.9% |
| 債券先物取引 (買建)      | 0.0% |
| 不動産投信指数先物取引 (買建) | 0.3% |

- ・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- ・コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。
- ・国内株式の業種は、東京証券取引所の33業種分類によるもの
- ・外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。
- ・「国・地域」は原則、発行通貨ベースで分類しています。(ただし、発行通貨がユーロの場合は発行地)

## ■年間収益率の推移

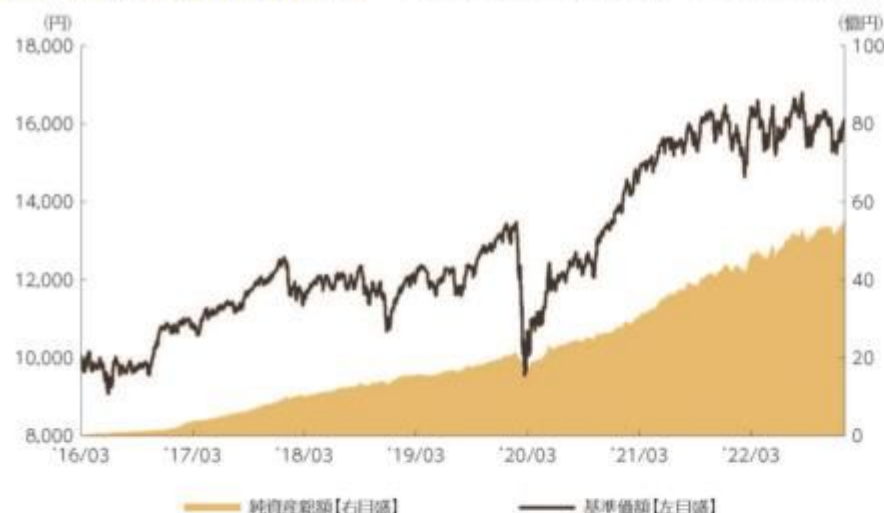


- ・収益率は基準価額で計算
- ・2016年は設定日から年末までの、2023年は年初から1月31日までの収益率を表示
- ・2015年以前はベンチマークの年間収益率を表示

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

## マイフォワード

### ■基準価額・純資産の推移 2016年3月30日(設定日)～2023年1月31日



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

### ■基準価額・純資産

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 16,011円 |
| 純資産総額 | 54.7億円  |

・純資産総額は表示桁未満切捨て

### ■分配の推移

|         |    |
|---------|----|
| 2023年1月 | 0円 |
| 2022年1月 | 0円 |
| 2021年1月 | 0円 |
| 2020年1月 | 0円 |
| 2019年1月 | 0円 |
| 2018年1月 | 0円 |
| 設定来累計   | 0円 |

・分配金は1万口当たり、税引前

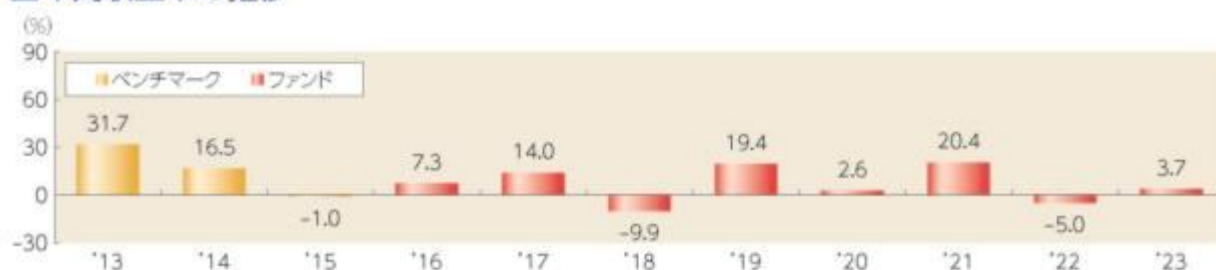
### ■主要な資産の状況

| 資産別構成              | 比率     | 組入上位通貨      | 比率    | 組入上位銘柄                       | 種類  | 業種/種別              | 国・地域  | 比率   |
|--------------------|--------|-------------|-------|------------------------------|-----|--------------------|-------|------|
| 国内株式               | 19.6%  | 1 円         | 38.3% | APPLE INC                    | 株式  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | アメリカ  | 1.2% |
| 国内債券               | 2.0%   | 2 アメリカドル    | 30.7% | MICROSOFT CORP               | 株式  | ソフトウェア・サービス        | アメリカ  | 0.9% |
| 国内リート              | 7.5%   | 3 ユーロ       | 4.1%  | トヨタ自動車                       | 株式  | 輸送用機器              | 日本    | 0.7% |
| 外国株式               | 35.6%  | 4 香港ドル      | 2.9%  | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 株式  | 半導体・半導体製造装置        | 台湾    | 0.6% |
| 外国債券               | 11.8%  | 5 イギリスポンド   | 2.0%  | BRAZIL-LTN 240101            | 債券  | 国債                 | ブラジル  | 0.3% |
| 外国リート              | 12.4%  | 6 中国元       | 1.6%  | 8 SOUTH AFRICA 300131        | 債券  | 国債                 | 南アフリカ | 0.1% |
| コールローン他<br>(負債控除後) | 11.1%  | 7 オーストラリアドル | 1.6%  | 10 (IN) BRAZIL NT 270101     | 債券  | 国債                 | ブラジル  | 0.1% |
| 合計                 | 100.0% | 8 ブラジルレアル   | 1.5%  | PROLOGIS INC                 | リート | —                  | アメリカ  | 1.1% |
|                    |        | 9 ニュー台湾ドル   | 1.4%  | EQUINIX INC                  | リート | —                  | アメリカ  | 0.6% |
|                    |        | 10 カナダドル    | 1.3%  | 日本ビルファンド投資法人                 | リート | —                  | 日本    | 0.5% |

| その他資産の状況         | 比率   |
|------------------|------|
| 株価指数先物取引 (買建)    | 1.3% |
| 債券先物取引 (買建)      | 0.0% |
| 不動産投信指数先物取引 (買建) | 0.5% |

- ・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- ・コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。
- ・国内株式の業種は、東京証券取引所の33業種分類によるもの
- ・外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。
- ・「国・地域」は原則、発行通貨ベースで分類しています。(ただし、発行通貨がユーロの場合は発行地)

### ■年間収益率の推移



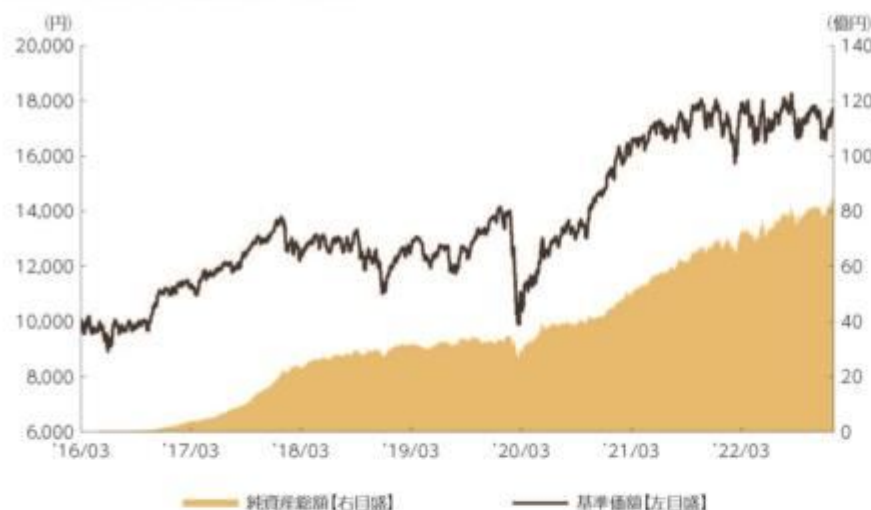
- ・収益率は基準価額で計算
- ・2016年は設定日から年末までの、2023年は年初から1月31日までの収益率を表示
- ・2015年以前はベンチマークの年間収益率を表示

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



## マイストライカー

## ■基準価額・純資産の推移 2016年3月30日(設定日)～2023年1月31日



## ■基準価額・純資産

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 17,612円 |
| 純資産総額 | 84.0億円  |

●純資産総額は表示桁未満切捨て

## ■分配の推移

|         |    |
|---------|----|
| 2023年1月 | 0円 |
| 2022年1月 | 0円 |
| 2021年1月 | 0円 |
| 2020年1月 | 0円 |
| 2019年1月 | 0円 |
| 2018年1月 | 0円 |
| 設定来累計   | 0円 |

●分配金は1万口当たり、税引前

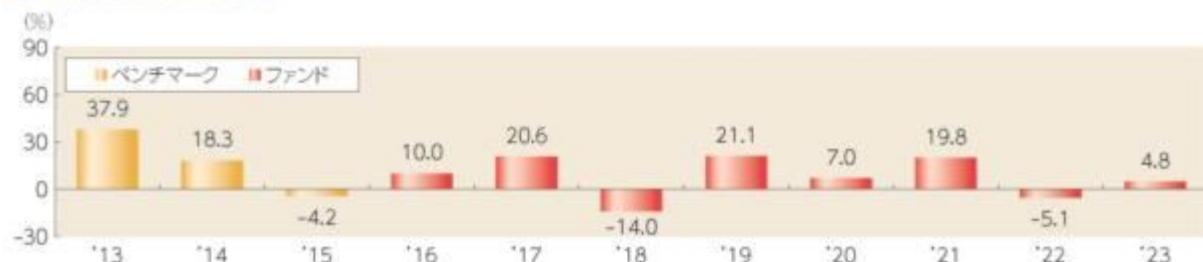
## ■主要な資産の状況

| 資産別構成              | 比率     | 組入上位通貨     | 比率    | 組入上位銘柄                       | 種類  | 業種/種別              | 国・地域  | 比率   |
|--------------------|--------|------------|-------|------------------------------|-----|--------------------|-------|------|
| 国内株式               | 24.5%  | 1 円        | 33.8% | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 株式  | 半導体・半導体製造装置        | 台湾    | 1.6% |
| 国内債券               | 0.5%   | 2 アメリカドル   | 29.1% | APPLE INC                    | 株式  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | アメリカ  | 1.6% |
| 国内リート              | 1.9%   | 3 香港ドル     | 6.7%  | MICROSOFT CORP               | 株式  | ソフトウェア・サービス        | アメリカ  | 1.2% |
| 外国株式               | 58.0%  | 4 ユーロ      | 3.9%  | TENCENT HOLDINGS LTD         | 株式  | メディア・娯楽            | 香港    | 1.1% |
| 外国債券               | 2.4%   | 5 ニュー台湾ドル  | 3.7%  | BRAZIL-LTN 240101            | 債券  | 国債                 | ブラジル  | 0.1% |
| 外国リート              | 3.8%   | 6 インドルピー   | 3.3%  | 8 SOUTH AFRICA 300131        | 債券  | 国債                 | 南アフリカ | 0.0% |
| コールローン他<br>(負債控除後) | 8.9%   | 7 韓国ウォン    | 3.0%  | 10 (IN)BRAZIL NT 270101      | 債券  | 国債                 | ブラジル  | 0.0% |
| 合計                 | 100.0% | 8 イギリスポンド  | 1.8%  | PROLOGIS INC                 | リート | —                  | アメリカ  | 0.3% |
|                    |        | 9 中国元      | 1.5%  | EQUINIX INC                  | リート | —                  | アメリカ  | 0.2% |
|                    |        | 10 ブラジルレアル | 1.5%  | PUBLIC STORAGE               | リート | —                  | アメリカ  | 0.1% |

| その他資産の状況         | 比率   |
|------------------|------|
| 株価指数先物取引 (買建)    | 2.1% |
| 債券先物取引 (買建)      | 0.0% |
| 不動産投信指数先物取引 (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)
- 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。
- 「国・地域」は原則、発行通貨ベースで分類しています。(ただし、発行通貨がユーロの場合は発行地)

## ■年間収益率の推移



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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

## 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。

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

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

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

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

「eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）／（マイミッドフィルダー）／（マイフォワード）／（マイストライカー）」

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

香港取引所の休業日

香港の銀行の休業日

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

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いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

## ⑥申込手数料

ありません。

## ⑦申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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

## ⑧申込受付時間

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の

事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

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

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

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。

「eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）／（マイミッドフィルダー）／（マイフォワード）／（マイストライカー）」

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

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

#### ⑩スイッチング

各ファンド間でのスイッチングが可能です。

販売会社によっては、一部のファンドのみの取扱いとなる場合やスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

スイッチングを行う場合は、解約金の利益に対して税金がかかります。

※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。

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

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

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

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

「eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）／（マイミッドフィルダー）／（マイフォワード）／（マイストライカー）」

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

香港取引所の休業日

香港の銀行の休業日

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

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

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

「eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）／（マイミッドフィルダー）／（マイフォワード）／（マイストライカー）」

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差引いた価額

④信託財産留保額

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

ありません。

「eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）／（マイミッドフィルダー）」

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.05%をかけた額

「eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）／（マイストライカー）」

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.10%をかけた額

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/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

⑦支払開始日

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。

「eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）／（マイミッドフィルダー）／（マイフォワード）／（マイストライカー）」

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

⑧解約請求受付時間

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

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

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

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。

「eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）／（マイミッドフィルダー）／（マイフォワード）／（マイストライカー）」

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

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

### 3【資産管理等の概要】

#### （１）【資産の評価】

##### ①基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

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

（資産の評価方法）

##### ・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

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

##### ・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

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

##### ・公社債等

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

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

##### ・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

##### ・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

##### ・外貨建資産

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

## ・外国為替予約取引

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

## ・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

## ②基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

## ③基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

## (2) 【保管】

該当事項はありません。

## (3) 【信託期間】

無期限（2016年3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1月27日から翌年1月26日まで

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

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

## (5) 【その他】

## ①ファンドの償還条件等

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

・各ファンドについて、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合

・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃されたときまたはやむを得ない事情が発生したとき

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

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

## ②信託約款の変更等

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

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

### ③ファンドの償還等に関する開示方法

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

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

### ④反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

### ⑤関係法人との契約の更改

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

### ⑥運用報告書

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

### ⑦委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

### ⑧受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

### ⑨信託事務の再信託

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

⑩公告

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

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

①分配金受取コース（一般コース）

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

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

②分配金再投資コース（累積投資コース）

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

(2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

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

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

(3) 換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

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



### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（令和4年1月27日から令和5年1月26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】

## 【eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第6期<br>[ 令和 4年 1月26日現在 ] | 第7期<br>[ 令和 5年 1月26日現在 ] |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
| 資産の部            |                          |                          |
| 流動資産            |                          |                          |
| コール・ローン         | 52,634,945               | 56,244,231               |
| 親投資信託受益証券       | 3,538,823,310            | 4,108,331,836            |
| 未収入金            | 2,036,591                | 3,783,924                |
| 流動資産合計          | 3,593,494,846            | 4,168,359,991            |
| 資産合計            | 3,593,494,846            | 4,168,359,991            |
| 負債の部            |                          |                          |
| 流動負債            |                          |                          |
| 未払解約金           | 9,074,237                | 7,195,772                |
| 未払受託者報酬         | 1,117,438                | 1,349,484                |
| 未払委託者報酬         | 8,194,489                | 9,896,121                |
| 未払利息            | 23                       | 25                       |
| その他未払費用         | 66,981                   | 80,911                   |
| 流動負債合計          | 18,453,168               | 18,522,313               |
| 負債合計            | 18,453,168               | 18,522,313               |
| 純資産の部           |                          |                          |
| 元本等             |                          |                          |
| 元本              | 3,104,845,029            | 3,664,571,956            |
| 剰余金             |                          |                          |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 470,196,649              | 485,265,722              |
| （分配準備積立金）       | 105,926,913              | 117,941,182              |
| 元本等合計           | 3,575,041,678            | 4,149,837,678            |
| 純資産合計           | 3,575,041,678            | 4,149,837,678            |
| 負債純資産合計         | 3,593,494,846            | 4,168,359,991            |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 第6期<br>自 令和3年1月27日<br>至 令和4年1月26日 | 第7期<br>自 令和4年1月27日<br>至 令和5年1月26日 |
|-------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 営業収益                                      |                                   |                                   |
| 受取利息                                      | 115                               | 181                               |
| 有価証券売買等損益                                 | 92,457,942                        | △47,483,109                       |
| 営業収益合計                                    | 92,458,057                        | △47,482,928                       |
| 営業費用                                      |                                   |                                   |
| 支払利息                                      | 7,350                             | 15,816                            |
| 受託者報酬                                     | 1,997,128                         | 2,569,305                         |
| 委託者報酬                                     | 14,645,503                        | 18,841,449                        |
| その他費用                                     | 119,698                           | 154,043                           |
| 営業費用合計                                    | 16,769,679                        | 21,580,613                        |
| 営業利益又は営業損失（△）                             | 75,688,378                        | △69,063,541                       |
| 経常利益又は経常損失（△）                             | 75,688,378                        | △69,063,541                       |
| 当期純利益又は当期純損失（△）                           | 75,688,378                        | △69,063,541                       |
| 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（△） | 27,167,524                        | 6,294,934                         |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△）                           | 234,057,837                       | 470,196,649                       |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 298,115,681                       | 222,183,256                       |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 298,115,681                       | 222,183,256                       |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 110,497,723                       | 131,755,708                       |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 110,497,723                       | 131,755,708                       |
| 分配金                                       | -                                 | -                                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）                           | 470,196,649                       | 485,265,722                       |

（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6期<br>[令和 4年 1月26日現在] | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在] |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 1. 期首元本額  | 2,067,756,033円         | 3,104,845,029円         |
| 期中追加設定元本額 | 1,937,700,542円         | 1,422,813,306円         |
| 期中一部解約元本額 | 900,611,546円           | 863,086,379円           |
| 2. 受益権の総数 | 3,104,845,029口         | 3,664,571,956口         |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 第6期<br>自 令和 3年 1月27日<br>至 令和 4年 1月26日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 第7期<br>自 令和 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26日 |                |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|----------------|--|--------------|---|-------------|---------------------------|---|-------------|--------|---|--------------|----------|---|-------------|---------------|-----------|--------------|--------------|---|----------------|---------------|--------------|--------|------------|---|----|---------|--------------|----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|--|--|--------------|---|-------------|---------------------------|---|----|--------|---|--------------|----------|---|-------------|---------------|-----------|--------------|--------------|---|----------------|---------------|--------------|--------|------------|---|----|---------|--------------|----|
| 1. 分配金の計算過程                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 1. 分配金の計算過程                           |                |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| <table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>30,817,596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>17,703,258円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>364,269,736円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>57,406,059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>470,196,649円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>3,104,845,029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>1,514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 | 30,817,596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 | 17,703,258円 | 収益調整金額 | C | 364,269,736円 | 分配準備積立金額 | D | 57,406,059円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 470,196,649円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 3,104,845,029口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 1,514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><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>36,226,496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>367,324,540円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>81,714,686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>485,265,722円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>3,664,571,956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>1,324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 | 36,226,496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 | 367,324,540円 | 分配準備積立金額 | D | 81,714,686円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 485,265,722円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 3,664,571,956口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 1,324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                                     | 30,817,596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                                     | 17,703,258円    |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 収益調整金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | C                                     | 364,269,736円   |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | D                                     | 57,406,059円    |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | E=A+B+C+D                             | 470,196,649円   |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | F                                     | 3,104,845,029口 |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 1万口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | G=E/F*10,000                          | 1,514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                                     | 36,226,496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                                     | 367,324,540円   |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | D                                     | 81,714,686円    |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | E=A+B+C+D                             | 485,265,722円   |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | F                                     | 3,664,571,956口 |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 1万口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | G=E/F*10,000                          | 1,324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6期<br>自 令和 3年 1月27日<br>至 令和 4年 1月26日                                                                                                                                                                    | 第7期<br>自 令和 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26日 |
|-------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|
| 1.金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。                                                                                                  | 同左                                    |
| 2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。                                                                                                                                | 同左                                    |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> | 同左                                    |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                  | 第6期<br>[令和 4年 1月26日現在]                                                                                                                                                                                              | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在]                                                                 |
|---------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                                              | 同左                                                                                     |
| 2.時価の算定方法           | <p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> | <p>(1) 有価証券</p> <p>同左</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>同左</p> |

| 区分                        | 第6期<br>[令和 4年 1月26日現在]                                           | 第7期<br>[令和 5年 1月26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6期<br>[令和 4年 1月26日現在]   | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在]   |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) |
| 親投資信託受益証券 | 67,280,484               | △61,944,707              |
| 合計        | 67,280,484               | △61,944,707              |

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

|              | 第6期<br>[令和 4年 1月26日現在] | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在] |
|--------------|------------------------|------------------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.1514円                | 1.1324円                |
| (1万口当たり純資産額) | (11,514円)              | (11,324円)              |

## （4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表  
(1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種 類       | 銘 柄                | 口数            | 評価額           | 備考 |
|-----------|--------------------|---------------|---------------|----|
| 親投資信託受益証券 | MUAM G－REITマザーファンド | 57,106,285    | 127,141,432   |    |
|           | 東証REIT指数マザーファンド    | 24,008,507    | 82,106,693    |    |
|           | TOPIXマザーファンド       | 145,655,526   | 341,023,283   |    |
|           | 外国株式インデックスマザーファンド  | 91,013,923    | 417,635,588   |    |
|           | 日本債券インデックスマザーファンド  | 1,584,239,223 | 2,027,034,085 |    |
|           | 外国債券インデックスマザーファンド  | 495,920,340   | 1,113,390,755 |    |
| 合計        |                    | 2,397,943,804 | 4,108,331,836 |    |

## 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。



## 【eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）】

## （１）【貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 第6期<br>[ 令和 4年 1月26日現在 ] | 第7期<br>[ 令和 5年 1月26日現在 ] |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
| 資産の部            |                          |                          |
| 流動資産            |                          |                          |
| コール・ローン         | 38,107,127               | 38,777,852               |
| 親投資信託受益証券       | 2,634,050,202            | 3,063,500,795            |
| 未収入金            | 17,406,946               | 811,220                  |
| 流動資産合計          | 2,689,564,275            | 3,103,089,867            |
| 資産合計            | 2,689,564,275            | 3,103,089,867            |
| 負債の部            |                          |                          |
| 流動負債            |                          |                          |
| 未払解約金           | 21,841,365               | 141,097                  |
| 未払受託者報酬         | 825,285                  | 1,013,221                |
| 未払委託者報酬         | 6,052,085                | 7,430,222                |
| 未払利息            | 16                       | 17                       |
| その他未払費用         | 49,460                   | 60,735                   |
| 流動負債合計          | 28,768,211               | 8,645,292                |
| 負債合計            | 28,768,211               | 8,645,292                |
| 純資産の部           |                          |                          |
| 元本等             |                          |                          |
| 元本              | 2,090,578,288            | 2,426,160,228            |
| 剰余金             |                          |                          |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 570,217,776              | 668,284,347              |
| （分配準備積立金）       | 176,489,897              | 188,344,192              |
| 元本等合計           | 2,660,796,064            | 3,094,444,575            |
| 純資産合計           | 2,660,796,064            | 3,094,444,575            |
| 負債純資産合計         | 2,689,564,275            | 3,103,089,867            |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 第6期<br>自 令和3年1月27日<br>至 令和4年1月26日 | 第7期<br>自 令和4年1月27日<br>至 令和5年1月26日 |
|-------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 営業収益                                      |                                   |                                   |
| 受取利息                                      | 81                                | 136                               |
| 有価証券売買等損益                                 | 106,168,528                       | 18,311,594                        |
| 営業収益合計                                    | 106,168,609                       | 18,311,730                        |
| 営業費用                                      |                                   |                                   |
| 支払利息                                      | 5,269                             | 12,278                            |
| 受託者報酬                                     | 1,452,988                         | 1,927,727                         |
| 委託者報酬                                     | 10,655,203                        | 14,136,568                        |
| その他費用                                     | 87,062                            | 115,550                           |
| 営業費用合計                                    | 12,200,522                        | 16,192,123                        |
| 営業利益又は営業損失（△）                             | 93,968,087                        | 2,119,607                         |
| 経常利益又は経常損失（△）                             | 93,968,087                        | 2,119,607                         |
| 当期純利益又は当期純損失（△）                           | 93,968,087                        | 2,119,607                         |
| 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（△） | 16,737,894                        | 8,048,747                         |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△）                           | 283,927,687                       | 570,217,776                       |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 274,032,087                       | 212,007,918                       |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 274,032,087                       | 212,007,918                       |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 64,972,191                        | 108,012,207                       |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 64,972,191                        | 108,012,207                       |
| 分配金                                       | -                                 | -                                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）                           | 570,217,776                       | 668,284,347                       |

## (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6期<br>[令和 4年 1月26日現在] | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在] |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 1. 期首元本額  | 1,402,186,464円         | 2,090,578,288円         |
| 期中追加設定元本額 | 989,014,237円           | 727,844,011円           |
| 期中一部解約元本額 | 300,622,413円           | 392,262,071円           |
| 2. 受益権の総数 | 2,090,578,288口         | 2,426,160,228口         |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第6期<br>自 令和 3年 1月27日<br>至 令和 4年 1月26日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 第7期<br>自 令和 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26日 |                |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|----------------|--|--------------|---|-------------|---------------------------|---|-------------|--------|---|--------------|----------|---|-------------|---------------|-----------|--------------|--------------|---|----------------|---------------|--------------|--------|------------|---|----|---------|--------------|----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|--|--|--------------|---|-------------|---------------------------|---|----|--------|---|--------------|----------|---|--------------|---------------|-----------|--------------|--------------|---|----------------|---------------|--------------|--------|------------|---|----|---------|--------------|----|
| 1. 分配金の計算過程                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 1. 分配金の計算過程                           |                |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| <table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>31,859,708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>45,370,485円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>393,727,879円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>99,259,704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>570,217,776円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>2,090,578,288口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>2,727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 | 31,859,708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 | 45,370,485円 | 収益調整金額 | C | 393,727,879円 | 分配準備積立金額 | D | 99,259,704円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 570,217,776円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 2,090,578,288口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 2,727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><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>39,664,336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>479,940,155円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>148,679,856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>668,284,347円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>2,426,160,228口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>2,754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 | 39,664,336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 | 479,940,155円 | 分配準備積立金額 | D | 148,679,856円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 668,284,347円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 2,426,160,228口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 2,754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                                     | 31,859,708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                                     | 45,370,485円    |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 収益調整金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | C                                     | 393,727,879円   |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | D                                     | 99,259,704円    |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | E=A+B+C+D                             | 570,217,776円   |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | F                                     | 2,090,578,288口 |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 1万口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | G=E/F*10,000                          | 2,727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                                     | 39,664,336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                                     | 479,940,155円   |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | D                                     | 148,679,856円   |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | E=A+B+C+D                             | 668,284,347円   |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | F                                     | 2,426,160,228口 |  |              |   |             |                           |   |             |        |   |              |          |   |             |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 1万口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | G=E/F*10,000                          | 2,754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6期<br>自 令和 3年 1月27日<br>至 令和 4年 1月26日                                                                                                                                                                    | 第7期<br>自 令和 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26日 |
|-------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|
| 1.金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。                                                                                                  | 同左                                    |
| 2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。                                                                                                                                | 同左                                    |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> | 同左                                    |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                  | 第6期<br>[令和 4年 1月26日現在]                                                                                                                                                                                              | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在]                                                                 |
|---------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                                              | 同左                                                                                     |
| 2.時価の算定方法           | <p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> | <p>(1) 有価証券</p> <p>同左</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>同左</p> |

| 区分                        | 第6期<br>[令和 4年 1月26日現在]                                           | 第7期<br>[令和 5年 1月26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6期<br>[令和 4年 1月26日現在]   | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在]   |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) |
| 親投資信託受益証券 | 91,907,048               | 4,006,216                |
| 合計        | 91,907,048               | 4,006,216                |

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （１口当たり情報）

|              | 第6期<br>[令和 4年 1月26日現在] | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在] |
|--------------|------------------------|------------------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.2728円                | 1.2754円                |
| (1万口当たり純資産額) | (12,728円)              | (12,754円)              |

## （４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表  
(1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種 類           | 銘 柄                | 口数            | 評価額           | 備考 |
|---------------|--------------------|---------------|---------------|----|
| 親投資信託受益<br>証券 | MUAM G－REITマザーファンド | 84,529,032    | 188,195,436   |    |
|               | 新興国株式インデックスマザーファンド | 39,939,426    | 124,007,923   |    |
|               | 東証REIT指数マザーファンド    | 35,670,793    | 121,990,544   |    |
|               | 新興国債券インデックスマザーファンド | 83,597,555    | 123,473,588   |    |
|               | TOPIXマザーファンド       | 176,065,172   | 412,221,387   |    |
|               | 外国株式インデックスマザーファンド  | 108,149,213   | 496,264,293   |    |
|               | 日本債券インデックスマザーファンド  | 889,967,040   | 1,138,712,827 |    |
|               | 外国債券インデックスマザーファンド  | 204,282,570   | 458,634,797   |    |
| 合計            |                    | 1,622,200,801 | 3,063,500,795 |    |

## 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。

## 【eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第6期<br>[ 令和 4年 1月26日現在 ] | 第7期<br>[ 令和 5年 1月26日現在 ] |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
| 資産の部            |                          |                          |
| 流動資産            |                          |                          |
| コール・ローン         | 70,253,832               | 110,651,746              |
| 親投資信託受益証券       | 6,812,822,825            | 8,747,016,469            |
| 未収入金            | 23,849,919               | 2,291,418                |
| 流動資産合計          | 6,906,926,576            | 8,859,959,633            |
| 資産合計            | 6,906,926,576            | 8,859,959,633            |
| 負債の部            |                          |                          |
| 流動負債            |                          |                          |
| 未払解約金           | 6,250,303                | 996,183                  |
| 未払受託者報酬         | 2,212,106                | 2,807,098                |
| 未払委託者報酬         | 16,222,085               | 20,585,295               |
| 未払利息            | 31                       | 49                       |
| その他未払費用         | 132,668                  | 168,357                  |
| 流動負債合計          | 24,817,193               | 24,556,982               |
| 負債合計            | 24,817,193               | 24,556,982               |
| 純資産の部           |                          |                          |
| 元本等             |                          |                          |
| 元本              | 4,952,941,331            | 6,250,452,127            |
| 剰余金             |                          |                          |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 1,929,168,052            | 2,584,950,524            |
| （分配準備積立金）       | 718,218,865              | 786,736,339              |
| 元本等合計           | 6,882,109,383            | 8,835,402,651            |
| 純資産合計           | 6,882,109,383            | 8,835,402,651            |
| 負債純資産合計         | 6,906,926,576            | 8,859,959,633            |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 第6期<br>自 令和3年1月27日<br>至 令和4年1月26日 | 第7期<br>自 令和4年1月27日<br>至 令和5年1月26日 |
|-------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 営業収益                                      |                                   |                                   |
| 受取利息                                      | 217                               | 407                               |
| 有価証券売買等損益                                 | 418,883,977                       | 162,727,127                       |
| 営業収益合計                                    | 418,884,194                       | 162,727,534                       |
| 営業費用                                      |                                   |                                   |
| 支払利息                                      | 14,737                            | 32,510                            |
| 受託者報酬                                     | 4,023,981                         | 5,247,446                         |
| 委託者報酬                                     | 29,509,089                        | 38,481,113                        |
| その他費用                                     | 241,321                           | 314,716                           |
| 営業費用合計                                    | 33,789,128                        | 44,075,785                        |
| 営業利益又は営業損失（△）                             | 385,095,066                       | 118,651,749                       |
| 経常利益又は経常損失（△）                             | 385,095,066                       | 118,651,749                       |
| 当期純利益又は当期純損失（△）                           | 385,095,066                       | 118,651,749                       |
| 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（△） | 69,034,559                        | 19,238,751                        |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△）                           | 1,086,856,276                     | 1,929,168,052                     |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 781,931,611                       | 781,523,282                       |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 781,931,611                       | 781,523,282                       |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 255,680,342                       | 225,153,808                       |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 255,680,342                       | 225,153,808                       |
| 分配金                                       | -                                 | -                                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）                           | 1,929,168,052                     | 2,584,950,524                     |



## (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6期<br>[令和 4年 1月26日現在] | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在] |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 1. 期首元本額  | 3,783,940,624円         | 4,952,941,331円         |
| 期中追加設定元本額 | 2,017,199,558円         | 1,870,039,961円         |
| 期中一部解約元本額 | 848,198,851円           | 572,529,165円           |
| 2. 受益権の総数 | 4,952,941,331口         | 6,250,452,127口         |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第6期<br>自 令和 3年 1月27日<br>至 令和 4年 1月26日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 第7期<br>自 令和 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26日 |                |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|----------------|--|--------------|---|--------------|---------------------------|---|--------------|--------|---|----------------|----------|---|--------------|---------------|-----------|----------------|--------------|---|----------------|---------------|--------------|--------|------------|---|----|---------|--------------|----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|--|--|--------------|---|--------------|---------------------------|---|----|--------|---|----------------|----------|---|--------------|---------------|-----------|----------------|--------------|---|----------------|---------------|--------------|--------|------------|---|----|---------|--------------|----|
| 1. 分配金の計算過程                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 1. 分配金の計算過程                           |                |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| <table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>108,657,454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>207,403,053円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>1,210,949,187円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>402,158,358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>1,929,168,052円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>4,952,941,331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>3,894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 | 108,657,454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 | 207,403,053円 | 収益調整金額 | C | 1,210,949,187円 | 分配準備積立金額 | D | 402,158,358円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 1,929,168,052円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 4,952,941,331口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 3,894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><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>138,389,682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>1,798,214,185円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>648,346,657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>2,584,950,524円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>6,250,452,127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>4,135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 | 138,389,682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 | 1,798,214,185円 | 分配準備積立金額 | D | 648,346,657円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 2,584,950,524円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 6,250,452,127口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 4,135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                                     | 108,657,454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                                     | 207,403,053円   |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 収益調整金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | C                                     | 1,210,949,187円 |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | D                                     | 402,158,358円   |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | E=A+B+C+D                             | 1,929,168,052円 |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | F                                     | 4,952,941,331口 |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 1万口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | G=E/F*10,000                          | 3,894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                                     | 138,389,682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                                     | 1,798,214,185円 |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | D                                     | 648,346,657円   |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | E=A+B+C+D                             | 2,584,950,524円 |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | F                                     | 6,250,452,127口 |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 1万口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | G=E/F*10,000                          | 4,135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6期<br>自 令和 3年 1月27日<br>至 令和 4年 1月26日                                                                                                                                                                    | 第7期<br>自 令和 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26日 |
|-------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|
| 1.金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。                                                                                                  | 同左                                    |
| 2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。                                                                                                                                | 同左                                    |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> | 同左                                    |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                  | 第6期<br>[令和 4年 1月26日現在]                                                                                                                                                                                              | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在]                                                                 |
|---------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                                              | 同左                                                                                     |
| 2.時価の算定方法           | <p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> | <p>(1) 有価証券</p> <p>同左</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>同左</p> |

| 区分                        | 第6期<br>[令和 4年 1月26日現在]                                           | 第7期<br>[令和 5年 1月26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6期<br>[令和 4年 1月26日現在]   | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在]   |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) |
| 親投資信託受益証券 | 366,236,462              | 128,584,601              |
| 合計        | 366,236,462              | 128,584,601              |

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

|              | 第6期<br>[令和 4年 1月26日現在] | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在] |
|--------------|------------------------|------------------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.3895円                | 1.4136円                |
| (1万口当たり純資産額) | (13,895円)              | (14,136円)              |

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種 類           | 銘 柄                | 口数            | 評価額           | 備考 |
|---------------|--------------------|---------------|---------------|----|
| 親投資信託受益<br>証券 | MUAM G－REITマザーファンド | 359,980,526   | 801,460,643   |    |
|               | 新興国株式インデックスマザーファンド | 227,986,038   | 707,873,849   |    |
|               | 東証REIT指数マザーファンド    | 151,177,661   | 517,012,482   |    |
|               | 新興国債券インデックスマザーファンド | 475,504,903   | 702,320,741   |    |
|               | TOPIXマザーファンド       | 613,715,062   | 1,436,891,074 |    |
|               | 外国株式インデックスマザーファンド  | 404,074,363   | 1,854,176,029 |    |
|               | 日本債券インデックスマザーファンド  | 1,860,091,771 | 2,379,987,420 |    |
|               | 外国債券インデックスマザーファンド  | 154,689,872   | 347,294,231   |    |
| 合計            |                    | 4,247,220,196 | 8,747,016,469 |    |

## 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。

## 【eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）】

## （１）【貸借対照表】

| (単位：円)          |                          |                          |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
|                 | 第6期<br>[ 令和 4年 1月26日現在 ] | 第7期<br>[ 令和 5年 1月26日現在 ] |
| 資産の部            |                          |                          |
| 流動資産            |                          |                          |
| コール・ローン         | 43,795,963               | 67,390,056               |
| 親投資信託受益証券       | 4,131,809,799            | 5,379,516,267            |
| 未収入金            | 14,564,970               | 1,734,050                |
| 流動資産合計          | 4,190,170,732            | 5,448,640,373            |
| 資産合計            | 4,190,170,732            | 5,448,640,373            |
| 負債の部            |                          |                          |
| 流動負債            |                          |                          |
| 未払解約金           | 4,932,890                | 237,002                  |
| 未払受託者報酬         | 1,333,931                | 1,728,033                |
| 未払委託者報酬         | 9,782,126                | 12,672,180               |
| 未払利息            | 19                       | 30                       |
| その他未払費用         | 79,973                   | 103,622                  |
| 流動負債合計          | 16,128,939               | 14,740,867               |
| 負債合計            | 16,128,939               | 14,740,867               |
| 純資産の部           |                          |                          |
| 元本等             |                          |                          |
| 元本              | 2,718,190,444            | 3,413,012,304            |
| 剰余金             |                          |                          |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 1,455,851,349            | 2,020,887,202            |
| （分配準備積立金）       | 535,743,037              | 609,667,829              |
| 元本等合計           | 4,174,041,793            | 5,433,899,506            |
| 純資産合計           | 4,174,041,793            | 5,433,899,506            |
| 負債純資産合計         | 4,190,170,732            | 5,448,640,373            |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 第6期<br>自 令和3年1月27日<br>至 令和4年1月26日 | 第7期<br>自 令和4年1月27日<br>至 令和5年1月26日 |
|-------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 営業収益                                      |                                   |                                   |
| 受取利息                                      | 136                               | 243                               |
| 有価証券売買等損益                                 | 310,288,477                       | 190,224,814                       |
| 営業収益合計                                    | 310,288,613                       | 190,225,057                       |
| 営業費用                                      |                                   |                                   |
| 支払利息                                      | 9,044                             | 21,186                            |
| 受託者報酬                                     | 2,380,730                         | 3,221,162                         |
| 委託者報酬                                     | 17,458,567                        | 23,621,689                        |
| その他費用                                     | 142,720                           | 193,146                           |
| 営業費用合計                                    | 19,991,061                        | 27,057,183                        |
| 営業利益又は営業損失（△）                             | 290,297,552                       | 163,167,874                       |
| 経常利益又は経常損失（△）                             | 290,297,552                       | 163,167,874                       |
| 当期純利益又は当期純損失（△）                           | 290,297,552                       | 163,167,874                       |
| 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（△） | 53,533,614                        | 21,929,237                        |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△）                           | 776,505,563                       | 1,455,851,349                     |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 630,108,718                       | 648,067,846                       |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 630,108,718                       | 648,067,846                       |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 187,526,870                       | 224,270,630                       |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 187,526,870                       | 224,270,630                       |
| 分配金                                       | -                                 | -                                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）                           | 1,455,851,349                     | 2,020,887,202                     |

## (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6期<br>[令和 4年 1月26日現在] | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在] |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 1. 期首元本額  | 2,003,209,894円         | 2,718,190,444円         |
| 期中追加設定元本額 | 1,171,870,790円         | 1,108,556,067円         |
| 期中一部解約元本額 | 456,890,240円           | 413,734,207円           |
| 2. 受益権の総数 | 2,718,190,444口         | 3,413,012,304口         |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第6期<br>自 令和 3年 1月27日<br>至 令和 4年 1月26日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 第7期<br>自 令和 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26日 |                |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |              |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |    |  |  |              |   |              |                           |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|----------------|--|--------------|---|-------------|---------------------------|---|--------------|--------|---|--------------|----------|---|--------------|---------------|-----------|----------------|--------------|---|----------------|---------------|--------------|--------|------------|---|----|---------|--------------|----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|--|--|--------------|---|--------------|---------------------------|---|-------------|--------|---|----------------|----------|---|--------------|---------------|-----------|----------------|--------------|---|----------------|---------------|--------------|--------|------------|---|----|---------|--------------|----|
| 1. 分配金の計算過程                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 1. 分配金の計算過程                           |                |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |              |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |    |  |  |              |   |              |                           |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| <table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>77,545,728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>159,218,210円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>920,108,312円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>298,979,099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>1,455,851,349円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>2,718,190,444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>5,355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 | 77,545,728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 | 159,218,210円 | 収益調整金額 | C | 920,108,312円 | 分配準備積立金額 | D | 298,979,099円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 1,455,851,349円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 2,718,190,444口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 5,355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><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>113,697,484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>27,541,153円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>1,411,219,373円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>468,429,192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>2,020,887,202円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>3,413,012,304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>5,921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 | 113,697,484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 | 27,541,153円 | 収益調整金額 | C | 1,411,219,373円 | 分配準備積立金額 | D | 468,429,192円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 2,020,887,202円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 3,413,012,304口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 5,921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                                     | 77,545,728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                                     | 159,218,210円   |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |              |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |    |  |  |              |   |              |                           |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 収益調整金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | C                                     | 920,108,312円   |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |              |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |    |  |  |              |   |              |                           |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | D                                     | 298,979,099円   |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |              |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |    |  |  |              |   |              |                           |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | E=A+B+C+D                             | 1,455,851,349円 |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |              |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |    |  |  |              |   |              |                           |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | F                                     | 2,718,190,444口 |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |              |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |    |  |  |              |   |              |                           |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 1万口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | G=E/F*10,000                          | 5,355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                                     | 113,697,484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                                     | 27,541,153円    |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |              |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |    |  |  |              |   |              |                           |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 収益調整金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | C                                     | 1,411,219,373円 |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |              |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |    |  |  |              |   |              |                           |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | D                                     | 468,429,192円   |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |              |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |    |  |  |              |   |              |                           |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | E=A+B+C+D                             | 2,020,887,202円 |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |              |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |    |  |  |              |   |              |                           |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | F                                     | 3,413,012,304口 |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |              |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |    |  |  |              |   |              |                           |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 1万口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | G=E/F*10,000                          | 5,921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6期<br>自 令和 3年 1月27日<br>至 令和 4年 1月26日                                                                                                                                                                    | 第7期<br>自 令和 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26日 |
|-------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|
| 1.金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。                                                                                                  | 同左                                    |
| 2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。                                                                                                                                | 同左                                    |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> | 同左                                    |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                  | 第6期<br>[令和 4年 1月26日現在]                                                                                                                                                                                              | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在]                                                                 |
|---------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                                              | 同左                                                                                     |
| 2.時価の算定方法           | <p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> | <p>(1) 有価証券</p> <p>同左</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>同左</p> |



| 区分                        | 第6期<br>[令和 4年 1月26日現在]                                           | 第7期<br>[令和 5年 1月26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6期<br>[令和 4年 1月26日現在]   | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在]   |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) |
| 親投資信託受益証券 | 293,043,758              | 171,720,247              |
| 合計        | 293,043,758              | 171,720,247              |

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

|              | 第6期<br>[令和 4年 1月26日現在] | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在] |
|--------------|------------------------|------------------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.5356円                | 1.5921円                |
| (1万口当たり純資産額) | (15,356円)              | (15,921円)              |

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種 類       | 銘 柄                | 口数            | 評価額           | 備考 |
|-----------|--------------------|---------------|---------------|----|
| 親投資信託受益証券 | MUAM G－REITマザーファンド | 295,592,388   | 658,106,892   |    |
|           | 新興国株式インデックスマザーファンド | 213,618,942   | 663,265,453   |    |
|           | 東証REIT指数マザーファンド    | 122,994,999   | 420,630,597   |    |
|           | 新興国債券インデックスマザーファンド | 365,022,368   | 539,138,037   |    |
|           | TOPIXマザーファンド       | 516,620,791   | 1,209,564,257 |    |
|           | 外国株式インデックスマザーファンド  | 318,094,960   | 1,459,642,342 |    |
|           | 日本債券インデックスマザーファンド  | 252,497,491   | 323,070,539   |    |
|           | 外国債券インデックスマザーファンド  | 47,257,650    | 106,098,150   |    |
| 合計        |                    | 2,131,699,589 | 5,379,516,267 |    |

## 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。

## 【eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）】

## （１）【貸借対照表】

| (単位：円)          |                          |                          |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
|                 | 第6期<br>[ 令和 4年 1月26日現在 ] | 第7期<br>[ 令和 5年 1月26日現在 ] |
| 資産の部            |                          |                          |
| 流動資産            |                          |                          |
| コール・ローン         | 60,737,012               | 103,456,798              |
| 親投資信託受益証券       | 6,513,312,793            | 8,249,041,604            |
| 未収入金            | 43,755,117               | 2,863,350                |
| 流動資産合計          | 6,617,804,922            | 8,355,361,752            |
| 資産合計            | 6,617,804,922            | 8,355,361,752            |
| 負債の部            |                          |                          |
| 流動負債            |                          |                          |
| 未払解約金           | 19,713,331               | 837,851                  |
| 未払受託者報酬         | 2,122,134                | 2,627,178                |
| 未払委託者報酬         | 15,562,233               | 19,265,930               |
| 未払利息            | 26                       | 46                       |
| その他未払費用         | 127,268                  | 157,570                  |
| 流動負債合計          | 37,524,992               | 22,888,575               |
| 負債合計            | 37,524,992               | 22,888,575               |
| 純資産の部           |                          |                          |
| 元本等             |                          |                          |
| 元本              | 3,928,586,643            | 4,760,733,943            |
| 剰余金             |                          |                          |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 2,651,693,287            | 3,571,739,234            |
| （分配準備積立金）       | 795,953,832              | 963,500,725              |
| 元本等合計           | 6,580,279,930            | 8,332,473,177            |
| 純資産合計           | 6,580,279,930            | 8,332,473,177            |
| 負債純資産合計         | 6,617,804,922            | 8,355,361,752            |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 第6期<br>自 令和3年1月27日<br>至 令和4年1月26日 | 第7期<br>自 令和4年1月27日<br>至 令和5年1月26日 |
|-------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 営業収益                                      |                                   |                                   |
| 受取利息                                      | 234                               | 353                               |
| 有価証券売買等損益                                 | 365,568,456                       | 363,528,578                       |
| 営業収益合計                                    | 365,568,690                       | 363,528,931                       |
| 営業費用                                      |                                   |                                   |
| 支払利息                                      | 14,836                            | 31,541                            |
| 受託者報酬                                     | 3,823,404                         | 4,937,490                         |
| 委託者報酬                                     | 28,038,178                        | 36,208,169                        |
| その他費用                                     | 229,284                           | 296,121                           |
| 営業費用合計                                    | 32,105,702                        | 41,473,321                        |
| 営業利益又は営業損失（△）                             | 333,462,988                       | 322,055,610                       |
| 経常利益又は経常損失（△）                             | 333,462,988                       | 322,055,610                       |
| 当期純利益又は当期純損失（△）                           | 333,462,988                       | 322,055,610                       |
| 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（△） | 102,519,123                       | 33,729,636                        |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△）                           | 1,605,629,021                     | 2,651,693,287                     |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 1,415,830,349                     | 1,116,579,462                     |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 1,415,830,349                     | 1,116,579,462                     |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 600,709,948                       | 484,859,489                       |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 600,709,948                       | 484,859,489                       |
| 分配金                                       | -                                 | -                                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）                           | 2,651,693,287                     | 3,571,739,234                     |

## (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6期<br>[令和 4年 1月26日現在] | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在] |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 1. 期首元本額  | 2,897,948,148円         | 3,928,586,643円         |
| 期中追加設定元本額 | 2,073,770,424円         | 1,544,412,998円         |
| 期中一部解約元本額 | 1,043,131,929円         | 712,265,698円           |
| 2. 受益権の総数 | 3,928,586,643口         | 4,760,733,943口         |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第6期<br>自 令和 3年 1月27日<br>至 令和 4年 1月26日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 第7期<br>自 令和 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26日 |                |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|----------------|--|--------------|---|-------------|---------------------------|---|--------------|--------|---|----------------|----------|---|--------------|---------------|-----------|----------------|--------------|---|----------------|---------------|--------------|--------|------------|---|----|---------|--------------|----|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|--|--|--------------|---|--------------|---------------------------|---|--------------|--------|---|----------------|----------|---|--------------|---------------|-----------|----------------|--------------|---|----------------|---------------|--------------|--------|------------|---|----|---------|--------------|----|
| 1. 分配金の計算過程                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 1. 分配金の計算過程                           |                |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| <table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>99,513,005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>131,430,860円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>1,855,739,455円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>565,009,967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>2,651,693,287円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>3,928,586,643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>6,749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 | 99,513,005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 | 131,430,860円 | 収益調整金額 | C | 1,855,739,455円 | 分配準備積立金額 | D | 565,009,967円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 2,651,693,287円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 3,928,586,643口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 6,749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><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>162,671,800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>125,654,174円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>2,608,238,509円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>675,174,751円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>3,571,739,234円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>4,760,733,943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>7,502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 | 162,671,800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 | 125,654,174円 | 収益調整金額 | C | 2,608,238,509円 | 分配準備積立金額 | D | 675,174,751円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 3,571,739,234円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 4,760,733,943口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 7,502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                                     | 99,513,005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                                     | 131,430,860円   |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 収益調整金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | C                                     | 1,855,739,455円 |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | D                                     | 565,009,967円   |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | E=A+B+C+D                             | 2,651,693,287円 |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | F                                     | 3,928,586,643口 |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 1万口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | G=E/F*10,000                          | 6,749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                                     | 162,671,800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                                     | 125,654,174円   |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 収益調整金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | C                                     | 2,608,238,509円 |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | D                                     | 675,174,751円   |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | E=A+B+C+D                             | 3,571,739,234円 |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | F                                     | 4,760,733,943口 |  |              |   |             |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 1万口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | G=E/F*10,000                          | 7,502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6期<br>自 令和 3年 1月27日<br>至 令和 4年 1月26日                                                                                                                                                                    | 第7期<br>自 令和 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26日 |
|-------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|
| 1.金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。                                                                                                  | 同左                                    |
| 2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。                                                                                                                                | 同左                                    |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> | 同左                                    |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                  | 第6期<br>[令和 4年 1月26日現在]                                                                                                                                                                                              | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在]                                                                 |
|---------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                                              | 同左                                                                                     |
| 2.時価の算定方法           | <p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> | <p>(1) 有価証券</p> <p>同左</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>同左</p> |

| 区分                        | 第6期<br>[令和 4年 1月26日現在]                                           | 第7期<br>[令和 5年 1月26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6期<br>[令和 4年 1月26日現在]   | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在]   |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) |
| 親投資信託受益証券 | 308,899,519              | 339,032,401              |
| 合計        | 308,899,519              | 339,032,401              |

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （１口当たり情報）

|              | 第6期<br>[令和 4年 1月26日現在] | 第7期<br>[令和 5年 1月26日現在] |
|--------------|------------------------|------------------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.6750円                | 1.7502円                |
| (1万口当たり純資産額) | (16,750円)              | (17,502円)              |

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種 類       | 銘 柄                | 口数            | 評価額           | 備考 |
|-----------|--------------------|---------------|---------------|----|
| 親投資信託受益証券 | MUAM G－REITマザーファンド | 112,696,490   | 250,907,465   |    |
|           | 新興国株式インデックスマザーファンド | 801,652,504   | 2,489,050,859 |    |
|           | 東証REIT指数マザーファンド    | 48,039,012    | 164,288,617   |    |
|           | 新興国債券インデックスマザーファンド | 111,616,987   | 164,858,289   |    |
|           | TOPIXマザーファンド       | 974,219,952   | 2,280,941,173 |    |
|           | 外国株式インデックスマザーファンド  | 613,914,007   | 2,817,067,203 |    |
|           | 日本債券インデックスマザーファンド  | 32,106,089    | 41,079,740    |    |
|           | 外国債券インデックスマザーファンド  | 18,194,405    | 40,848,258    |    |
| 合 計       |                    | 2,712,439,446 | 8,249,041,604 |    |

## 第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

## TOPIXマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

[令和 5年 1月26日現在]

|          |                 |
|----------|-----------------|
| 資産の部     |                 |
| 流動資産     |                 |
| コール・ローン  | 113,296,025,981 |
| 株式       | 849,205,825,410 |
| 派生商品評価勘定 | 379,518,450     |
| 未収入金     | 9,696,800       |
| 未収配当金    | 1,334,658,373   |
| 未収利息     | 2,172,190       |
| その他未収収益  | 70,463,627      |
| 差入委託証拠金  | 344,235,000     |
| 流動資産合計   | 964,642,595,831 |



| [令和 5年 1月26日現在] |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産合計            | 964,642,595,831 |
| 負債の部            |                 |
| 流動負債            |                 |
| 前受金             | 381,230,000     |
| 未払金             | 1,999,941,070   |
| 未払解約金           | 2,593,341,914   |
| 未払利息            | 50,936          |
| 受入担保金           | 102,126,530,385 |
| 流動負債合計          | 107,101,094,305 |
| 負債合計            | 107,101,094,305 |
| 純資産の部           |                 |
| 元本等             |                 |
| 元本              | 366,259,437,339 |
| 剰余金             |                 |
| 剰余金又は欠損金（△）     | 491,282,064,187 |
| 元本等合計           | 857,541,501,526 |
| 純資産合計           | 857,541,501,526 |
| 負債純資産合計         | 964,642,595,831 |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

|                             | [令和 5年 1月26日現在]  |
|-----------------------------|------------------|
| 1. 期首                       | 令和 4年 1月27日      |
| 期首元本額                       | 330,839,215,912円 |
| 期中追加設定元本額                   | 165,609,029,263円 |
| 期中一部解約元本額                   | 130,188,807,836円 |
| 元本の内訳※                      |                  |
| 三菱ＵＦＪ トピックスインデックスオープン       | 7,677,018,259円   |
| 三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）      | 970,679,223円     |
| 三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）    | 3,923,705,590円   |
| 三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）      | 3,553,465,268円   |
| 三菱ＵＦＪ トピックスオープン（確定拠出年金）     | 3,430,976,869円   |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金） | 7,571,053,032円   |

|                                  | [令和 5年 1月26日現在] |
|----------------------------------|-----------------|
| 三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）    | 39,140,369,877円 |
| 三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）      | 42,284,771,260円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）        | 109,006,640円    |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）           | 282,234,725円    |
| ファンド・マネジャー（国内株式）                 | 514,182,368円    |
| eMAXIS TOPIXインデックス               | 7,523,774,570円  |
| eMAXIS バランス（8資産均等型）              | 2,297,706,558円  |
| eMAXIS バランス（波乗り型）                | 121,082,159円    |
| 三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）      | 2,892,580,598円  |
| コアバランス                           | 223,948円        |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金） | 939,281,501円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金） | 1,034,816,867円  |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金） | 885,694,209円    |
| eMAXIS Slim 国内株式（TOPIX）          | 27,034,477,322円 |
| 国内株式セレクション（ラップ向け）                | 4,116,587,646円  |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）         | 9,504,845,019円  |
| つみたて日本株式（TOPIX）                  | 7,375,203,782円  |
| つみたて8資産均等バランス                    | 4,411,364,799円  |
| つみたて4資産均等バランス                    | 1,444,553,004円  |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s            | 2,727,797円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s            | 4,731,011円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s            | 6,979,773円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金） | 715,051,964円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金） | 773,111,936円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金） | 484,485,079円    |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式15）             | 465,306,997円    |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式40）             | 1,452,830,239円  |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式65）             | 2,637,861,404円  |
| eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）        | 927,891,848円    |
| 三菱UFJ DC年金インデックス（国内株式）           | 2,220,384,624円  |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金） | 415,044,077円    |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式25）             | 131,593,625円    |
| 国内株式インデックス・オープン（ラップ向け）           | 15,953,104,460円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金） | 156,608,866円    |
| ラップ向けインデックスf 国内株式                | 3,753,454,385円  |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）        | 133,719,099円    |

|                                       | [令和 5年 1月26日現在] |
|---------------------------------------|-----------------|
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）             | 1,052,120,711円  |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）             | 665,293,267円    |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式80）                  | 12,188,754円     |
| ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）              | 8,401,533,790円  |
| ラップ向けダイナミックアロケーションファンド                | 55,151,993円     |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド                 | 8,478,330円      |
| アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）               | 29,784,519円     |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）             | 340,755,526円    |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）             | 885,712,083円    |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）            | 156,522,862円    |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）        | 322,058,146円    |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）             | 295,521,756円    |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）                | 16,659,048円     |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）              | 118,869,032円    |
| eMAXIS バランス（4資産均等型）                   | 642,205,285円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）             | 145,655,526円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）             | 176,065,172円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）            | 613,715,062円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）               | 516,620,791円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）              | 974,219,952円    |
| 三菱UFJ トピックスオープン                       | 988,885,497円    |
| 三菱UFJ DCトピックスオープン                     | 8,068,462,633円  |
| 三菱UFJ トピックスオープンVA（適格機関投資家限定）          | 65,138,362円     |
| 三菱UFJ トピックスインデックスファンドVA（適格機関投資家限定）    | 5,501,817,610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） | 57,906円         |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）         | 10,156,035円     |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）         | 5,289,053,464円  |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）       | 106,735,789円    |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）       | 1,692,146,465円  |
| MUAM 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）        | 33,051,777,636円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）       | 258,761,057円    |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）         | 814,896円        |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）       | 1,219,235円      |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）         | 266,180,862円    |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）         | 492,772,208円    |
| MUAM インデックスファンドTOPIXi（適格機関投資家限定）      | 5,388,672,503円  |

|                                           | [令和 5年 1月26日現在] |
|-------------------------------------------|-----------------|
| 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）   | 969,198,637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）  | 319,301,360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）     | 608,379,349円    |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）                | 87,891,763円     |
| MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）         | 2,269,205,281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）   | 85,466,310円     |
| MUKAM 日本株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）          | 3,272,156,456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）       | 605,539,391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） | 30,023,621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）                | 226,820円        |
| 日米コアバランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）                | 180,742,562円    |
| 日本株式インデックスファンドS                           | 682,977,633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）   | 35,980,732円     |
| MUKAM 米国公債プラス日本株式ファンド2020-07（適格機関投資家限定）   | 117,460,290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）   | 35,434,968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）   | 35,501,352円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01（適格機関投資家限定）   | 35,160,631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）   | 35,822,253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）   | 35,950,680円     |
| MUKAM 日米コアバランス 2021-07（適格機関投資家限定）         | 484,279,297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）   | 34,885,307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）   | 34,844,004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）   | 35,768,349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）   | 35,818,860円     |
| MUKAM 日米コアバランス（除く米国株）2022-03（適格機関投資家限定）   | 957,860,739円    |

|                                                   | [令和 5年 1月26日現在]  |
|---------------------------------------------------|------------------|
| 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）           | 40,180,532円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05（適格機関投資家限定）           | 39,815,667円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07（適格機関投資家限定）           | 40,598,807円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09（適格機関投資家限定）           | 40,095,797円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11（適格機関投資家限定）           | 39,470,553円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01（適格機関投資家限定）           | 39,980,785円      |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンド                                  | 5,253,430,481円   |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA                        | 3,374,722円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA                      | 9,613,028円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA                        | 2,818,591円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA                        | 6,696,584円       |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1                               | 596,529,035円     |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンドVA                                | 114,183,723円     |
| 三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）                        | 4,713,178円       |
| 三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）                        | 41,142,146円      |
| 三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）                        | 3,372,067円       |
| 三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）                        | 31,336,846円      |
| 三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド                              | 1,609,337,795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）               | 402,509,838円     |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）             | 1,652,957,356円   |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）               | 1,526,681,905円   |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）               | 1,377,032,507円   |
| 三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド                            | 56,471,362,711円  |
| 合計                                                | 366,259,437,339円 |
| 2. 貸付有価証券<br>貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っております。<br>株式 | 97,584,394,340円  |
| 3. 受益権の総数                                         | 366,259,437,339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 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26日                                                                                                                                                                                                                                          |
|-------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。                                                                                                                                                                 |
| 2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。<br>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。<br>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。<br>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。                                                                           |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                        | [令和 5年 1月26日現在]                                                                                                                                                                                      |
|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                               |
| 2.時価の算定方法                 | （１）有価証券<br>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。<br>（２）デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。<br>（３）上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価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 5年 1月26日現在]    |
|----|--------------------|
|    | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 株式 | 6,946,242,333      |
| 合計 | 6,946,242,333      |

(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 5年 1月26日現在]

| 区分   | 種類             | 契約額等（円）       |       | 時価（円）         | 評価損益（円）     |
|------|----------------|---------------|-------|---------------|-------------|
|      |                |               | うち1年超 |               |             |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 7,962,365,000 | —     | 8,342,115,000 | 379,750,000 |
| 合計   |                | 7,962,365,000 | —     | 8,342,115,000 | 379,750,000 |

（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 5年 1月26日現在] |
|--------------|-----------------|
| 1口当たり純資産額    | 2.3413円         |
| (1万口当たり純資産額) | (23,413円)       |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

（単位：円）

|      | 銘 柄  | 株式数     | 評価額      |             | 備考                |
|------|------|---------|----------|-------------|-------------------|
|      |      |         | 単価       | 金額          |                   |
| 1301 | 極洋   | 15,800  | 3,805.00 | 60,119,000  | 貸付有価証券<br>3,500株  |
| 1332 | ニッサイ | 418,200 | 533.00   | 222,900,600 | 貸付有価証券<br>60,200株 |

|      |                     |           |          |               |                    |
|------|---------------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 1333 | マルハニチロ              | 62,100    | 2,438.00 | 151,399,800   | 貸付有価証券<br>8,700株   |
| 1375 | 雪国まいたけ              | 35,600    | 1,022.00 | 36,383,200    | 貸付有価証券<br>5,400株   |
| 1376 | カネコ種苗               | 13,800    | 1,601.00 | 22,093,800    | 貸付有価証券<br>2,500株   |
| 1377 | サカタのタネ              | 52,900    | 4,110.00 | 217,419,000   | 貸付有価証券<br>7,200株   |
| 1379 | ホクト                 | 37,200    | 1,880.00 | 69,936,000    | 貸付有価証券<br>6,300株   |
| 1384 | ホクリヨウ               | 3,900     | 808.00   | 3,151,200     | 貸付有価証券<br>1,100株   |
| 1514 | 住石ホールディングス          | 51,000    | 414.00   | 21,114,000    | 貸付有価証券<br>23,200株  |
| 1515 | 日鉄鉱業                | 16,800    | 3,615.00 | 60,732,000    | 貸付有価証券<br>4,600株   |
| 1518 | 三井松島ホールディングス        | 18,900    | 3,310.00 | 62,559,000    | 貸付有価証券<br>3,100株   |
| 1605 | I N P E X           | 1,546,700 | 1,476.00 | 2,282,929,200 | 貸付有価証券<br>382,300株 |
| 1662 | 石油資源開発              | 48,500    | 4,335.00 | 210,247,500   | 貸付有価証券<br>13,000株  |
| 1663 | K & O エナジーグループ      | 19,000    | 1,991.00 | 37,829,000    | 貸付有価証券<br>4,400株   |
| 1414 | ショーボンドホールディングス      | 57,000    | 5,450.00 | 310,650,000   | 貸付有価証券<br>11,800株  |
| 1417 | ミライト・ワン             | 145,000   | 1,575.00 | 228,375,000   | 貸付有価証券<br>26,100株  |
| 1419 | タマホーム               | 29,600    | 3,170.00 | 93,832,000    | 貸付有価証券<br>3,500株   |
| 1420 | サンヨーホームズ            | 3,300     | 718.00   | 2,369,400     | 貸付有価証券<br>900株     |
| 1429 | 日本アクア               | 11,600    | 888.00   | 10,300,800    | 貸付有価証券<br>3,600株   |
| 1430 | ファーストコーポレーション       | 7,100     | 711.00   | 5,048,100     | 貸付有価証券<br>2,300株   |
| 1433 | ベステラ                | 6,000     | 989.00   | 5,934,000     | 貸付有価証券<br>1,600株   |
| 1435 | R o b o t   H o m e | 71,200    | 167.00   | 11,890,400    | 貸付有価証券<br>13,200株  |
| 1446 | キャンディル              | 4,300     | 502.00   | 2,158,600     | 貸付有価証券<br>1,400株   |
| 1712 | ダイセキ環境ソリューション       | 5,600     | 1,034.00 | 5,790,400     | 貸付有価証券<br>600株     |
| 1716 | 第一カッター興業            | 10,700    | 1,050.00 | 11,235,000    | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 1719 | 安藤・間                | 242,300   | 860.00   | 208,378,000   | 貸付有価証券<br>35,900株  |
| 1720 | 東急建設                | 119,100   | 658.00   | 78,367,800    | 貸付有価証券<br>26,500株  |
| 1721 | コムシスホールディングス        | 141,500   | 2,418.00 | 342,147,000   | 貸付有価証券<br>21,300株  |



|      |                 |           |          |               |                    |
|------|-----------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 1726 | ビーアールホールディングス   | 66,400    | 338.00   | 22,443,200    | 貸付有価証券<br>7,700株   |
| 1762 | 高松コンストラクショングループ | 27,200    | 1,956.00 | 53,203,200    | 貸付有価証券<br>5,600株   |
| 1766 | 東建コーポレーション      | 13,500    | 7,860.00 | 106,110,000   | 貸付有価証券<br>2,900株   |
| 1768 | ソネック            | 3,000     | 957.00   | 2,871,000     | 貸付有価証券<br>900株     |
| 1780 | ヤマウラ            | 21,200    | 1,061.00 | 22,493,200    | 貸付有価証券<br>3,600株   |
| 1786 | オリエンタル白石        | 150,300   | 305.00   | 45,841,500    | 貸付有価証券<br>23,000株  |
| 1801 | 大成建設            | 291,200   | 4,465.00 | 1,300,208,000 | 貸付有価証券<br>46,400株  |
| 1802 | 大林組             | 1,046,200 | 995.00   | 1,040,969,000 | 貸付有価証券<br>245,300株 |
| 1803 | 清水建設            | 879,500   | 718.00   | 631,481,000   | 貸付有価証券<br>250,400株 |
| 1805 | 飛島建設            | 32,300    | 1,038.00 | 33,527,400    | 貸付有価証券<br>6,700株   |
| 1808 | 長谷工コーポレーション     | 302,000   | 1,492.00 | 450,584,000   | 貸付有価証券<br>54,200株  |
| 1810 | 松井建設            | 27,300    | 582.00   | 15,888,600    | 貸付有価証券<br>8,900株   |
| 1811 | 銭高組             | 2,500     | 2,734.00 | 6,835,000     | 貸付有価証券<br>900株     |
| 1812 | 鹿島建設            | 648,600   | 1,572.00 | 1,019,599,200 | 貸付有価証券<br>109,800株 |
| 1813 | 不動テトラ           | 20,200    | 1,528.00 | 30,865,600    | 貸付有価証券<br>4,400株   |
| 1814 | 大末建設            | 7,100     | 1,168.00 | 8,292,800     | 貸付有価証券<br>2,700株   |
| 1815 | 鉄建建設            | 21,000    | 1,834.00 | 38,514,000    | 貸付有価証券<br>4,300株   |
| 1820 | 西松建設            | 49,600    | 4,020.00 | 199,392,000   | 貸付有価証券<br>16,300株  |
| 1821 | 三井住友建設          | 235,900   | 418.00   | 98,606,200    | 貸付有価証券<br>41,600株  |
| 1822 | 大豊建設            | 12,100    | 3,565.00 | 43,136,500    | 貸付有価証券<br>3,500株   |
| 1826 | 佐田建設            | 14,500    | 478.00   | 6,931,000     | 貸付有価証券<br>4,300株   |
| 1827 | ナカノフドー建設        | 16,100    | 332.00   | 5,345,200     | 貸付有価証券<br>3,800株   |
| 1833 | 奥村組             | 47,400    | 2,994.00 | 141,915,600   | 貸付有価証券<br>10,300株  |
| 1835 | 東鉄工業            | 40,300    | 2,668.00 | 107,520,400   | 貸付有価証券<br>10,200株  |
| 1847 | イチケン            | 4,900     | 1,806.00 | 8,849,400     | 貸付有価証券<br>1,000株   |
| 1848 | 富士ピー・エス         | 8,700     | 449.00   | 3,906,300     | 貸付有価証券<br>2,800株   |

|      |               |         |          |               |                   |
|------|---------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 1852 | 浅沼組           | 23,400  | 3,200.00 | 74,880,000    | 貸付有価証券<br>4,200株  |
| 1860 | 戸田建設          | 359,900 | 698.00   | 251,210,200   | 貸付有価証券<br>79,600株 |
| 1861 | 熊谷組           | 50,700  | 2,646.00 | 134,152,200   | 貸付有価証券<br>6,500株  |
| 1866 | 北野建設          | 4,100   | 2,619.00 | 10,737,900    | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 1867 | 植木組           | 5,500   | 1,313.00 | 7,221,500     | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 1870 | 矢作建設工業        | 39,800  | 795.00   | 31,641,000    | 貸付有価証券<br>8,800株  |
| 1871 | ピーエス三菱        | 37,100  | 630.00   | 23,373,000    | 貸付有価証券<br>7,300株  |
| 1873 | 日本ハウスホールディングス | 58,000  | 384.00   | 22,272,000    | 貸付有価証券<br>13,700株 |
| 1879 | 新日本建設         | 41,100  | 787.00   | 32,345,700    | 貸付有価証券<br>9,600株  |
| 1882 | 東亜道路工業        | 5,800   | 6,080.00 | 35,264,000    | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 1884 | 日本道路          | 5,900   | 6,070.00 | 35,813,000    | 貸付有価証券<br>1,900株  |
| 1885 | 東亜建設工業        | 25,100  | 2,481.00 | 62,273,100    | 貸付有価証券<br>6,400株  |
| 1887 | 日本国土開発        | 87,700  | 543.00   | 47,621,100    | 貸付有価証券<br>12,300株 |
| 1888 | 若築建設          | 13,000  | 2,930.00 | 38,090,000    | 貸付有価証券<br>3,300株  |
| 1890 | 東洋建設          | 94,700  | 871.00   | 82,483,700    |                   |
| 1893 | 五洋建設          | 414,700 | 643.00   | 266,652,100   | 貸付有価証券<br>55,200株 |
| 1898 | 世紀東急工業        | 38,600  | 793.00   | 30,609,800    | 貸付有価証券<br>9,500株  |
| 1899 | 福田組           | 11,000  | 4,565.00 | 50,215,000    | 貸付有価証券<br>2,400株  |
| 1911 | 住友林業          | 224,400 | 2,405.00 | 539,682,000   | 貸付有価証券<br>58,000株 |
| 1914 | 日本基礎技術        | 16,500  | 528.00   | 8,712,000     | 貸付有価証券<br>6,800株  |
| 1921 | 巴コーポレーション     | 24,500  | 403.00   | 9,873,500     | 貸付有価証券<br>9,700株  |
| 1925 | 大和ハウス工業       | 817,500 | 3,116.00 | 2,547,330,000 |                   |
| 1926 | ライト工業         | 55,700  | 1,900.00 | 105,830,000   | 貸付有価証券<br>13,600株 |
| 1928 | 積水ハウス         | 916,400 | 2,507.00 | 2,297,414,800 |                   |
| 1929 | 日特建設          | 27,900  | 923.00   | 25,751,700    | 貸付有価証券<br>5,700株  |
| 1930 | 北陸電気工事        | 20,100  | 685.00   | 13,768,500    | 貸付有価証券<br>4,600株  |
| 1934 | ユアテック         | 64,400  | 752.00   | 48,428,800    | 貸付有価証券<br>12,100株 |

|      |            |         |          |             |                   |
|------|------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| 1938 | 日本リーテック    | 19,300  | 899.00   | 17,350,700  | 貸付有価証券<br>4,200株  |
| 1939 | 四電工        | 12,200  | 1,808.00 | 22,057,600  | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 1941 | 中電工        | 45,400  | 2,099.00 | 95,294,600  | 貸付有価証券<br>10,600株 |
| 1942 | 関電工        | 160,300 | 854.00   | 136,896,200 | 貸付有価証券<br>35,800株 |
| 1944 | きんでん       | 205,900 | 1,419.00 | 292,172,100 | 貸付有価証券<br>56,000株 |
| 1945 | 東京エネシス     | 29,100  | 947.00   | 27,557,700  | 貸付有価証券<br>8,200株  |
| 1946 | トーエネック     | 9,700   | 3,540.00 | 34,338,000  | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 1949 | 住友電設       | 27,800  | 2,328.00 | 64,718,400  | 貸付有価証券<br>6,200株  |
| 1950 | 日本電設工業     | 48,000  | 1,587.00 | 76,176,000  | 貸付有価証券<br>11,200株 |
| 1951 | エクシオグループ   | 134,700 | 2,326.00 | 313,312,200 | 貸付有価証券<br>21,000株 |
| 1952 | 新日本空調      | 16,300  | 1,919.00 | 31,279,700  | 貸付有価証券<br>6,500株  |
| 1959 | 九電工        | 71,100  | 3,330.00 | 236,763,000 | 貸付有価証券<br>15,700株 |
| 1961 | 三機工業       | 64,900  | 1,542.00 | 100,075,800 | 貸付有価証券<br>14,900株 |
| 1963 | 日揮ホールディングス | 289,300 | 1,711.00 | 494,992,300 | 貸付有価証券<br>42,700株 |
| 1964 | 中外炉工業      | 9,600   | 1,715.00 | 16,464,000  | 貸付有価証券<br>2,400株  |
| 1967 | ヤマト        | 16,100  | 731.00   | 11,769,100  | 貸付有価証券<br>6,900株  |
| 1968 | 太平電業       | 18,200  | 3,335.00 | 60,697,000  | 貸付有価証券<br>5,400株  |
| 1969 | 高砂熱学工業     | 70,500  | 1,827.00 | 128,803,500 | 貸付有価証券<br>18,400株 |
| 1972 | 三晃金属工業     | 2,700   | 3,405.00 | 9,193,500   | 貸付有価証券<br>900株    |
| 1975 | 朝日工業社      | 12,100  | 2,054.00 | 24,853,400  | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 1976 | 明星工業       | 50,300  | 826.00   | 41,547,800  | 貸付有価証券<br>12,900株 |
| 1979 | 大気社        | 35,200  | 3,485.00 | 122,672,000 | 貸付有価証券<br>11,200株 |
| 1980 | ダイダン       | 19,200  | 2,188.00 | 42,009,600  | 貸付有価証券<br>5,400株  |
| 1982 | 日比谷総合設備    | 25,100  | 1,976.00 | 49,597,600  | 貸付有価証券<br>5,100株  |
| 3267 | フィル・カンパニー  | 5,200   | 1,067.00 | 5,548,400   | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 5074 | テスホールディングス | 31,500  | 1,129.00 | 35,563,500  | 貸付有価証券<br>3,800株  |

|      |                 |         |          |             |                    |
|------|-----------------|---------|----------|-------------|--------------------|
| 5076 | インフロニア・ホールディングス | 306,600 | 1,029.00 | 315,491,400 | 貸付有価証券<br>102,600株 |
| 6330 | 東洋エンジニアリング      | 38,700  | 616.00   | 23,839,200  | 貸付有価証券<br>5,800株   |
| 6379 | レイズネクスト         | 42,300  | 1,314.00 | 55,582,200  | 貸付有価証券<br>12,500株  |
| 2001 | ニッポン            | 79,100  | 1,599.00 | 126,480,900 | 貸付有価証券<br>22,700株  |
| 2002 | 日清製粉グループ本社      | 271,600 | 1,609.00 | 437,004,400 | 貸付有価証券<br>50,200株  |
| 2003 | 日東富士製粉          | 5,200   | 4,365.00 | 22,698,000  | 貸付有価証券<br>1,000株   |
| 2004 | 昭和産業            | 25,600  | 2,483.00 | 63,564,800  | 貸付有価証券<br>6,500株   |
| 2009 | 鳥越製粉            | 15,600  | 594.00   | 9,266,400   | 貸付有価証券<br>6,100株   |
| 2053 | 中部飼料            | 40,700  | 1,035.00 | 42,124,500  | 貸付有価証券<br>8,500株   |
| 2060 | フィード・ワン         | 42,900  | 693.00   | 29,729,700  | 貸付有価証券<br>8,800株   |
| 2107 | 東洋精糖            | 3,700   | 873.00   | 3,230,100   | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 2108 | 日本甜菜製糖          | 17,100  | 1,649.00 | 28,197,900  | 貸付有価証券<br>3,900株   |
| 2109 | DM三井製糖ホールディングス  | 29,100  | 1,996.00 | 58,083,600  | 貸付有価証券<br>6,500株   |
| 2112 | 塩水港精糖           | 25,700  | 193.00   | 4,960,100   | 貸付有価証券<br>5,400株   |
| 2117 | ウェルネオシュガー       | 15,200  | 1,650.00 | 25,080,000  | 貸付有価証券<br>3,000株   |
| 2201 | 森永製菓            | 54,400  | 3,735.00 | 203,184,000 | 貸付有価証券<br>17,300株  |
| 2204 | 中村屋             | 7,300   | 3,075.00 | 22,447,500  | 貸付有価証券<br>1,800株   |
| 2206 | 江崎グリコ           | 84,000  | 3,540.00 | 297,360,000 | 貸付有価証券<br>19,700株  |
| 2207 | 名糖産業            | 11,600  | 1,673.00 | 19,406,800  | 貸付有価証券<br>3,400株   |
| 2209 | 井村屋グループ         | 16,100  | 2,250.00 | 36,225,000  | 貸付有価証券<br>3,100株   |
| 2211 | 不二家             | 20,100  | 2,492.00 | 50,089,200  | 貸付有価証券<br>3,800株   |
| 2212 | 山崎製パン           | 196,600 | 1,503.00 | 295,489,800 | 貸付有価証券<br>59,300株  |
| 2215 | 第一屋製パン          | 3,700   | 380.00   | 1,406,000   | 貸付有価証券<br>1,100株   |
| 2217 | モロゾフ            | 9,500   | 3,410.00 | 32,395,000  | 貸付有価証券<br>800株     |
| 2220 | 亀田製菓            | 18,700  | 4,305.00 | 80,503,500  | 貸付有価証券<br>4,500株   |
| 2222 | 寿スピリッツ          | 31,200  | 8,180.00 | 255,216,000 | 貸付有価証券<br>5,800株   |

|      |                          |           |          |               |                    |
|------|--------------------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 2229 | カルビー                     | 134,400   | 2,925.00 | 393,120,000   | 貸付有価証券<br>30,300株  |
| 2264 | 森永乳業                     | 53,400    | 4,735.00 | 252,849,000   | 貸付有価証券<br>13,400株  |
| 2266 | 六甲バター                    | 21,500    | 1,310.00 | 28,165,000    | 貸付有価証券<br>3,900株   |
| 2267 | ヤクルト本社                   | 209,900   | 9,400.00 | 1,973,060,000 | 貸付有価証券<br>19,900株  |
| 2269 | 明治ホールディングス               | 182,000   | 6,640.00 | 1,208,480,000 | 貸付有価証券<br>50,400株  |
| 2270 | 雪印メグミルク                  | 71,000    | 1,756.00 | 124,676,000   | 貸付有価証券<br>10,700株  |
| 2281 | プリマハム                    | 39,400    | 2,134.00 | 84,079,600    | 貸付有価証券<br>10,500株  |
| 2282 | 日本ハム                     | 114,800   | 3,775.00 | 433,370,000   | 貸付有価証券<br>21,600株  |
| 2286 | 林兼産業                     | 6,500     | 467.00   | 3,035,500     | 貸付有価証券<br>1,500株   |
| 2288 | 丸大食品                     | 29,600    | 1,448.00 | 42,860,800    | 貸付有価証券<br>4,800株   |
| 2292 | S Foods                  | 32,400    | 2,876.00 | 93,182,400    | 貸付有価証券<br>1,900株   |
| 2294 | 柿安本店                     | 11,500    | 2,017.00 | 23,195,500    | 貸付有価証券<br>2,200株   |
| 2296 | 伊藤ハム米久ホールディングス           | 228,300   | 704.00   | 160,723,200   | 貸付有価証券<br>39,000株  |
| 2501 | サッポロホールディングス             | 96,700    | 3,120.00 | 301,704,000   | 貸付有価証券<br>26,800株  |
| 2502 | アサヒグループホールディングス          | 678,600   | 4,285.00 | 2,907,801,000 |                    |
| 2503 | キリンホールディングス              | 1,325,300 | 1,997.00 | 2,646,624,100 | 貸付有価証券<br>142,900株 |
| 2531 | 宝ホールディングス                | 200,500   | 1,051.00 | 210,725,500   | 貸付有価証券<br>53,500株  |
| 2533 | オエノンホールディングス             | 87,800    | 257.00   | 22,564,600    | 貸付有価証券<br>19,700株  |
| 2540 | 養命酒製造                    | 9,700     | 1,812.00 | 17,576,400    | 貸付有価証券<br>2,600株   |
| 2579 | コカ・コーラ ボトラーズジャパン<br>ホールデ | 230,100   | 1,352.00 | 311,095,200   | 貸付有価証券<br>31,200株  |
| 2587 | サントリー食品インターナショナル         | 206,800   | 4,345.00 | 898,546,000   | 貸付有価証券<br>45,800株  |
| 2590 | ダイドーグループホールディングス         | 16,600    | 4,700.00 | 78,020,000    | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 2593 | 伊藤園                      | 109,500   | 4,455.00 | 487,822,500   | 貸付有価証券<br>18,000株  |
| 2594 | キーコーヒー                   | 32,900    | 2,082.00 | 68,497,800    | 貸付有価証券<br>6,200株   |
| 2597 | ユニカフェ                    | 6,500     | 899.00   | 5,843,500     | 貸付有価証券<br>1,600株   |
| 2599 | ジャパンフーズ                  | 3,100     | 1,080.00 | 3,348,000     | 貸付有価証券<br>900株     |

|      |                   |           |           |               |                    |
|------|-------------------|-----------|-----------|---------------|--------------------|
| 2602 | 日清オイリオグループ        | 41,400    | 3,130.00  | 129,582,000   | 貸付有価証券<br>8,000株   |
| 2607 | 不二製油グループ本社        | 68,400    | 2,033.00  | 139,057,200   | 貸付有価証券<br>17,100株  |
| 2612 | かどや製油             | 1,900     | 3,510.00  | 6,669,000     | 貸付有価証券<br>500株     |
| 2613 | J-オイルミルズ          | 29,900    | 1,555.00  | 46,494,500    | 貸付有価証券<br>1,600株   |
| 2801 | キッコーマン            | 194,600   | 6,850.00  | 1,333,010,000 | 貸付有価証券<br>31,800株  |
| 2802 | 味の素               | 718,800   | 4,274.00  | 3,072,151,200 | 貸付有価証券<br>99,700株  |
| 2804 | ブルドックソース          | 11,700    | 1,857.00  | 21,726,900    | 貸付有価証券<br>3,100株   |
| 2809 | キューピー             | 157,800   | 2,238.00  | 353,156,400   | 貸付有価証券<br>15,000株  |
| 2810 | ハウス食品グループ本社       | 89,900    | 2,732.00  | 245,606,800   | 貸付有価証券<br>24,500株  |
| 2811 | カゴメ               | 136,800   | 3,070.00  | 419,976,000   | 貸付有価証券<br>28,200株  |
| 2812 | 焼津水産化学工業          | 8,700     | 806.00    | 7,012,200     | 貸付有価証券<br>3,400株   |
| 2815 | アリアケジャパン          | 25,600    | 4,270.00  | 109,312,000   | 貸付有価証券<br>6,200株   |
| 2818 | ピエトロ              | 2,800     | 1,818.00  | 5,090,400     | 貸付有価証券<br>800株     |
| 2819 | エバラ食品工業           | 7,900     | 3,075.00  | 24,292,500    | 貸付有価証券<br>1,500株   |
| 2820 | やまみ               | 1,900     | 1,350.00  | 2,565,000     | 貸付有価証券<br>400株     |
| 2871 | ニチレイ              | 134,600   | 2,691.00  | 362,208,600   | 貸付有価証券<br>32,500株  |
| 2875 | 東洋水産              | 148,400   | 5,180.00  | 768,712,000   | 貸付有価証券<br>22,800株  |
| 2882 | イトアンドホールディングス     | 12,500    | 2,326.00  | 29,075,000    | 貸付有価証券<br>400株     |
| 2883 | 大冷                | 2,400     | 1,904.00  | 4,569,600     | 貸付有価証券<br>800株     |
| 2884 | ヨシムラ・フード・ホールディングス | 18,600    | 849.00    | 15,791,400    | 貸付有価証券<br>3,000株   |
| 2897 | 日清食品ホールディングス      | 103,300   | 10,100.00 | 1,043,330,000 | 貸付有価証券<br>24,500株  |
| 2899 | 永谷園ホールディングス       | 14,400    | 2,026.00  | 29,174,400    | 貸付有価証券<br>3,700株   |
| 2904 | 一正蒲鉾              | 8,300     | 706.00    | 5,859,800     | 貸付有価証券<br>2,500株   |
| 2908 | フジッコ              | 30,200    | 1,887.00  | 56,987,400    | 貸付有価証券<br>8,000株   |
| 2910 | ロック・フィールド         | 35,900    | 1,557.00  | 55,896,300    | 貸付有価証券<br>7,700株   |
| 2914 | 日本たばこ産業           | 1,933,400 | 2,676.50  | 5,174,745,100 | 貸付有価証券<br>123,300株 |

|      |                |           |          |               |                    |
|------|----------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 2915 | ケンコーマヨネーズ      | 20,200    | 1,371.00 | 27,694,200    | 貸付有価証券<br>3,800株   |
| 2918 | わらべや日洋ホールディングス | 21,600    | 1,900.00 | 41,040,000    | 貸付有価証券<br>1,800株   |
| 2922 | なとり            | 18,400    | 2,068.00 | 38,051,200    | 貸付有価証券<br>4,100株   |
| 2924 | イフジ産業          | 3,700     | 917.00   | 3,392,900     | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 2929 | ファーマフーズ        | 45,400    | 1,319.00 | 59,882,600    | 貸付有価証券<br>6,500株   |
| 2931 | ユーグレナ          | 189,100   | 995.00   | 188,154,500   | 貸付有価証券<br>28,400株  |
| 2933 | 紀文食品           | 22,900    | 954.00   | 21,846,600    | 貸付有価証券<br>4,000株   |
| 2935 | ピククルスホールディングス  | 17,200    | 1,202.00 | 20,674,400    | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 4404 | ミヨシ油脂          | 6,900     | 926.00   | 6,389,400     | 貸付有価証券<br>2,300株   |
| 4526 | 理研ビタミン         | 25,400    | 1,876.00 | 47,650,400    | 貸付有価証券<br>4,300株   |
| 3001 | 片倉工業           | 27,500    | 1,738.00 | 47,795,000    | 貸付有価証券<br>1,700株   |
| 3002 | グンゼ            | 22,400    | 4,180.00 | 93,632,000    | 貸付有価証券<br>4,900株   |
| 3101 | 東洋紡            | 129,100   | 1,018.00 | 131,423,800   | 貸付有価証券<br>24,200株  |
| 3103 | ユニチカ           | 90,200    | 244.00   | 22,008,800    | 貸付有価証券<br>20,300株  |
| 3104 | 富士紡ホールディングス    | 11,800    | 3,295.00 | 38,881,000    | 貸付有価証券<br>3,000株   |
| 3106 | 倉敷紡績           | 22,300    | 2,204.00 | 49,149,200    | 貸付有価証券<br>7,400株   |
| 3109 | シキボウ           | 11,000    | 965.00   | 10,615,000    | 貸付有価証券<br>4,300株   |
| 3201 | 日本毛織           | 78,800    | 958.00   | 75,490,400    | 貸付有価証券<br>9,500株   |
| 3202 | ダイトウボウ         | 34,200    | 83.00    | 2,838,600     | 貸付有価証券<br>10,200株  |
| 3204 | トーア紡コーポレーション   | 7,700     | 350.00   | 2,695,000     | 貸付有価証券<br>2,800株   |
| 3205 | ダイドーリミテッド      | 30,100    | 247.00   | 7,434,700     | 貸付有価証券<br>7,100株   |
| 3302 | 帝国繊維           | 33,700    | 1,531.00 | 51,594,700    | 貸付有価証券<br>7,600株   |
| 3401 | 帝人             | 287,000   | 1,304.00 | 374,248,000   | 貸付有価証券<br>35,300株  |
| 3402 | 東レ             | 2,001,700 | 787.90   | 1,577,139,430 | 貸付有価証券<br>423,500株 |
| 3501 | 住江織物           | 3,600     | 1,851.00 | 6,663,600     | 貸付有価証券<br>1,700株   |
| 3512 | 日本フェルト         | 11,900    | 410.00   | 4,879,000     | 貸付有価証券<br>3,500株   |

|      |                |           |          |             |                    |
|------|----------------|-----------|----------|-------------|--------------------|
| 3513 | イチカワ           | 2,500     | 1,325.00 | 3,312,500   | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 3524 | 日東製網           | 2,300     | 1,515.00 | 3,484,500   | 貸付有価証券<br>700株     |
| 3529 | アツギ            | 15,000    | 389.00   | 5,835,000   | 貸付有価証券<br>5,200株   |
| 3551 | ダイニック          | 6,800     | 642.00   | 4,365,600   | 貸付有価証券<br>1,600株   |
| 3569 | セーレン           | 57,700    | 2,319.00 | 133,806,300 | 貸付有価証券<br>10,600株  |
| 3571 | ソトー            | 7,700     | 809.00   | 6,229,300   | 貸付有価証券<br>1,700株   |
| 3577 | 東海染工           | 2,400     | 1,120.00 | 2,688,000   | 貸付有価証券<br>500株     |
| 3580 | 小松マテーレ         | 43,300    | 758.00   | 32,821,400  | 貸付有価証券<br>9,800株   |
| 3591 | ワコールホールディングス   | 57,600    | 2,402.00 | 138,355,200 | 貸付有価証券<br>11,400株  |
| 3593 | ホギメディカル        | 40,100    | 3,555.00 | 142,555,500 | 貸付有価証券<br>2,200株   |
| 3607 | クラウドシアホールディングス | 4,500     | 377.00   | 1,696,500   | 貸付有価証券<br>1,500株   |
| 3608 | T S I ホールディングス | 106,800   | 512.00   | 54,681,600  | 貸付有価証券<br>8,700株   |
| 3611 | マツオカコーポレーション   | 6,100     | 1,146.00 | 6,990,600   | 貸付有価証券<br>2,000株   |
| 3612 | ワールド           | 38,400    | 1,310.00 | 50,304,000  | 貸付有価証券<br>8,400株   |
| 8011 | 三陽商会           | 9,300     | 1,336.00 | 12,424,800  | 貸付有価証券<br>3,200株   |
| 8013 | ナイガイ           | 7,100     | 260.00   | 1,846,000   | 貸付有価証券<br>2,800株   |
| 8016 | オンワードホールディングス  | 193,800   | 325.00   | 62,985,000  | 貸付有価証券<br>32,100株  |
| 8029 | ルックホールディングス    | 5,700     | 2,499.00 | 14,244,300  | 貸付有価証券<br>1,800株   |
| 8107 | キムラタン          | 120,700   | 22.00    | 2,655,400   | 貸付有価証券<br>33,000株  |
| 8111 | ゴールドウイン        | 52,900    | 9,700.00 | 513,130,000 | 貸付有価証券<br>2,000株   |
| 8114 | デサント           | 51,500    | 3,195.00 | 164,542,500 | 貸付有価証券<br>14,800株  |
| 8118 | キング            | 9,900     | 497.00   | 4,920,300   | 貸付有価証券<br>2,100株   |
| 8127 | ヤマトインターナショナル   | 15,600    | 249.00   | 3,884,400   | 貸付有価証券<br>4,900株   |
| 3708 | 特種東海製紙         | 13,400    | 2,856.00 | 38,270,400  | 貸付有価証券<br>2,800株   |
| 3861 | 王子ホールディングス     | 1,244,600 | 532.00   | 662,127,200 | 貸付有価証券<br>327,900株 |
| 3863 | 日本製紙           | 155,600   | 937.00   | 145,797,200 | 貸付有価証券<br>38,500株  |



|      |                |           |          |               |                    |
|------|----------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 3864 | 三菱製紙           | 26,900    | 282.00   | 7,585,800     | 貸付有価証券<br>5,000株   |
| 3865 | 北越コーポレーション     | 188,800   | 824.00   | 155,571,200   | 貸付有価証券<br>48,500株  |
| 3877 | 中越パルプ工業        | 8,000     | 1,009.00 | 8,072,000     | 貸付有価証券<br>2,600株   |
| 3878 | 巴川製紙所          | 6,200     | 707.00   | 4,383,400     | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 3880 | 大王製紙           | 132,000   | 999.00   | 131,868,000   | 貸付有価証券<br>19,100株  |
| 3896 | 阿波製紙           | 4,700     | 823.00   | 3,868,100     | 貸付有価証券<br>1,500株   |
| 3941 | レンゴー           | 272,100   | 902.00   | 245,434,200   | 貸付有価証券<br>66,700株  |
| 3946 | トーモク           | 17,300    | 1,669.00 | 28,873,700    | 貸付有価証券<br>4,200株   |
| 3950 | ザ・パックス         | 22,200    | 2,495.00 | 55,389,000    | 貸付有価証券<br>3,300株   |
| 2930 | 北の達人コーポレーション   | 125,900   | 305.00   | 38,399,500    | 貸付有価証券<br>4,800株   |
| 3405 | クラレ            | 475,000   | 1,063.00 | 504,925,000   | 貸付有価証券<br>99,500株  |
| 3407 | 旭化成            | 1,865,800 | 960.00   | 1,791,168,000 | 貸付有価証券<br>413,100株 |
| 3553 | 共和レザー          | 11,400    | 511.00   | 5,825,400     | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 4004 | レゾナック・ホールディングス | 288,700   | 2,225.00 | 642,357,500   | 貸付有価証券<br>48,000株  |
| 4005 | 住友化学           | 2,216,400 | 494.00   | 1,094,901,600 | 貸付有価証券<br>319,600株 |
| 4008 | 住友精化           | 12,500    | 4,100.00 | 51,250,000    | 貸付有価証券<br>3,100株   |
| 4021 | 日産化学           | 141,800   | 6,030.00 | 855,054,000   | 貸付有価証券<br>24,300株  |
| 4022 | ラサ工業           | 11,500    | 1,946.00 | 22,379,000    | 貸付有価証券<br>1,500株   |
| 4023 | クレハ            | 25,500    | 8,480.00 | 216,240,000   | 貸付有価証券<br>5,800株   |
| 4025 | 多木化学           | 11,600    | 4,580.00 | 53,128,000    | 貸付有価証券<br>1,700株   |
| 4027 | テイカ            | 20,100    | 1,207.00 | 24,260,700    | 貸付有価証券<br>5,300株   |
| 4028 | 石原産業           | 54,100    | 1,101.00 | 59,564,100    | 貸付有価証券<br>7,800株   |
| 4031 | 片倉コブアグリ        | 4,700     | 1,723.00 | 8,098,100     | 貸付有価証券<br>1,800株   |
| 4041 | 日本曹達           | 32,100    | 4,125.00 | 132,412,500   | 貸付有価証券<br>8,200株   |
| 4042 | 東ソー            | 398,900   | 1,654.00 | 659,780,600   | 貸付有価証券<br>67,000株  |
| 4043 | トクヤマ           | 96,500    | 1,870.00 | 180,455,000   | 貸付有価証券<br>12,500株  |

|      |              |         |           |               |                   |
|------|--------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| 4044 | セントラル硝子      | 47,900  | 2,850.00  | 136,515,000   | 貸付有価証券<br>11,900株 |
| 4045 | 東亜合成         | 153,600 | 1,175.00  | 180,480,000   | 貸付有価証券<br>29,200株 |
| 4046 | 大阪ソーダ        | 17,900  | 4,210.00  | 75,359,000    | 貸付有価証券<br>4,400株  |
| 4047 | 関東電化工業       | 57,800  | 979.00    | 56,586,200    | 貸付有価証券<br>10,300株 |
| 4061 | デンカ          | 108,700 | 2,663.00  | 289,468,100   | 貸付有価証券<br>15,900株 |
| 4063 | 信越化学工業       | 504,200 | 17,585.00 | 8,866,357,000 | 貸付有価証券<br>98,900株 |
| 4064 | 日本カーバイド工業    | 7,500   | 1,308.00  | 9,810,000     | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| 4078 | 堺化学工業        | 22,800  | 1,813.00  | 41,336,400    | 貸付有価証券<br>3,100株  |
| 4082 | 第一稀元素化学工業    | 27,200  | 1,083.00  | 29,457,600    | 貸付有価証券<br>6,600株  |
| 4088 | エア・ウォーター     | 281,900 | 1,560.00  | 439,764,000   | 貸付有価証券<br>36,900株 |
| 4091 | 日本酸素ホールディングス | 289,800 | 2,104.00  | 609,739,200   | 貸付有価証券<br>56,600株 |
| 4092 | 日本化学工業       | 10,000  | 1,881.00  | 18,810,000    | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 4093 | 東邦アセチレン      | 4,200   | 1,134.00  | 4,762,800     | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 4095 | 日本パーカライジング   | 147,900 | 945.00    | 139,765,500   | 貸付有価証券<br>21,900株 |
| 4097 | 高圧ガス工業       | 43,400  | 663.00    | 28,774,200    | 貸付有価証券<br>6,900株  |
| 4098 | チタン工業        | 2,400   | 1,503.00  | 3,607,200     | 貸付有価証券<br>600株    |
| 4099 | 四国化成ホールディングス | 35,500  | 1,351.00  | 47,960,500    | 貸付有価証券<br>9,900株  |
| 4100 | 戸田工業         | 6,800   | 2,542.00  | 17,285,600    | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 4109 | ステラ ケミファ     | 17,700  | 2,571.00  | 45,506,700    | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 4112 | 保土谷化学工業      | 8,400   | 3,370.00  | 28,308,000    | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 4114 | 日本触媒         | 45,500  | 5,490.00  | 249,795,000   | 貸付有価証券<br>11,600株 |
| 4116 | 大日精化工業       | 20,800  | 1,771.00  | 36,836,800    | 貸付有価証券<br>5,900株  |
| 4118 | カネカ          | 68,300  | 3,375.00  | 230,512,500   | 貸付有価証券<br>11,200株 |
| 4182 | 三菱瓦斯化学       | 223,100 | 1,864.00  | 415,858,400   | 貸付有価証券<br>41,100株 |
| 4183 | 三井化学         | 251,200 | 3,050.00  | 766,160,000   | 貸付有価証券<br>64,700株 |
| 4185 | J S R        | 278,900 | 2,945.00  | 821,360,500   | 貸付有価証券<br>66,400株 |

|      |            |           |          |               |                    |
|------|------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 4186 | 東京応化工業     | 52,300    | 6,450.00 | 337,335,000   | 貸付有価証券<br>7,400株   |
| 4187 | 大阪有機化学工業   | 22,500    | 2,113.00 | 47,542,500    | 貸付有価証券<br>6,600株   |
| 4188 | 三菱ケミカルグループ | 2,016,200 | 734.70   | 1,481,302,140 | 貸付有価証券<br>289,900株 |
| 4189 | KHネオケム     | 49,700    | 2,759.00 | 137,122,300   | 貸付有価証券<br>10,600株  |
| 4202 | ダイセル       | 439,300   | 949.00   | 416,895,700   | 貸付有価証券<br>59,500株  |
| 4203 | 住友ベークライト   | 44,300    | 4,250.00 | 188,275,000   | 貸付有価証券<br>9,200株   |
| 4204 | 積水化学工業     | 611,000   | 1,930.00 | 1,179,230,000 | 貸付有価証券<br>93,200株  |
| 4205 | 日本ゼオン      | 179,200   | 1,341.00 | 240,307,200   | 貸付有価証券<br>47,300株  |
| 4206 | アイカ工業      | 75,400    | 3,095.00 | 233,363,000   | 貸付有価証券<br>13,000株  |
| 4208 | UBE        | 154,000   | 2,004.00 | 308,616,000   | 貸付有価証券<br>33,900株  |
| 4212 | 積水樹脂       | 43,500    | 1,910.00 | 83,085,000    | 貸付有価証券<br>11,200株  |
| 4215 | タキロンシーアイ   | 65,300    | 518.00   | 33,825,400    | 貸付有価証券<br>16,300株  |
| 4216 | 旭有機材       | 19,900    | 2,929.00 | 58,287,100    | 貸付有価証券<br>3,400株   |
| 4218 | ニチバン       | 18,500    | 1,819.00 | 33,651,500    | 貸付有価証券<br>3,200株   |
| 4220 | リケンテクノス    | 64,400    | 532.00   | 34,260,800    | 貸付有価証券<br>15,900株  |
| 4221 | 大倉工業       | 13,800    | 1,898.00 | 26,192,400    | 貸付有価証券<br>3,400株   |
| 4228 | 積水化成成品工業   | 41,900    | 386.00   | 16,173,400    | 貸付有価証券<br>8,800株   |
| 4229 | 群栄化学工業     | 7,000     | 2,461.00 | 17,227,000    | 貸付有価証券<br>2,000株   |
| 4231 | タイガースポリマー  | 10,100    | 408.00   | 4,120,800     | 貸付有価証券<br>2,700株   |
| 4238 | ミライアル      | 6,700     | 1,543.00 | 10,338,100    | 貸付有価証券<br>2,000株   |
| 4245 | ダイキアクシス    | 7,300     | 688.00   | 5,022,400     | 貸付有価証券<br>2,100株   |
| 4246 | ダイキョーニシカワ  | 65,900    | 598.00   | 39,408,200    | 貸付有価証券<br>11,500株  |
| 4248 | 竹本容器       | 6,700     | 756.00   | 5,065,200     | 貸付有価証券<br>2,600株   |
| 4249 | 森六ホールディングス | 15,100    | 1,788.00 | 26,998,800    | 貸付有価証券<br>3,900株   |
| 4251 | 恵和         | 19,300    | 1,597.00 | 30,822,100    | 貸付有価証券<br>3,400株   |
| 4272 | 日本化薬       | 228,200   | 1,183.00 | 269,960,600   | 貸付有価証券<br>26,900株  |

|      |                 |           |          |               |                    |
|------|-----------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 4275 | カーリットホールディングス   | 26,800    | 749.00   | 20,073,200    | 貸付有価証券<br>6,700株   |
| 4362 | 日本精化            | 17,000    | 2,372.00 | 40,324,000    | 貸付有価証券<br>3,500株   |
| 4368 | 扶桑化学工業          | 27,700    | 3,660.00 | 101,382,000   | 貸付有価証券<br>4,400株   |
| 4369 | トリケミカル研究所       | 39,900    | 2,361.00 | 94,203,900    |                    |
| 4401 | A D E K A       | 104,200   | 2,138.00 | 222,779,600   | 貸付有価証券<br>33,600株  |
| 4403 | 日油              | 92,400    | 5,420.00 | 500,808,000   | 貸付有価証券<br>16,300株  |
| 4406 | 新日本理化           | 29,800    | 231.00   | 6,883,800     | 貸付有価証券<br>16,900株  |
| 4410 | ハリマ化成グループ       | 13,900    | 833.00   | 11,578,700    | 貸付有価証券<br>3,600株   |
| 4452 | 花王              | 727,500   | 5,216.00 | 3,794,640,000 | 貸付有価証券<br>52,400株  |
| 4461 | 第一工業製薬          | 10,700    | 2,039.00 | 21,817,300    | 貸付有価証券<br>1,600株   |
| 4462 | 石原ケミカル          | 13,600    | 1,271.00 | 17,285,600    | 貸付有価証券<br>3,800株   |
| 4463 | 日華化学            | 8,000     | 810.00   | 6,480,000     | 貸付有価証券<br>1,500株   |
| 4465 | ニイタカ            | 3,900     | 1,967.00 | 7,671,300     | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 4471 | 三洋化成工業          | 18,400    | 4,205.00 | 77,372,000    | 貸付有価証券<br>4,600株   |
| 4531 | 有機合成薬品工業        | 14,700    | 295.00   | 4,336,500     | 貸付有価証券<br>4,600株   |
| 4611 | 大日本塗料           | 36,500    | 779.00   | 28,433,500    | 貸付有価証券<br>8,400株   |
| 4612 | 日本ペイントホールディングス  | 1,322,000 | 1,186.00 | 1,567,892,000 | 貸付有価証券<br>271,800株 |
| 4613 | 関西ペイント          | 273,700   | 1,770.00 | 484,449,000   | 貸付有価証券<br>48,700株  |
| 4615 | 神東塗料            | 16,500    | 129.00   | 2,128,500     | 貸付有価証券<br>5,400株   |
| 4617 | 中国塗料            | 53,500    | 992.00   | 53,072,000    | 貸付有価証券<br>18,800株  |
| 4619 | 日本特殊塗料          | 12,600    | 868.00   | 10,936,800    | 貸付有価証券<br>4,600株   |
| 4620 | 藤倉化成            | 40,100    | 436.00   | 17,483,600    | 貸付有価証券<br>9,800株   |
| 4626 | 太陽ホールディングス      | 45,400    | 2,363.00 | 107,280,200   | 貸付有価証券<br>11,600株  |
| 4631 | D I C           | 116,800   | 2,385.00 | 278,568,000   | 貸付有価証券<br>25,200株  |
| 4633 | サカタインクス         | 66,500    | 1,064.00 | 70,756,000    | 貸付有価証券<br>8,900株   |
| 4634 | 東洋インキＳＣホールディングス | 58,500    | 1,833.00 | 107,230,500   | 貸付有価証券<br>12,000株  |

|      |                  |         |           |               |                   |
|------|------------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| 4636 | T & K T O K A    | 26,500  | 1,261.00  | 33,416,500    | 貸付有価証券<br>4,700株  |
| 4901 | 富士フイルムホールディングス   | 574,000 | 6,920.00  | 3,972,080,000 | 貸付有価証券<br>42,200株 |
| 4911 | 資生堂              | 624,600 | 6,586.00  | 4,113,615,600 |                   |
| 4912 | ライオン             | 358,900 | 1,413.00  | 507,125,700   | 貸付有価証券<br>93,600株 |
| 4914 | 高砂香料工業           | 20,200  | 2,543.00  | 51,368,600    | 貸付有価証券<br>4,600株  |
| 4917 | マンダム             | 64,600  | 1,426.00  | 92,119,600    | 貸付有価証券<br>15,600株 |
| 4919 | ミルボン             | 44,300  | 5,650.00  | 250,295,000   | 貸付有価証券<br>5,700株  |
| 4921 | ファンケル            | 130,900 | 2,655.00  | 347,539,500   | 貸付有価証券<br>18,000株 |
| 4922 | コーセー             | 60,800  | 14,150.00 | 860,320,000   | 貸付有価証券<br>14,600株 |
| 4923 | コタ               | 25,000  | 1,698.00  | 42,450,000    | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 4926 | シーボン             | 2,800   | 1,607.00  | 4,499,600     | 貸付有価証券<br>800株    |
| 4927 | ポーラ・オルビスホールディングス | 153,300 | 1,790.00  | 274,407,000   | 貸付有価証券<br>27,400株 |
| 4928 | ノエビアホールディングス     | 26,700  | 5,650.00  | 150,855,000   | 貸付有価証券<br>5,600株  |
| 4929 | アジュバンホールディングス    | 4,800   | 979.00    | 4,699,200     | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 4931 | 新日本製薬            | 17,100  | 1,408.00  | 24,076,800    | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 4951 | エスター             | 23,100  | 1,574.00  | 36,359,400    | 貸付有価証券<br>4,000株  |
| 4955 | アグロ カネショウ        | 12,000  | 1,588.00  | 19,056,000    | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 4956 | コニシ              | 49,900  | 1,805.00  | 90,069,500    | 貸付有価証券<br>11,200株 |
| 4958 | 長谷川香料            | 61,900  | 3,110.00  | 192,509,000   | 貸付有価証券<br>9,200株  |
| 4963 | 星光PMC            | 10,100  | 565.00    | 5,706,500     | 貸付有価証券<br>6,200株  |
| 4967 | 小林製薬             | 87,100  | 9,120.00  | 794,352,000   | 貸付有価証券<br>20,100株 |
| 4968 | 荒川化学工業           | 25,300  | 1,000.00  | 25,300,000    | 貸付有価証券<br>5,400株  |
| 4971 | メック              | 24,600  | 2,468.00  | 60,712,800    | 貸付有価証券<br>4,800株  |
| 4973 | 日本高純度化学          | 7,400   | 2,416.00  | 17,878,400    | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 4974 | タカラバイオ           | 80,600  | 1,736.00  | 139,921,600   | 貸付有価証券<br>11,600株 |
| 4975 | J C U            | 33,800  | 3,195.00  | 107,991,000   | 貸付有価証券<br>5,400株  |

|      |                 |         |          |               |                   |
|------|-----------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 4977 | 新田ゼラチン          | 12,300  | 871.00   | 10,713,300    | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 4979 | ＯＡＴアグリオ         | 8,100   | 1,476.00 | 11,955,600    | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 4980 | デクセリアルズ         | 86,400  | 2,769.00 | 239,241,600   | 貸付有価証券<br>11,400株 |
| 4985 | アース製薬           | 27,100  | 5,020.00 | 136,042,000   | 貸付有価証券<br>4,700株  |
| 4992 | 北興化学工業          | 30,100  | 827.00   | 24,892,700    | 貸付有価証券<br>8,600株  |
| 4994 | 大成ラミック          | 9,400   | 2,988.00 | 28,087,200    | 貸付有価証券<br>1,900株  |
| 4996 | クミアイ化学工業        | 118,800 | 871.00   | 103,474,800   | 貸付有価証券<br>20,600株 |
| 4997 | 日本農薬            | 54,900  | 698.00   | 38,320,200    | 貸付有価証券<br>13,200株 |
| 5142 | アキレス            | 19,500  | 1,256.00 | 24,492,000    | 貸付有価証券<br>3,100株  |
| 5208 | 有沢製作所           | 49,000  | 1,379.00 | 67,571,000    | 貸付有価証券<br>9,500株  |
| 6988 | 日東電工            | 217,200 | 8,160.00 | 1,772,352,000 | 貸付有価証券<br>46,000株 |
| 7874 | レック             | 42,600  | 996.00   | 42,429,600    | 貸付有価証券<br>5,700株  |
| 7888 | 三光合成            | 41,100  | 506.00   | 20,796,600    | 貸付有価証券<br>6,000株  |
| 7908 | きもと             | 32,900  | 233.00   | 7,665,700     | 貸付有価証券<br>7,500株  |
| 7917 | 藤森工業            | 23,600  | 3,285.00 | 77,526,000    | 貸付有価証券<br>2,300株  |
| 7925 | 前澤化成工業          | 19,300  | 1,372.00 | 26,479,600    | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 7931 | 未来工業            | 10,700  | 1,494.00 | 15,985,800    | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 7940 | ウェーブロックホールディングス | 8,100   | 626.00   | 5,070,600     | 貸付有価証券<br>1,900株  |
| 7942 | ＪＳＰ             | 21,000  | 1,544.00 | 32,424,000    | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 7947 | エフピコ            | 56,600  | 3,450.00 | 195,270,000   | 貸付有価証券<br>11,600株 |
| 7958 | 天馬              | 25,400  | 2,192.00 | 55,676,800    |                   |
| 7970 | 信越ポリマー          | 55,300  | 1,265.00 | 69,954,500    | 貸付有価証券<br>4,600株  |
| 7971 | 東リ              | 49,000  | 225.00   | 11,025,000    | 貸付有価証券<br>15,100株 |
| 7988 | ニフコ             | 107,900 | 3,335.00 | 359,846,500   | 貸付有価証券<br>31,100株 |
| 7995 | バルカー            | 25,000  | 2,799.00 | 69,975,000    | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 8113 | ユニ・チャーム         | 623,200 | 4,943.00 | 3,080,477,600 | 貸付有価証券<br>80,700株 |

|      |               |           |          |                |                    |
|------|---------------|-----------|----------|----------------|--------------------|
| 9385 | ショーエイコーポレーション | 5,700     | 584.00   | 3,328,800      | 貸付有価証券<br>600株     |
| 4151 | 協和キリン         | 361,400   | 2,942.00 | 1,063,238,800  | 貸付有価証券<br>44,500株  |
| 4502 | 武田薬品工業        | 2,647,300 | 4,176.00 | 11,055,124,800 | 貸付有価証券<br>187,600株 |
| 4503 | アステラス製薬       | 2,866,800 | 1,975.00 | 5,661,930,000  | 貸付有価証券<br>219,000株 |
| 4506 | 住友ファーマ        | 221,900   | 902.00   | 200,153,800    | 貸付有価証券<br>32,800株  |
| 4507 | 塩野義製薬         | 382,300   | 6,314.00 | 2,413,842,200  | 貸付有価証券<br>5,400株   |
| 4512 | わかもと製薬        | 20,900    | 222.00   | 4,639,800      | 貸付有価証券<br>7,200株   |
| 4516 | 日本新薬          | 70,500    | 6,730.00 | 474,465,000    | 貸付有価証券<br>11,600株  |
| 4519 | 中外製薬          | 936,400   | 3,486.00 | 3,264,290,400  |                    |
| 4521 | 科研製薬          | 51,200    | 3,785.00 | 193,792,000    | 貸付有価証券<br>12,700株  |
| 4523 | エーザイ          | 363,900   | 8,281.00 | 3,013,455,900  | 貸付有価証券<br>74,000株  |
| 4527 | ロート製薬         | 289,800   | 2,342.00 | 678,711,600    | 貸付有価証券<br>45,600株  |
| 4528 | 小野薬品工業        | 577,100   | 2,930.50 | 1,691,191,550  | 貸付有価証券<br>13,200株  |
| 4530 | 久光製薬          | 66,500    | 3,975.00 | 264,337,500    |                    |
| 4534 | 持田製薬          | 35,800    | 3,445.00 | 123,331,000    | 貸付有価証券<br>9,900株   |
| 4536 | 参天製薬          | 562,900   | 1,008.00 | 567,403,200    | 貸付有価証券<br>82,400株  |
| 4538 | 扶桑薬品工業        | 9,500     | 1,950.00 | 18,525,000     | 貸付有価証券<br>1,600株   |
| 4539 | 日本ケミファ        | 2,300     | 1,746.00 | 4,015,800      | 貸付有価証券<br>1,100株   |
| 4540 | ツムラ           | 94,200    | 2,760.00 | 259,992,000    | 貸付有価証券<br>22,700株  |
| 4541 | 日医工           | 23,900    | 72.00    | 1,720,800      |                    |
| 4547 | キッセイ薬品工業      | 46,200    | 2,553.00 | 117,948,600    | 貸付有価証券<br>11,800株  |
| 4548 | 生化学工業         | 57,000    | 837.00   | 47,709,000     | 貸付有価証券<br>12,400株  |
| 4549 | 栄研化学          | 48,600    | 1,667.00 | 81,016,200     | 貸付有価証券<br>10,600株  |
| 4551 | 鳥居薬品          | 16,100    | 3,050.00 | 49,105,000     | 貸付有価証券<br>4,400株   |
| 4552 | J C Rファーマ     | 101,300   | 1,675.00 | 169,677,500    | 貸付有価証券<br>19,200株  |
| 4553 | 東和薬品          | 46,000    | 2,040.00 | 93,840,000     | 貸付有価証券<br>5,700株   |
| 4554 | 富士製薬工業        | 19,300    | 1,046.00 | 20,187,800     | 貸付有価証券<br>4,400株   |

|      |                  |           |          |                |                    |
|------|------------------|-----------|----------|----------------|--------------------|
| 4559 | ゼリア新薬工業          | 41,500    | 2,155.00 | 89,432,500     | 貸付有価証券<br>12,900株  |
| 4568 | 第一三共             | 2,606,100 | 4,377.00 | 11,406,899,700 | 貸付有価証券<br>17,400株  |
| 4569 | キョーリン製薬ホールディングス  | 64,900    | 1,711.00 | 111,043,900    | 貸付有価証券<br>17,800株  |
| 4574 | 大幸薬品             | 54,200    | 390.00   | 21,138,000     | 貸付有価証券<br>10,200株  |
| 4577 | ダイト              | 22,500    | 2,565.00 | 57,712,500     | 貸付有価証券<br>3,700株   |
| 4578 | 大塚ホールディングス       | 684,400   | 4,206.00 | 2,878,586,400  | 貸付有価証券<br>7,700株   |
| 4581 | 大正製薬ホールディングス     | 66,500    | 5,450.00 | 362,425,000    | 貸付有価証券<br>16,400株  |
| 4587 | ペプチドリーム          | 145,000   | 2,075.00 | 300,875,000    | 貸付有価証券<br>27,700株  |
| 4886 | あすか製薬ホールディングス    | 30,700    | 1,275.00 | 39,142,500     | 貸付有価証券<br>8,700株   |
| 4887 | サワイグループホールディングス  | 68,400    | 3,960.00 | 270,864,000    | 貸付有価証券<br>13,500株  |
| 3315 | 日本コークス工業         | 269,800   | 96.00    | 25,900,800     | 貸付有価証券<br>49,900株  |
| 5011 | ニチレキ             | 35,300    | 1,346.00 | 47,513,800     | 貸付有価証券<br>10,200株  |
| 5013 | ユシロ化学工業          | 15,500    | 795.00   | 12,322,500     | 貸付有価証券<br>3,900株   |
| 5015 | ビーピー・カストロール      | 7,700     | 889.00   | 6,845,300      | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 5017 | 富士石油             | 61,000    | 268.00   | 16,348,000     | 貸付有価証券<br>11,800株  |
| 5018 | MORESCO          | 7,100     | 1,195.00 | 8,484,500      | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 5019 | 出光興産             | 332,200   | 3,320.00 | 1,102,904,000  | 貸付有価証券<br>49,900株  |
| 5020 | ENEOSホールディングス    | 5,404,600 | 475.00   | 2,567,185,000  | 貸付有価証券<br>327,200株 |
| 5021 | コスモエネルギーホールディングス | 118,300   | 3,745.00 | 443,033,500    | 貸付有価証券<br>12,800株  |
| 5101 | 横浜ゴム             | 170,200   | 2,132.00 | 362,866,400    | 貸付有価証券<br>42,200株  |
| 5105 | TOYO TIRE        | 171,900   | 1,529.00 | 262,835,100    | 貸付有価証券<br>37,900株  |
| 5108 | ブリヂストン           | 955,300   | 4,866.00 | 4,648,489,800  | 貸付有価証券<br>90,900株  |
| 5110 | 住友ゴム工業           | 293,400   | 1,152.00 | 337,996,800    | 貸付有価証券<br>46,400株  |
| 5121 | 藤倉コンポジット         | 17,200    | 880.00   | 15,136,000     | 貸付有価証券<br>5,900株   |
| 5122 | オカモト             | 16,600    | 3,760.00 | 62,416,000     | 貸付有価証券<br>2,900株   |
| 5185 | フコク              | 15,700    | 1,052.00 | 16,516,400     | 貸付有価証券<br>2,800株   |



|      |                |         |           |               |                   |
|------|----------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| 5186 | ニッタ            | 30,400  | 2,836.00  | 86,214,400    | 貸付有価証券<br>6,500株  |
| 5191 | 住友理工           | 58,000  | 653.00    | 37,874,000    | 貸付有価証券<br>13,600株 |
| 5192 | 三ツ星ベルト         | 43,600  | 3,650.00  | 159,140,000   | 貸付有価証券<br>8,800株  |
| 5195 | バンドー化学         | 47,400  | 1,023.00  | 48,490,200    | 貸付有価証券<br>7,800株  |
| 3110 | 日東紡績           | 35,600  | 2,022.00  | 71,983,200    | 貸付有価証券<br>6,600株  |
| 5201 | A G C          | 304,400 | 4,735.00  | 1,441,334,000 |                   |
| 5202 | 日本板硝子          | 152,500 | 627.00    | 95,617,500    | 貸付有価証券<br>21,500株 |
| 5204 | 石塚硝子           | 3,400   | 1,437.00  | 4,885,800     | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 5210 | 日本山村硝子         | 7,400   | 543.00    | 4,018,200     | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| 5214 | 日本電気硝子         | 122,100 | 2,422.00  | 295,726,200   | 貸付有価証券<br>30,600株 |
| 5218 | オハラ            | 14,200  | 1,188.00  | 16,869,600    | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| 5232 | 住友大阪セメント       | 42,100  | 3,340.00  | 140,614,000   | 貸付有価証券<br>12,200株 |
| 5233 | 太平洋セメント        | 190,500 | 2,185.00  | 416,242,500   | 貸付有価証券<br>28,000株 |
| 5262 | 日本ヒューム         | 26,200  | 660.00    | 17,292,000    | 貸付有価証券<br>7,700株  |
| 5269 | 日本コンクリート工業     | 58,000  | 229.00    | 13,282,000    | 貸付有価証券<br>17,100株 |
| 5273 | 三谷セキサン         | 12,500  | 4,075.00  | 50,937,500    | 貸付有価証券<br>2,500株  |
| 5288 | アジアパイルホールディングス | 46,700  | 586.00    | 27,366,200    | 貸付有価証券<br>6,300株  |
| 5301 | 東海カーボン         | 250,900 | 1,105.00  | 277,244,500   | 貸付有価証券<br>38,500株 |
| 5302 | 日本カーボン         | 17,200  | 4,370.00  | 75,164,000    | 貸付有価証券<br>3,900株  |
| 5310 | 東洋炭素           | 18,700  | 4,055.00  | 75,828,500    | 貸付有価証券<br>4,000株  |
| 5331 | ノリタケカンパニーリミテド  | 14,900  | 4,100.00  | 61,090,000    | 貸付有価証券<br>3,800株  |
| 5332 | T O T O        | 197,400 | 5,040.00  | 994,896,000   | 貸付有価証券<br>46,800株 |
| 5333 | 日本碍子           | 354,000 | 1,767.00  | 625,518,000   | 貸付有価証券<br>84,200株 |
| 5334 | 日本特殊陶業         | 227,700 | 2,564.00  | 583,822,800   | 貸付有価証券<br>52,500株 |
| 5337 | ダントーホールディングス   | 14,000  | 264.00    | 3,696,000     | 貸付有価証券<br>3,300株  |
| 5344 | M A R U W A    | 11,000  | 16,980.00 | 186,780,000   | 貸付有価証券<br>1,700株  |

|      |               |           |          |               |                    |
|------|---------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 5351 | 品川リフラクトリーズ    | 8,400     | 4,145.00 | 34,818,000    | 貸付有価証券<br>2,000株   |
| 5352 | 黒崎播磨          | 6,100     | 5,890.00 | 35,929,000    | 貸付有価証券<br>1,500株   |
| 5357 | ヨータイ          | 20,000    | 1,520.00 | 30,400,000    | 貸付有価証券<br>4,500株   |
| 5363 | 東京窯業          | 21,200    | 281.00   | 5,957,200     | 貸付有価証券<br>8,600株   |
| 5367 | ニッカトー         | 8,900     | 526.00   | 4,681,400     | 貸付有価証券<br>2,900株   |
| 5384 | フジミインコーポレーテッド | 23,800    | 6,720.00 | 159,936,000   | 貸付有価証券<br>4,200株   |
| 5388 | クニミネ工業        | 6,700     | 847.00   | 5,674,900     | 貸付有価証券<br>1,800株   |
| 5391 | エーアンドエーマテリアル  | 3,600     | 897.00   | 3,229,200     | 貸付有価証券<br>1,400株   |
| 5393 | ニチアス          | 75,600    | 2,447.00 | 184,993,200   | 貸付有価証券<br>19,600株  |
| 7943 | ニチハ           | 37,500    | 2,744.00 | 102,900,000   | 貸付有価証券<br>3,300株   |
| 5401 | 日本製鉄          | 1,378,000 | 2,721.50 | 3,750,227,000 | 貸付有価証券<br>281,500株 |
| 5406 | 神戸製鋼所         | 618,900   | 695.00   | 430,135,500   | 貸付有価証券<br>126,000株 |
| 5408 | 中山製鋼所         | 63,300    | 983.00   | 62,223,900    | 貸付有価証券<br>7,800株   |
| 5410 | 合同製鐵          | 15,300    | 2,507.00 | 38,357,100    | 貸付有価証券<br>3,900株   |
| 5411 | J F Eホールディングス | 822,400   | 1,725.00 | 1,418,640,000 | 貸付有価証券<br>50,300株  |
| 5423 | 東京製鐵          | 86,500    | 1,407.00 | 121,705,500   | 貸付有価証券<br>35,800株  |
| 5440 | 共英製鋼          | 35,100    | 1,401.00 | 49,175,100    | 貸付有価証券<br>6,800株   |
| 5444 | 大和工業          | 50,800    | 5,170.00 | 262,636,000   | 貸付有価証券<br>16,900株  |
| 5445 | 東京鐵鋼          | 14,600    | 1,646.00 | 24,031,600    | 貸付有価証券<br>1,800株   |
| 5449 | 大阪製鐵          | 14,100    | 1,273.00 | 17,949,300    | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 5451 | 淀川製鋼所         | 35,000    | 2,716.00 | 95,060,000    | 貸付有価証券<br>8,500株   |
| 5463 | 丸一鋼管          | 93,700    | 2,821.00 | 264,327,700   | 貸付有価証券<br>14,300株  |
| 5464 | モリ工業          | 5,200     | 2,920.00 | 15,184,000    | 貸付有価証券<br>2,100株   |
| 5471 | 大同特殊鋼         | 38,800    | 4,750.00 | 184,300,000   | 貸付有価証券<br>7,200株   |
| 5476 | 日本高周波鋼業       | 7,800     | 330.00   | 2,574,000     | 貸付有価証券<br>1,600株   |
| 5480 | 日本冶金工業        | 22,500    | 4,635.00 | 104,287,500   | 貸付有価証券<br>5,200株   |

|      |                |         |          |               |                   |
|------|----------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 5481 | 山陽特殊製鋼         | 30,400  | 2,470.00 | 75,088,000    | 貸付有価証券<br>4,900株  |
| 5482 | 愛知製鋼           | 17,700  | 2,300.00 | 40,710,000    | 貸付有価証券<br>3,800株  |
| 5491 | 日本金属           | 5,300   | 945.00   | 5,008,500     | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 5541 | 大太平洋金属         | 21,800  | 2,031.00 | 44,275,800    | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| 5563 | 新日本電工          | 196,700 | 392.00   | 77,106,400    | 貸付有価証券<br>40,200株 |
| 5602 | 栗本鐵工所          | 14,600  | 1,862.00 | 27,185,200    | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| 5603 | 虹技             | 2,700   | 942.00   | 2,543,400     | 貸付有価証券<br>700株    |
| 5612 | 日本鑄鉄管          | 2,200   | 996.00   | 2,191,200     | 貸付有価証券<br>700株    |
| 5632 | 三菱製鋼           | 19,300  | 1,119.00 | 21,596,700    | 貸付有価証券<br>4,800株  |
| 5658 | 日亜鋼業           | 24,100  | 257.00   | 6,193,700     | 貸付有価証券<br>10,300株 |
| 5659 | 日本精線           | 4,200   | 4,490.00 | 18,858,000    | 貸付有価証券<br>700株    |
| 5698 | エンビプロ・ホールディングス | 14,100  | 760.00   | 10,716,000    | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 6319 | シンニッタン         | 25,700  | 244.00   | 6,270,800     | 貸付有価証券<br>11,300株 |
| 7305 | 新家工業           | 4,400   | 2,393.00 | 10,529,200    | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 5702 | 大紀アルミニウム工業所    | 43,800  | 1,462.00 | 64,035,600    | 貸付有価証券<br>10,400株 |
| 5703 | 日本軽金属ホールディングス  | 83,000  | 1,604.00 | 133,132,000   | 貸付有価証券<br>14,300株 |
| 5706 | 三井金属鉱業         | 89,500  | 3,420.00 | 306,090,000   | 貸付有価証券<br>19,400株 |
| 5707 | 東邦亜鉛           | 18,200  | 2,196.00 | 39,967,200    | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 5711 | 三菱マテリアル        | 205,300 | 2,246.00 | 461,103,800   | 貸付有価証券<br>29,000株 |
| 5713 | 住友金属鉱山         | 356,800 | 5,315.00 | 1,896,392,000 | 貸付有価証券<br>64,400株 |
| 5714 | DOWAホールディングス   | 69,100  | 4,460.00 | 308,186,000   | 貸付有価証券<br>11,100株 |
| 5715 | 古河機械金属         | 45,100  | 1,316.00 | 59,351,600    | 貸付有価証券<br>10,000株 |
| 5721 | エス・サイエンス       | 94,300  | 26.00    | 2,451,800     | 貸付有価証券<br>28,200株 |
| 5726 | 大阪チタニウムテクノロジーズ | 45,200  | 3,905.00 | 176,506,000   | 貸付有価証券<br>4,600株  |
| 5727 | 東邦チタニウム        | 55,600  | 2,695.00 | 149,842,000   | 貸付有価証券<br>14,900株 |
| 5741 | U A C J        | 43,100  | 2,478.00 | 106,801,800   | 貸付有価証券<br>9,800株  |

|      |                  |           |          |               |                   |
|------|------------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 5757 | C Kサンエツ          | 7,400     | 4,220.00 | 31,228,000    | 貸付有価証券<br>900株    |
| 5801 | 古河電気工業           | 102,500   | 2,487.00 | 254,917,500   | 貸付有価証券<br>13,600株 |
| 5802 | 住友電気工業           | 1,062,700 | 1,544.50 | 1,641,340,150 |                   |
| 5803 | フジクラ             | 330,000   | 994.00   | 328,020,000   | 貸付有価証券<br>52,900株 |
| 5805 | 昭和電線ホールディングス     | 34,400    | 1,792.00 | 61,644,800    | 貸付有価証券<br>7,200株  |
| 5809 | タツタ電線            | 62,600    | 714.00   | 44,696,400    | 貸付有価証券<br>17,300株 |
| 5819 | カナレ電気            | 3,100     | 1,408.00 | 4,364,800     | 貸付有価証券<br>700株    |
| 5821 | 平河ヒューテック         | 17,700    | 1,165.00 | 20,620,500    | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 5851 | リョービ             | 32,800    | 1,212.00 | 39,753,600    | 貸付有価証券<br>8,600株  |
| 5852 | アーレスティ           | 22,600    | 436.00   | 9,853,600     | 貸付有価証券<br>5,700株  |
| 5857 | アサヒホールディングス      | 124,500   | 2,040.00 | 253,980,000   | 貸付有価証券<br>23,200株 |
| 3421 | 稲葉製作所            | 18,000    | 1,380.00 | 24,840,000    | 貸付有価証券<br>900株    |
| 3431 | 宮地エンジニアリンググループ   | 8,500     | 3,640.00 | 30,940,000    | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 3433 | トーカロ             | 84,600    | 1,233.00 | 104,311,800   | 貸付有価証券<br>17,500株 |
| 3434 | アルファＣｏ           | 7,500     | 926.00   | 6,945,000     | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 3436 | SUMCO            | 585,900   | 1,963.00 | 1,150,121,700 | 貸付有価証券<br>52,400株 |
| 3443 | 川田テクノロジーズ        | 7,300     | 3,350.00 | 24,455,000    | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 3445 | R S Technologies | 20,200    | 4,015.00 | 81,103,000    | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 3446 | ジェイテックコーポレーション   | 2,700     | 3,130.00 | 8,451,000     | 貸付有価証券<br>700株    |
| 3447 | 信和               | 13,100    | 800.00   | 10,480,000    | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 5901 | 東洋製罐グループホールディングス | 203,600   | 1,633.00 | 332,478,800   | 貸付有価証券<br>27,900株 |
| 5902 | ホッカンホールディングス     | 16,500    | 1,396.00 | 23,034,000    | 貸付有価証券<br>3,600株  |
| 5909 | コロナ              | 17,200    | 893.00   | 15,359,600    | 貸付有価証券<br>3,900株  |
| 5911 | 横河ブリッジホールディングス   | 40,700    | 1,911.00 | 77,777,700    | 貸付有価証券<br>12,500株 |
| 5915 | 駒井ハルテック          | 3,300     | 1,560.00 | 5,148,000     | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 5923 | 高田機工             | 1,800     | 2,536.00 | 4,564,800     | 貸付有価証券<br>500株    |

|      |            |         |          |             |                   |
|------|------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| 5929 | 三和ホールディングス | 283,400 | 1,257.00 | 356,233,800 | 貸付有価証券<br>66,600株 |
| 5930 | 文化シャッター    | 88,600  | 1,129.00 | 100,029,400 | 貸付有価証券<br>20,000株 |
| 5932 | 三協立山       | 42,200  | 645.00   | 27,219,000  | 貸付有価証券<br>10,000株 |
| 5933 | アルインコ      | 23,500  | 1,024.00 | 24,064,000  | 貸付有価証券<br>4,100株  |
| 5936 | 東洋シャッター    | 4,700   | 513.00   | 2,411,100   | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 5938 | L I X I L  | 448,300 | 2,168.00 | 971,914,400 | 貸付有価証券<br>64,600株 |
| 5942 | 日本ファイルコン   | 13,300  | 450.00   | 5,985,000   | 貸付有価証券<br>5,000株  |
| 5943 | ノーリツ       | 45,300  | 1,464.00 | 66,319,200  | 貸付有価証券<br>14,100株 |
| 5946 | 長府製作所      | 31,000  | 2,067.00 | 64,077,000  | 貸付有価証券<br>6,200株  |
| 5947 | リンナイ       | 55,800  | 9,990.00 | 557,442,000 | 貸付有価証券<br>8,500株  |
| 5951 | ダイニチ工業     | 10,100  | 680.00   | 6,868,000   | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 5957 | 日東精工       | 44,600  | 511.00   | 22,790,600  | 貸付有価証券<br>9,500株  |
| 5958 | 三洋工業       | 2,600   | 1,840.00 | 4,784,000   | 貸付有価証券<br>900株    |
| 5959 | 岡部         | 49,500  | 724.00   | 35,838,000  | 貸付有価証券<br>14,400株 |
| 5970 | ジーテクト      | 34,300  | 1,511.00 | 51,827,300  | 貸付有価証券<br>7,400株  |
| 5975 | 東プレ        | 54,200  | 1,220.00 | 66,124,000  | 貸付有価証券<br>13,400株 |
| 5976 | 高周波熱錬      | 50,200  | 685.00   | 34,387,000  | 貸付有価証券<br>12,800株 |
| 5981 | 東京製綱       | 18,100  | 1,063.00 | 19,240,300  | 貸付有価証券<br>7,400株  |
| 5985 | サンコール      | 18,100  | 652.00   | 11,801,200  | 貸付有価証券<br>4,700株  |
| 5986 | モリテック スチール | 16,500  | 304.00   | 5,016,000   | 貸付有価証券<br>3,900株  |
| 5988 | パイオラックス    | 42,400  | 1,749.00 | 74,157,600  | 貸付有価証券<br>6,500株  |
| 5989 | エイチワン      | 31,700  | 649.00   | 20,573,300  | 貸付有価証券<br>7,500株  |
| 5991 | 日本発條       | 272,200 | 885.00   | 240,897,000 | 貸付有価証券<br>70,800株 |
| 5992 | 中央発條       | 17,100  | 769.00   | 13,149,900  | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 5998 | アドバネクス     | 2,800   | 1,052.00 | 2,945,600   | 貸付有価証券<br>800株    |
| 7989 | 立川ブラインド工業  | 13,900  | 1,228.00 | 17,069,200  | 貸付有価証券<br>1,900株  |

|      |             |         |           |               |                    |
|------|-------------|---------|-----------|---------------|--------------------|
| 8155 | 三益半導体工業     | 27,700  | 2,532.00  | 70,136,400    | 貸付有価証券<br>5,800株   |
| 1909 | 日本ドライケミカル   | 4,800   | 1,434.00  | 6,883,200     | 貸付有価証券<br>1,500株   |
| 5631 | 日本製鋼所       | 83,000  | 2,754.00  | 228,582,000   | 貸付有価証券<br>13,300株  |
| 6005 | 三浦工業        | 125,800 | 3,225.00  | 405,705,000   | 貸付有価証券<br>32,300株  |
| 6013 | タクマ         | 92,600  | 1,258.00  | 116,490,800   | 貸付有価証券<br>24,300株  |
| 6101 | ツガミ         | 66,900  | 1,350.00  | 90,315,000    | 貸付有価証券<br>15,100株  |
| 6103 | オークマ        | 30,100  | 5,100.00  | 153,510,000   | 貸付有価証券<br>5,100株   |
| 6104 | 芝浦機械        | 30,100  | 2,804.00  | 84,400,400    | 貸付有価証券<br>7,900株   |
| 6113 | アマダ         | 480,700 | 1,139.00  | 547,517,300   | 貸付有価証券<br>103,100株 |
| 6118 | アイダエンジニアリング | 62,000  | 796.00    | 49,352,000    | 貸付有価証券<br>11,800株  |
| 6121 | TAKI SAWA   | 6,100   | 1,123.00  | 6,850,300     | 貸付有価証券<br>2,000株   |
| 6134 | FUJ I       | 130,900 | 2,115.00  | 276,853,500   | 貸付有価証券<br>25,700株  |
| 6135 | 牧野フライス製作所   | 33,300  | 4,520.00  | 150,516,000   | 貸付有価証券<br>7,200株   |
| 6136 | オーエスジー      | 143,800 | 1,973.00  | 283,717,400   | 貸付有価証券<br>16,900株  |
| 6138 | ダイジェット工業    | 2,200   | 857.00    | 1,885,400     | 貸付有価証券<br>700株     |
| 6140 | 旭ダイヤモンド工業   | 84,200  | 730.00    | 61,466,000    | 貸付有価証券<br>18,700株  |
| 6141 | DMG森精機      | 182,600 | 1,929.00  | 352,235,400   | 貸付有価証券<br>42,600株  |
| 6143 | ソディック       | 83,100  | 747.00    | 62,075,700    | 貸付有価証券<br>14,700株  |
| 6146 | ディスコ        | 48,300  | 39,050.00 | 1,886,115,000 | 貸付有価証券<br>7,600株   |
| 6151 | 日東工器        | 14,600  | 1,543.00  | 22,527,800    | 貸付有価証券<br>4,000株   |
| 6157 | 日進工具        | 25,100  | 1,065.00  | 26,731,500    | 貸付有価証券<br>4,200株   |
| 6165 | パンチ工業       | 18,200  | 462.00    | 8,408,400     | 貸付有価証券<br>5,500株   |
| 6167 | 富士ダイス       | 10,700  | 592.00    | 6,334,400     | 貸付有価証券<br>3,500株   |
| 6203 | 豊和工業        | 10,900  | 942.00    | 10,267,800    | 貸付有価証券<br>3,400株   |
| 6205 | ニデックオーケーケー  | 8,000   | 923.00    | 7,384,000     | 貸付有価証券<br>2,600株   |
| 6208 | 石川製作所       | 5,500   | 1,432.00  | 7,876,000     | 貸付有価証券<br>1,100株   |

|      |              |         |           |               |                   |
|------|--------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| 6210 | 東洋機械金属       | 13,800  | 553.00    | 7,631,400     | 貸付有価証券<br>5,400株  |
| 6217 | 津田駒工業        | 3,600   | 546.00    | 1,965,600     | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 6218 | エンシュウ        | 4,700   | 693.00    | 3,257,100     | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 6222 | 島精機製作所       | 47,900  | 1,962.00  | 93,979,800    | 貸付有価証券<br>10,700株 |
| 6235 | オプトラン        | 44,500  | 2,548.00  | 113,386,000   | 貸付有価証券<br>8,000株  |
| 6236 | NCホールディングス   | 5,900   | 2,027.00  | 11,959,300    | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 6237 | イワキポンプ       | 20,100  | 1,254.00  | 25,205,400    | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 6238 | フリー          | 31,600  | 1,126.00  | 35,581,600    | 貸付有価証券<br>5,500株  |
| 6240 | ヤマシンフィルタ     | 71,800  | 559.00    | 40,136,200    | 貸付有価証券<br>10,900株 |
| 6247 | 日阪製作所        | 29,200  | 846.00    | 24,703,200    | 貸付有価証券<br>2,500株  |
| 6250 | やまびこ         | 49,200  | 1,108.00  | 54,513,600    | 貸付有価証券<br>10,900株 |
| 6254 | 野村マイクロ・サイエンス | 10,200  | 4,590.00  | 46,818,000    | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 6258 | 平田機工         | 14,400  | 6,160.00  | 88,704,000    | 貸付有価証券<br>1,200株  |
| 6262 | ベガサスミシン製造    | 33,200  | 825.00    | 27,390,000    | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 6264 | マルマエ         | 14,600  | 1,732.00  | 25,287,200    | 貸付有価証券<br>2,500株  |
| 6266 | タツモ          | 16,500  | 1,942.00  | 32,043,000    | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| 6268 | ナブテスコ        | 189,100 | 3,655.00  | 691,160,500   | 貸付有価証券<br>34,500株 |
| 6269 | 三井海洋開発       | 37,800  | 1,387.00  | 52,428,600    | 貸付有価証券<br>4,700株  |
| 6272 | レオン自動機       | 31,700  | 1,074.00  | 34,045,800    | 貸付有価証券<br>5,800株  |
| 6273 | SMC          | 97,700  | 64,780.00 | 6,329,006,000 | 貸付有価証券<br>19,700株 |
| 6277 | ホソカワミクロン     | 23,100  | 2,732.00  | 63,109,200    |                   |
| 6278 | ユニオンツール      | 13,200  | 3,345.00  | 44,154,000    | 貸付有価証券<br>3,400株  |
| 6282 | オイレス工業       | 42,100  | 1,514.00  | 63,739,400    | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 6284 | 日精エー・エス・ビー機械 | 13,700  | 4,665.00  | 63,910,500    | 貸付有価証券<br>500株    |
| 6287 | サトーホールディングス  | 42,800  | 2,080.00  | 89,024,000    | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 6289 | 技研製作所        | 31,400  | 2,861.00  | 89,835,400    | 貸付有価証券<br>3,800株  |

|      |                |           |           |               |                    |
|------|----------------|-----------|-----------|---------------|--------------------|
| 6291 | 日本エアーテック       | 15,200    | 1,109.00  | 16,856,800    | 貸付有価証券<br>1,600株   |
| 6292 | カワタ            | 6,300     | 834.00    | 5,254,200     | 貸付有価証券<br>1,900株   |
| 6293 | 日精樹脂工業         | 22,400    | 974.00    | 21,817,600    | 貸付有価証券<br>6,100株   |
| 6294 | オカダアイヨン        | 6,700     | 1,577.00  | 10,565,900    | 貸付有価証券<br>1,700株   |
| 6298 | ワイエイシイホールディングス | 8,500     | 1,920.00  | 16,320,000    | 貸付有価証券<br>1,900株   |
| 6301 | 小松製作所          | 1,411,500 | 3,128.00  | 4,415,172,000 | 貸付有価証券<br>278,100株 |
| 6302 | 住友重機械工業        | 178,200   | 2,807.00  | 500,207,400   | 貸付有価証券<br>39,500株  |
| 6305 | 日立建機           | 120,000   | 3,090.00  | 370,800,000   |                    |
| 6306 | 日工             | 44,600    | 628.00    | 28,008,800    | 貸付有価証券<br>6,000株   |
| 6309 | 巴工業            | 12,900    | 2,410.00  | 31,089,000    | 貸付有価証券<br>2,300株   |
| 6310 | 井関農機           | 28,200    | 1,209.00  | 34,093,800    | 貸付有価証券<br>6,800株   |
| 6315 | TOWA           | 30,700    | 1,984.00  | 60,908,800    | 貸付有価証券<br>4,400株   |
| 6316 | 丸山製作所          | 3,300     | 1,599.00  | 5,276,700     | 貸付有価証券<br>1,600株   |
| 6317 | 北川鉄工所          | 11,800    | 1,178.00  | 13,900,400    | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 6323 | ローツェ           | 15,700    | 10,150.00 | 159,355,000   | 貸付有価証券<br>800株     |
| 6325 | タカキタ           | 6,500     | 436.00    | 2,834,000     | 貸付有価証券<br>2,300株   |
| 6326 | クボタ            | 1,594,200 | 1,927.00  | 3,072,023,400 | 貸付有価証券<br>327,600株 |
| 6328 | 荏原実業           | 14,400    | 2,458.00  | 35,395,200    | 貸付有価証券<br>3,300株   |
| 6331 | 三菱化工機          | 9,700     | 2,187.00  | 21,213,900    | 貸付有価証券<br>1,500株   |
| 6332 | 月島機械           | 40,700    | 1,005.00  | 40,903,500    | 貸付有価証券<br>5,000株   |
| 6333 | 帝国電機製作所        | 21,800    | 2,404.00  | 52,407,200    | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 6335 | 東京機械製作所        | 6,700     | 601.00    | 4,026,700     | 貸付有価証券<br>900株     |
| 6339 | 新東工業           | 60,900    | 715.00    | 43,543,500    | 貸付有価証券<br>4,000株   |
| 6340 | 澁谷工業           | 28,300    | 2,407.00  | 68,118,100    | 貸付有価証券<br>5,700株   |
| 6345 | アイチ コーポレーション   | 42,600    | 773.00    | 32,929,800    | 貸付有価証券<br>5,000株   |
| 6349 | 小森コーポレーション     | 69,800    | 900.00    | 62,820,000    | 貸付有価証券<br>6,600株   |
| 6351 | 鶴見製作所          | 23,000    | 1,995.00  | 45,885,000    |                    |



|      |                 |         |           |               |                   |
|------|-----------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| 6355 | 住友精密工業          | 3,200   | 3,640.00  | 11,648,000    |                   |
| 6356 | 日本ギア工業          | 7,600   | 427.00    | 3,245,200     | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 6358 | 酒井重工業           | 3,500   | 3,495.00  | 12,232,500    | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 6361 | 荏原製作所           | 123,200 | 5,460.00  | 672,672,000   | 貸付有価証券<br>28,600株 |
| 6362 | 石井鐵工所           | 2,500   | 2,303.00  | 5,757,500     |                   |
| 6363 | 西島製作所           | 26,000  | 1,498.00  | 38,948,000    | 貸付有価証券<br>2,100株  |
| 6364 | 北越工業            | 30,300  | 1,373.00  | 41,601,900    | 貸付有価証券<br>900株    |
| 6367 | ダイキン工業          | 359,600 | 22,535.00 | 8,103,586,000 | 貸付有価証券<br>82,300株 |
| 6368 | オルガノ            | 41,400  | 3,195.00  | 132,273,000   | 貸付有価証券<br>4,000株  |
| 6369 | トーヨーカネツ         | 11,400  | 2,647.00  | 30,175,800    | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 6370 | 栗田工業            | 168,500 | 5,900.00  | 994,150,000   | 貸付有価証券<br>10,300株 |
| 6371 | 椿本チエイン          | 42,700  | 3,075.00  | 131,302,500   | 貸付有価証券<br>9,700株  |
| 6373 | 大同工業            | 8,700   | 758.00    | 6,594,600     | 貸付有価証券<br>2,100株  |
| 6378 | 木村化工機           | 23,000  | 711.00    | 16,353,000    | 貸付有価証券<br>5,900株  |
| 6381 | アネスト岩田          | 51,200  | 869.00    | 44,492,800    | 貸付有価証券<br>4,200株  |
| 6383 | ダイフク            | 155,300 | 7,170.00  | 1,113,501,000 | 貸付有価証券<br>27,800株 |
| 6387 | サムコ             | 9,900   | 3,620.00  | 35,838,000    | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 6390 | 加藤製作所           | 10,200  | 725.00    | 7,395,000     | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 6393 | 油研工業            | 3,300   | 1,884.00  | 6,217,200     | 貸付有価証券<br>800株    |
| 6395 | タダノ             | 158,900 | 948.00    | 150,637,200   | 貸付有価証券<br>31,100株 |
| 6406 | フジテック           | 110,300 | 3,195.00  | 352,408,500   | 貸付有価証券<br>16,100株 |
| 6407 | C K D           | 83,300  | 1,989.00  | 165,683,700   | 貸付有価証券<br>17,800株 |
| 6412 | 平和              | 100,200 | 2,344.00  | 234,868,800   |                   |
| 6413 | 理想科学工業          | 26,800  | 2,149.00  | 57,593,200    | 貸付有価証券<br>5,700株  |
| 6417 | SANKYO          | 59,200  | 5,160.00  | 305,472,000   | 貸付有価証券<br>4,300株  |
| 6418 | 日本金銭機械          | 33,100  | 1,138.00  | 37,667,800    | 貸付有価証券<br>6,000株  |
| 6419 | マースグループホールディングス | 17,700  | 2,252.00  | 39,860,400    | 貸付有価証券<br>4,500株  |

|      |               |         |          |             |                    |
|------|---------------|---------|----------|-------------|--------------------|
| 6420 | フクシマガリレイ      | 22,200  | 4,270.00 | 94,794,000  |                    |
| 6428 | オーイズミ         | 7,500   | 477.00   | 3,577,500   | 貸付有価証券<br>1,900株   |
| 6430 | ダイコク電機        | 16,500  | 1,991.00 | 32,851,500  | 貸付有価証券<br>3,000株   |
| 6432 | 竹内製作所         | 54,700  | 2,795.00 | 152,886,500 | 貸付有価証券<br>10,100株  |
| 6436 | アマノ           | 85,500  | 2,390.00 | 204,345,000 | 貸付有価証券<br>7,900株   |
| 6440 | J U K I       | 46,700  | 634.00   | 29,607,800  | 貸付有価証券<br>11,400株  |
| 6444 | サンデン          | 29,800  | 213.00   | 6,347,400   | 貸付有価証券<br>9,500株   |
| 6445 | ジャノメ          | 30,500  | 599.00   | 18,269,500  | 貸付有価証券<br>6,600株   |
| 6454 | マックス          | 37,100  | 1,977.00 | 73,346,700  | 貸付有価証券<br>8,000株   |
| 6457 | グローリー         | 78,100  | 2,249.00 | 175,646,900 | 貸付有価証券<br>16,800株  |
| 6458 | 新晃工業          | 30,400  | 1,547.00 | 47,028,800  | 貸付有価証券<br>1,500株   |
| 6459 | 大和冷機工業        | 46,100  | 1,201.00 | 55,366,100  | 貸付有価証券<br>9,800株   |
| 6460 | セガサミーホールディングス | 242,200 | 2,039.00 | 493,845,800 | 貸付有価証券<br>20,300株  |
| 6461 | 日本ピストンリング     | 7,800   | 1,242.00 | 9,687,600   | 貸付有価証券<br>2,600株   |
| 6462 | リケン           | 11,900  | 2,348.00 | 27,941,200  | 貸付有価証券<br>2,800株   |
| 6463 | T P R         | 35,200  | 1,289.00 | 45,372,800  | 貸付有価証券<br>3,100株   |
| 6464 | ツバキ・ナカシマ      | 74,200  | 1,116.00 | 82,807,200  | 貸付有価証券<br>11,400株  |
| 6465 | ホシザキ          | 193,900 | 4,630.00 | 897,757,000 | 貸付有価証券<br>36,200株  |
| 6470 | 大豊工業          | 26,000  | 650.00   | 16,900,000  | 貸付有価証券<br>4,900株   |
| 6471 | 日本精工          | 553,400 | 725.00   | 401,215,000 | 貸付有価証券<br>83,700株  |
| 6472 | N T N         | 593,900 | 271.00   | 160,946,900 | 貸付有価証券<br>102,100株 |
| 6473 | ジェイテクト        | 268,000 | 939.00   | 251,652,000 |                    |
| 6474 | 不二越           | 22,200  | 3,785.00 | 84,027,000  | 貸付有価証券<br>300株     |
| 6480 | 日本トムソン        | 73,800  | 596.00   | 43,984,800  | 貸付有価証券<br>8,100株   |
| 6481 | THK           | 173,800 | 2,705.00 | 470,129,000 | 貸付有価証券<br>34,000株  |
| 6482 | ユーシン精機        | 23,900  | 691.00   | 16,514,900  | 貸付有価証券<br>2,200株   |
| 6485 | 前澤給装工業        | 21,200  | 944.00   | 20,012,800  | 貸付有価証券<br>2,000株   |

|      |               |           |          |                |                    |
|------|---------------|-----------|----------|----------------|--------------------|
| 6486 | イーグル工業        | 33,300    | 1,114.00 | 37,096,200     |                    |
| 6489 | 前澤工業          | 12,900    | 610.00   | 7,869,000      | 貸付有価証券<br>5,100株   |
| 6490 | 日本ピラー工業       | 27,900    | 3,130.00 | 87,327,000     | 貸付有価証券<br>4,400株   |
| 6498 | キッツ           | 110,900   | 809.00   | 89,718,100     | 貸付有価証券<br>28,400株  |
| 6586 | マキタ           | 374,800   | 3,420.00 | 1,281,816,000  |                    |
| 7003 | 三井Ｅ＆Ｓホールディングス | 136,800   | 397.00   | 54,309,600     | 貸付有価証券<br>16,000株  |
| 7004 | 日立造船          | 246,800   | 840.00   | 207,312,000    | 貸付有価証券<br>15,500株  |
| 7011 | 三菱重工業         | 526,800   | 5,117.00 | 2,695,635,600  | 貸付有価証券<br>105,800株 |
| 7013 | ＩＨＩ           | 189,800   | 3,955.00 | 750,659,000    | 貸付有価証券<br>32,000株  |
| 7022 | サノヤスホールディングス  | 24,300    | 128.00   | 3,110,400      | 貸付有価証券<br>5,400株   |
| 7718 | スター精密         | 56,800    | 1,669.00 | 94,799,200     | 貸付有価証券<br>6,900株   |
| 3105 | 日清紡ホールディングス   | 245,200   | 965.00   | 236,618,000    | 貸付有価証券<br>40,000株  |
| 4062 | イビデン          | 172,800   | 5,090.00 | 879,552,000    | 貸付有価証券<br>27,100株  |
| 4902 | コニカミノルタ       | 672,800   | 553.00   | 372,058,400    | 貸付有価証券<br>180,200株 |
| 6448 | ブラザー工業        | 402,500   | 2,001.00 | 805,402,500    | 貸付有価証券<br>70,700株  |
| 6479 | ミネベアミツミ       | 524,000   | 2,222.00 | 1,164,328,000  | 貸付有価証券<br>82,200株  |
| 6501 | 日立製作所         | 1,512,500 | 6,919.00 | 10,464,987,500 | 貸付有価証券<br>112,300株 |
| 6502 | 東芝            | 579,800   | 4,508.00 | 2,613,738,400  |                    |
| 6503 | 三菱電機          | 3,113,500 | 1,405.50 | 4,376,024,250  | 貸付有価証券<br>189,000株 |
| 6504 | 富士電機          | 183,200   | 5,310.00 | 972,792,000    | 貸付有価証券<br>43,000株  |
| 6505 | 東洋電機製造        | 7,100     | 852.00   | 6,049,200      | 貸付有価証券<br>2,600株   |
| 6506 | 安川電機          | 357,000   | 4,870.00 | 1,738,590,000  | 貸付有価証券<br>109,700株 |
| 6507 | シンフォニアテクノロジー  | 33,200    | 1,546.00 | 51,327,200     | 貸付有価証券<br>8,200株   |
| 6508 | 明電舎           | 45,700    | 1,915.00 | 87,515,500     | 貸付有価証券<br>13,000株  |
| 6513 | オリジン          | 4,900     | 1,269.00 | 6,218,100      | 貸付有価証券<br>1,900株   |
| 6516 | 山洋電気          | 13,000    | 6,080.00 | 79,040,000     |                    |
| 6517 | デンヨー          | 22,900    | 1,530.00 | 35,037,000     | 貸付有価証券<br>2,100株   |

|      |                   |         |           |               |                    |
|------|-------------------|---------|-----------|---------------|--------------------|
| 6523 | PHCホールディングス       | 41,800  | 1,571.00  | 65,667,800    | 貸付有価証券<br>3,400株   |
| 6526 | ソシオネクスト           | 31,000  | 7,870.00  | 243,970,000   |                    |
| 6588 | 東芝テック             | 45,000  | 3,675.00  | 165,375,000   | 貸付有価証券<br>3,800株   |
| 6590 | 芝浦メカトロニクス         | 5,800   | 11,050.00 | 64,090,000    | 貸付有価証券<br>300株     |
| 6592 | マブチモーター           | 74,800  | 3,710.00  | 277,508,000   | 貸付有価証券<br>17,800株  |
| 6594 | 日本電産              | 731,600 | 7,171.00  | 5,246,303,600 | 貸付有価証券<br>109,700株 |
| 6615 | ユー・エム・シー・エレクトロニクス | 22,100  | 494.00    | 10,917,400    | 貸付有価証券<br>3,600株   |
| 6616 | トレックス・セミコンダクター    | 14,200  | 2,711.00  | 38,496,200    | 貸付有価証券<br>3,400株   |
| 6617 | 東光高岳              | 18,200  | 2,175.00  | 39,585,000    | 貸付有価証券<br>1,100株   |
| 6619 | ダブル・スコープ          | 98,500  | 1,508.00  | 148,538,000   | 貸付有価証券<br>7,600株   |
| 6622 | ダイヘン              | 27,200  | 4,100.00  | 111,520,000   | 貸付有価証券<br>4,800株   |
| 6630 | ヤーマン              | 58,600  | 1,321.00  | 77,410,600    | 貸付有価証券<br>8,400株   |
| 6632 | JVCケンウッド          | 274,400 | 375.00    | 102,900,000   | 貸付有価証券<br>22,000株  |
| 6638 | ミマキエンジニアリング       | 28,600  | 608.00    | 17,388,800    | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 6640 | I－PEX             | 16,700  | 1,163.00  | 19,422,100    | 貸付有価証券<br>2,600株   |
| 6641 | 日新電機              | 72,200  | 1,329.00  | 95,953,800    | 貸付有価証券<br>5,900株   |
| 6644 | 大崎電気工業            | 71,400  | 538.00    | 38,413,200    | 貸付有価証券<br>5,000株   |
| 6645 | オムロン              | 276,100 | 7,192.00  | 1,985,711,200 | 貸付有価証券<br>58,300株  |
| 6651 | 日東工業              | 40,600  | 2,407.00  | 97,724,200    | 貸付有価証券<br>11,100株  |
| 6652 | I D E C           | 44,500  | 3,060.00  | 136,170,000   | 貸付有価証券<br>2,700株   |
| 6653 | 正興電機製作所           | 7,500   | 932.00    | 6,990,000     | 貸付有価証券<br>1,400株   |
| 6654 | 不二電機工業            | 4,000   | 1,131.00  | 4,524,000     | 貸付有価証券<br>100株     |
| 6674 | ジーエス・ユアサ コーポレーション | 98,900  | 2,265.00  | 224,008,500   | 貸付有価証券<br>18,100株  |
| 6675 | サクサホールディングス       | 5,000   | 1,224.00  | 6,120,000     | 貸付有価証券<br>1,500株   |
| 6676 | メルコホールディングス       | 8,000   | 3,460.00  | 27,680,000    | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 6678 | テクノメディカ           | 7,300   | 1,791.00  | 13,074,300    | 貸付有価証券<br>500株     |

|      |                      |           |           |                |                    |
|------|----------------------|-----------|-----------|----------------|--------------------|
| 6699 | ダイヤモンドエレクトリックホールディング | 9,900     | 1,302.00  | 12,889,800     | 貸付有価証券<br>700株     |
| 6701 | 日本電気                 | 426,100   | 4,640.00  | 1,977,104,000  |                    |
| 6702 | 富士通                  | 300,200   | 18,705.00 | 5,615,241,000  | 貸付有価証券<br>15,000株  |
| 6703 | 沖電気工業                | 136,200   | 730.00    | 99,426,000     | 貸付有価証券<br>30,300株  |
| 6704 | 岩崎通信機                | 8,700     | 731.00    | 6,359,700      | 貸付有価証券<br>3,600株   |
| 6706 | 電気興業                 | 12,100    | 1,941.00  | 23,486,100     | 貸付有価証券<br>1,600株   |
| 6707 | サンケン電気               | 28,000    | 7,110.00  | 199,080,000    | 貸付有価証券<br>3,200株   |
| 6715 | ナカヨ                  | 3,500     | 1,070.00  | 3,745,000      | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 6718 | アイホン                 | 18,300    | 1,894.00  | 34,660,200     | 貸付有価証券<br>3,700株   |
| 6723 | ルネサスエレクトロニクス         | 1,965,600 | 1,325.00  | 2,604,420,000  |                    |
| 6724 | セイコーエプソン             | 401,200   | 1,982.00  | 795,178,400    | 貸付有価証券<br>68,200株  |
| 6727 | ワコム                  | 238,600   | 638.00    | 152,226,800    | 貸付有価証券<br>55,300株  |
| 6728 | アルバック                | 71,600    | 6,060.00  | 433,896,000    | 貸付有価証券<br>13,000株  |
| 6730 | アクセル                 | 8,200     | 1,555.00  | 12,751,000     | 貸付有価証券<br>2,800株   |
| 6737 | E I Z O              | 22,100    | 3,615.00  | 79,891,500     | 貸付有価証券<br>2,700株   |
| 6740 | ジャパンディスプレイ           | 1,156,600 | 43.00     | 49,733,800     | 貸付有価証券<br>163,000株 |
| 6741 | 日本信号                 | 68,600    | 1,042.00  | 71,481,200     | 貸付有価証券<br>3,400株   |
| 6742 | 京三製作所                | 63,100    | 407.00    | 25,681,700     | 貸付有価証券<br>15,300株  |
| 6744 | 能美防災                 | 40,700    | 1,694.00  | 68,945,800     | 貸付有価証券<br>3,300株   |
| 6745 | ホーチキ                 | 22,500    | 1,461.00  | 32,872,500     | 貸付有価証券<br>4,500株   |
| 6748 | 星和電機                 | 7,900     | 436.00    | 3,444,400      | 貸付有価証券<br>2,200株   |
| 6750 | エレコム                 | 72,000    | 1,338.00  | 96,336,000     | 貸付有価証券<br>12,800株  |
| 6752 | パナソニック ホールディングス      | 3,558,500 | 1,197.50  | 4,261,303,750  | 貸付有価証券<br>218,700株 |
| 6753 | シャープ                 | 362,700   | 1,056.00  | 383,011,200    | 貸付有価証券<br>80,900株  |
| 6754 | アンリツ                 | 212,200   | 1,278.00  | 271,191,600    |                    |
| 6755 | 富士通ゼネラル              | 85,400    | 3,600.00  | 307,440,000    | 貸付有価証券<br>20,100株  |
| 6758 | ソニーグループ              | 2,109,900 | 11,515.00 | 24,295,498,500 | 貸付有価証券<br>425,600株 |

|      |               |         |           |               |                   |
|------|---------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| 6762 | TDK           | 477,000 | 4,640.00  | 2,213,280,000 | 貸付有価証券<br>25,800株 |
| 6763 | 帝国通信工業        | 13,600  | 1,456.00  | 19,801,600    | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 6768 | タムラ製作所        | 129,300 | 745.00    | 96,328,500    | 貸付有価証券<br>3,500株  |
| 6770 | アルプスアルパイン     | 269,000 | 1,288.00  | 346,472,000   | 貸付有価証券<br>48,000株 |
| 6771 | 池上通信機         | 6,300   | 592.00    | 3,729,600     | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 6779 | 日本電波工業        | 36,100  | 1,540.00  | 55,594,000    | 貸付有価証券<br>4,000株  |
| 6785 | 鈴木            | 17,700  | 976.00    | 17,275,200    | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 6787 | メイコー          | 32,900  | 2,885.00  | 94,916,500    | 貸付有価証券<br>2,400株  |
| 6788 | 日本トリム         | 6,800   | 2,973.00  | 20,216,400    | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 6789 | ローランド ディー．ジー． | 16,900  | 2,879.00  | 48,655,100    | 貸付有価証券<br>3,400株  |
| 6794 | フォスター電機       | 27,900  | 941.00    | 26,253,900    |                   |
| 6798 | SMK           | 7,200   | 2,457.00  | 17,690,400    | 貸付有価証券<br>1,900株  |
| 6800 | ヨコオ           | 23,900  | 2,225.00  | 53,177,500    | 貸付有価証券<br>800株    |
| 6803 | ティアック         | 32,800  | 121.00    | 3,968,800     | 貸付有価証券<br>4,600株  |
| 6804 | ホシデン          | 72,200  | 1,554.00  | 112,198,800   | 貸付有価証券<br>3,900株  |
| 6806 | ヒロセ電機         | 49,800  | 16,850.00 | 839,130,000   | 貸付有価証券<br>10,300株 |
| 6807 | 日本航空電子工業      | 61,800  | 2,235.00  | 138,123,000   | 貸付有価証券<br>16,100株 |
| 6809 | TOA           | 34,300  | 779.00    | 26,719,700    | 貸付有価証券<br>6,200株  |
| 6810 | マクセル          | 65,400  | 1,432.00  | 93,652,800    | 貸付有価証券<br>12,400株 |
| 6814 | 古野電気          | 39,100  | 940.00    | 36,754,000    | 貸付有価証券<br>8,500株  |
| 6817 | スミダコーポレーション   | 27,600  | 1,398.00  | 38,584,800    | 貸付有価証券<br>3,600株  |
| 6820 | アイコム          | 11,600  | 2,570.00  | 29,812,000    | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 6823 | リオン           | 12,400  | 1,858.00  | 23,039,200    | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 6841 | 横河電機          | 329,600 | 2,254.00  | 742,918,400   | 貸付有価証券<br>61,100株 |
| 6844 | 新電元工業         | 11,500  | 3,290.00  | 37,835,000    | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| 6845 | アズビル          | 208,400 | 3,625.00  | 755,450,000   | 貸付有価証券<br>44,100株 |

|      |             |         |           |                |                   |
|------|-------------|---------|-----------|----------------|-------------------|
| 6848 | 東亜ディーケーケー   | 10,600  | 762.00    | 8,077,200      | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 6849 | 日本光電工業      | 137,800 | 3,425.00  | 471,965,000    | 貸付有価証券<br>26,300株 |
| 6850 | チノー         | 12,400  | 1,868.00  | 23,163,200     | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 6853 | 共和電業        | 18,700  | 336.00    | 6,283,200      | 貸付有価証券<br>5,800株  |
| 6855 | 日本電子材料      | 19,700  | 1,449.00  | 28,545,300     | 貸付有価証券<br>400株    |
| 6856 | 堀場製作所       | 66,400  | 5,900.00  | 391,760,000    | 貸付有価証券<br>8,800株  |
| 6857 | アドバンテスト     | 235,000 | 9,620.00  | 2,260,700,000  | 貸付有価証券<br>32,800株 |
| 6858 | 小野測器        | 7,300   | 395.00    | 2,883,500      | 貸付有価証券<br>3,300株  |
| 6859 | エスベック       | 23,900  | 2,032.00  | 48,564,800     | 貸付有価証券<br>7,100株  |
| 6861 | キーエンス       | 298,400 | 58,970.00 | 17,596,648,000 | 貸付有価証券<br>18,400株 |
| 6866 | 日置電機        | 15,600  | 7,210.00  | 112,476,000    | 貸付有価証券<br>3,100株  |
| 6869 | シスメックス      | 257,300 | 8,633.00  | 2,221,270,900  | 貸付有価証券<br>31,800株 |
| 6871 | 日本マイクロニクス   | 49,100  | 1,403.00  | 68,887,300     | 貸付有価証券<br>9,100株  |
| 6875 | メガチップス      | 24,500  | 2,669.00  | 65,390,500     | 貸付有価証券<br>5,300株  |
| 6877 | OBARA GROUP | 14,000  | 3,695.00  | 51,730,000     | 貸付有価証券<br>4,000株  |
| 6901 | 澤藤電機        | 2,600   | 1,141.00  | 2,966,600      | 貸付有価証券<br>600株    |
| 6904 | 原田工業        | 10,100  | 834.00    | 8,423,400      | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 6905 | コーセル        | 39,800  | 1,085.00  | 43,183,000     | 貸付有価証券<br>9,200株  |
| 6908 | イリソ電子工業     | 27,400  | 4,345.00  | 119,053,000    | 貸付有価証券<br>5,100株  |
| 6914 | オプテックスグループ  | 54,700  | 2,054.00  | 112,353,800    | 貸付有価証券<br>11,300株 |
| 6915 | 千代田インテグレ    | 10,400  | 2,283.00  | 23,743,200     | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 6920 | レーザーテック     | 147,200 | 26,270.00 | 3,866,944,000  | 貸付有価証券<br>7,200株  |
| 6923 | スタンレー電気     | 212,300 | 2,702.00  | 573,634,600    | 貸付有価証券<br>29,700株 |
| 6924 | 岩崎電気        | 9,600   | 2,431.00  | 23,337,600     | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 6925 | ウシオ電機       | 155,800 | 1,737.00  | 270,624,600    | 貸付有価証券<br>25,700株 |
| 6926 | 岡谷電機産業      | 15,300  | 256.00    | 3,916,800      | 貸付有価証券<br>4,800株  |

|      |                  |         |           |               |                   |
|------|------------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| 6927 | ヘリオス テクノ ホールディング | 18,300  | 465.00    | 8,509,500     | 貸付有価証券<br>6,500株  |
| 6928 | エノモト             | 5,900   | 1,778.00  | 10,490,200    | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 6929 | 日本セラミック          | 30,400  | 2,365.00  | 71,896,000    | 貸付有価証券<br>6,500株  |
| 6932 | 遠藤照明             | 9,900   | 764.00    | 7,563,600     | 貸付有価証券<br>1,200株  |
| 6937 | 古河電池             | 22,000  | 1,083.00  | 23,826,000    | 貸付有価証券<br>4,200株  |
| 6938 | 双信電機             | 10,300  | 389.00    | 4,006,700     | 貸付有価証券<br>3,100株  |
| 6941 | 山一電機             | 26,000  | 1,791.00  | 46,566,000    | 貸付有価証券<br>4,600株  |
| 6947 | 図研               | 26,000  | 3,085.00  | 80,210,000    | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 6951 | 日本電子             | 74,700  | 3,860.00  | 288,342,000   | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 6952 | カシオ計算機           | 222,200 | 1,356.00  | 301,303,200   | 貸付有価証券<br>52,800株 |
| 6954 | ファナック            | 292,800 | 22,270.00 | 6,520,656,000 | 貸付有価証券<br>42,100株 |
| 6958 | 日本シイエムケイ         | 63,300  | 497.00    | 31,460,100    | 貸付有価証券<br>4,500株  |
| 6961 | エンプラス            | 8,700   | 3,740.00  | 32,538,000    | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 6962 | 大真空              | 36,300  | 750.00    | 27,225,000    | 貸付有価証券<br>6,400株  |
| 6963 | ローム              | 137,900 | 10,260.00 | 1,414,854,000 | 貸付有価証券<br>19,700株 |
| 6965 | 浜松ホトニクス          | 239,300 | 6,980.00  | 1,670,314,000 | 貸付有価証券<br>31,800株 |
| 6966 | 三井ハイテック          | 30,800  | 6,890.00  | 212,212,000   | 貸付有価証券<br>4,900株  |
| 6967 | 新光電気工業           | 105,500 | 3,760.00  | 396,680,000   | 貸付有価証券<br>11,600株 |
| 6971 | 京セラ              | 463,300 | 6,712.00  | 3,109,669,600 |                   |
| 6976 | 太陽誘電             | 145,200 | 4,415.00  | 641,058,000   | 貸付有価証券<br>19,600株 |
| 6981 | 村田製作所            | 904,600 | 7,469.00  | 6,756,457,400 | 貸付有価証券<br>49,600株 |
| 6986 | 双葉電子工業           | 56,800  | 557.00    | 31,637,600    | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| 6989 | 北陸電気工業           | 8,000   | 1,246.00  | 9,968,000     | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| 6996 | ニチコン             | 60,900  | 1,273.00  | 77,525,700    | 貸付有価証券<br>21,100株 |
| 6997 | 日本ケミコン           | 29,500  | 1,652.00  | 48,734,000    | 貸付有価証券<br>3,300株  |
| 6999 | K O A            | 45,200  | 1,973.00  | 89,179,600    | 貸付有価証券<br>3,300株  |



|      |                |            |           |                |                      |
|------|----------------|------------|-----------|----------------|----------------------|
| 7244 | 市光工業           | 43,000     | 377.00    | 16,211,000     | 貸付有価証券<br>5,500株     |
| 7276 | 小糸製作所          | 358,700    | 2,092.00  | 750,400,400    |                      |
| 7280 | ミツバ            | 55,900     | 485.00    | 27,111,500     | 貸付有価証券<br>13,200株    |
| 7735 | ＳＣＲＥＥＮホールディングス | 51,000     | 9,600.00  | 489,600,000    |                      |
| 7739 | キャノン電子         | 33,000     | 1,564.00  | 51,612,000     | 貸付有価証券<br>4,600株     |
| 7751 | キャノン           | 1,636,500  | 2,945.50  | 4,820,310,750  | 貸付有価証券<br>308,300株   |
| 7752 | リコー            | 747,900    | 1,012.00  | 756,874,800    | 貸付有価証券<br>170,600株   |
| 7965 | 象印マホービン        | 89,100     | 1,596.00  | 142,203,600    | 貸付有価証券<br>19,000株    |
| 7999 | MUTOHホールディングス  | 2,700      | 1,628.00  | 4,395,600      | 貸付有価証券<br>900株       |
| 8035 | 東京エレクトロン       | 210,400    | 45,540.00 | 9,581,616,000  |                      |
| 9880 | イノテック          | 19,900     | 1,355.00  | 26,964,500     | 貸付有価証券<br>3,900株     |
| 3116 | トヨタ紡織          | 125,600    | 1,891.00  | 237,509,600    | 貸付有価証券<br>13,000株    |
| 3526 | 芦森工業           | 4,100      | 1,408.00  | 5,772,800      | 貸付有価証券<br>1,600株     |
| 5949 | ユニプレス          | 53,500     | 774.00    | 41,409,000     | 貸付有価証券<br>13,700株    |
| 6201 | 豊田自動織機         | 218,100    | 7,970.00  | 1,738,257,000  | 貸付有価証券<br>53,000株    |
| 6455 | モリタホールディングス    | 52,300     | 1,171.00  | 61,243,300     | 貸付有価証券<br>1,800株     |
| 6584 | 三櫻工業           | 45,500     | 645.00    | 29,347,500     | 貸付有価証券<br>9,000株     |
| 6902 | デンソー           | 615,200    | 6,945.00  | 4,272,564,000  | 貸付有価証券<br>38,000株    |
| 6995 | 東海理化電機製作所      | 84,100     | 1,465.00  | 123,206,500    | 貸付有価証券<br>15,600株    |
| 7012 | 川崎重工業          | 224,800    | 2,955.00  | 664,284,000    | 貸付有価証券<br>49,100株    |
| 7014 | 名村造船所          | 55,400     | 379.00    | 20,996,600     | 貸付有価証券<br>21,000株    |
| 7102 | 日本車輛製造         | 11,500     | 1,978.00  | 22,747,000     | 貸付有価証券<br>1,100株     |
| 7105 | 三菱ロジスネクスト      | 47,600     | 705.00    | 33,558,000     | 貸付有価証券<br>4,000株     |
| 7122 | 近畿車輛           | 3,200      | 1,078.00  | 3,449,600      | 貸付有価証券<br>800株       |
| 7201 | 日産自動車          | 4,237,000  | 450.10    | 1,907,073,700  | 貸付有価証券<br>477,300株   |
| 7202 | いすゞ自動車         | 867,200    | 1,591.00  | 1,379,715,200  | 貸付有価証券<br>183,300株   |
| 7203 | トヨタ自動車         | 16,378,100 | 1,893.00  | 31,003,743,300 | 貸付有価証券<br>1,223,600株 |

|      |              |           |          |               |                    |
|------|--------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 7205 | 日野自動車        | 384,500   | 529.00   | 203,400,500   | 貸付有価証券<br>55,300株  |
| 7211 | 三菱自動車工業      | 1,163,600 | 501.00   | 582,963,600   | 貸付有価証券<br>210,200株 |
| 7212 | エフテック        | 13,700    | 530.00   | 7,261,000     | 貸付有価証券<br>5,300株   |
| 7213 | レシップホールディングス | 8,500     | 463.00   | 3,935,500     | 貸付有価証券<br>2,300株   |
| 7214 | GMB          | 3,900     | 717.00   | 2,796,300     | 貸付有価証券<br>1,100株   |
| 7215 | ファルテック       | 3,700     | 600.00   | 2,220,000     | 貸付有価証券<br>1,000株   |
| 7220 | 武蔵精密工業       | 72,900    | 1,727.00 | 125,898,300   | 貸付有価証券<br>9,900株   |
| 7222 | 日産車体         | 52,600    | 841.00   | 44,236,600    | 貸付有価証券<br>12,500株  |
| 7224 | 新明和工業        | 93,700    | 1,047.00 | 98,103,900    | 貸付有価証券<br>7,000株   |
| 7226 | 極東開発工業       | 52,400    | 1,470.00 | 77,028,000    | 貸付有価証券<br>5,100株   |
| 7231 | トピー工業        | 24,200    | 1,649.00 | 39,905,800    | 貸付有価証券<br>5,600株   |
| 7236 | ティラド         | 7,500     | 2,728.00 | 20,460,000    | 貸付有価証券<br>2,500株   |
| 7238 | 曙ブレーキ工業      | 182,000   | 152.00   | 27,664,000    | 貸付有価証券<br>41,300株  |
| 7239 | タチエス         | 47,200    | 1,180.00 | 55,696,000    | 貸付有価証券<br>11,400株  |
| 7240 | NOK          | 115,900   | 1,202.00 | 139,311,800   | 貸付有価証券<br>7,700株   |
| 7241 | フタバ産業        | 79,900    | 382.00   | 30,521,800    | 貸付有価証券<br>7,900株   |
| 7242 | K Y B        | 28,700    | 3,645.00 | 104,611,500   | 貸付有価証券<br>2,300株   |
| 7245 | 大同メタル工業      | 58,300    | 490.00   | 28,567,000    | 貸付有価証券<br>8,400株   |
| 7246 | プレス工業        | 133,200   | 439.00   | 58,474,800    | 貸付有価証券<br>32,200株  |
| 7247 | ミクニ          | 24,900    | 331.00   | 8,241,900     | 貸付有価証券<br>7,700株   |
| 7250 | 太平洋工業        | 68,400    | 1,050.00 | 71,820,000    | 貸付有価証券<br>9,100株   |
| 7256 | 河西工業         | 26,300    | 150.00   | 3,945,000     | 貸付有価証券<br>9,400株   |
| 7259 | アイシン         | 230,100   | 3,735.00 | 859,423,500   | 貸付有価証券<br>12,000株  |
| 7261 | マツダ          | 986,600   | 1,007.00 | 993,506,200   | 貸付有価証券<br>59,600株  |
| 7266 | 今仙電機製作所      | 14,100    | 695.00   | 9,799,500     | 貸付有価証券<br>7,900株   |
| 7267 | 本田技研工業       | 2,424,600 | 3,138.00 | 7,608,394,800 | 貸付有価証券<br>129,900株 |

|      |             |         |           |               |                    |
|------|-------------|---------|-----------|---------------|--------------------|
| 7269 | スズキ         | 547,800 | 4,776.00  | 2,616,292,800 | 貸付有価証券<br>126,800株 |
| 7270 | S U B A R U | 943,700 | 2,103.00  | 1,984,601,100 |                    |
| 7271 | 安永          | 8,600   | 664.00    | 5,710,400     | 貸付有価証券<br>2,800株   |
| 7272 | ヤマハ発動機      | 468,800 | 3,165.00  | 1,483,752,000 | 貸付有価証券<br>85,400株  |
| 7277 | T B K       | 21,600  | 247.00    | 5,335,200     | 貸付有価証券<br>7,700株   |
| 7278 | エクセディ       | 48,800  | 1,650.00  | 80,520,000    | 貸付有価証券<br>4,300株   |
| 7282 | 豊田合成        | 87,000  | 2,101.00  | 182,787,000   |                    |
| 7283 | 愛三工業        | 49,200  | 729.00    | 35,866,800    | 貸付有価証券<br>3,300株   |
| 7284 | 盟和産業        | 3,100   | 934.00    | 2,895,400     | 貸付有価証券<br>700株     |
| 7291 | 日本プラスト      | 15,500  | 416.00    | 6,448,000     | 貸付有価証券<br>5,300株   |
| 7294 | ヨロズ         | 27,900  | 723.00    | 20,171,700    | 貸付有価証券<br>3,500株   |
| 7296 | エフ・シー・シー    | 52,800  | 1,409.00  | 74,395,200    | 貸付有価証券<br>6,100株   |
| 7309 | シマノ         | 122,000 | 23,140.00 | 2,823,080,000 | 貸付有価証券<br>4,900株   |
| 7313 | テイ・エス テック   | 136,500 | 1,583.00  | 216,079,500   | 貸付有価証券<br>34,000株  |
| 7408 | ジャムコ        | 12,500  | 1,452.00  | 18,150,000    | 貸付有価証券<br>3,000株   |
| 4543 | テルモ         | 931,900 | 3,825.00  | 3,564,517,500 | 貸付有価証券<br>13,200株  |
| 5187 | クリエートメディック  | 6,500   | 878.00    | 5,707,000     | 貸付有価証券<br>1,800株   |
| 6376 | 日機装         | 74,600  | 1,007.00  | 75,122,200    | 貸付有価証券<br>17,800株  |
| 7600 | 日本エム・ディ・エム  | 17,700  | 875.00    | 15,487,500    | 貸付有価証券<br>2,000株   |
| 7701 | 島津製作所       | 363,300 | 3,970.00  | 1,442,301,000 | 貸付有価証券<br>91,100株  |
| 7702 | J M S       | 27,600  | 500.00    | 13,800,000    | 貸付有価証券<br>4,100株   |
| 7709 | クボテック       | 4,600   | 214.00    | 984,400       | 貸付有価証券<br>1,600株   |
| 7715 | 長野計器        | 21,700  | 1,134.00  | 24,607,800    | 貸付有価証券<br>5,500株   |
| 7717 | ブイ・テクノロジー   | 14,600  | 2,710.00  | 39,566,000    | 貸付有価証券<br>2,500株   |
| 7721 | 東京計器        | 22,900  | 1,298.00  | 29,724,200    | 貸付有価証券<br>3,900株   |
| 7723 | 愛知時計電機      | 11,600  | 1,350.00  | 15,660,000    | 貸付有価証券<br>900株     |
| 7725 | インターアクション   | 18,000  | 1,530.00  | 27,540,000    | 貸付有価証券<br>4,200株   |

|      |                   |           |           |               |                    |
|------|-------------------|-----------|-----------|---------------|--------------------|
| 7727 | オーバル              | 19,200    | 438.00    | 8,409,600     | 貸付有価証券<br>6,400株   |
| 7729 | 東京精密              | 65,400    | 4,525.00  | 295,935,000   | 貸付有価証券<br>4,600株   |
| 7730 | マニー               | 131,200   | 1,919.00  | 251,772,800   |                    |
| 7731 | ニコン               | 463,700   | 1,275.00  | 591,217,500   | 貸付有価証券<br>63,700株  |
| 7732 | トプコン              | 157,000   | 1,635.00  | 256,695,000   | 貸付有価証券<br>28,400株  |
| 7733 | オリンパス             | 1,864,600 | 2,457.00  | 4,581,322,200 | 貸付有価証券<br>283,900株 |
| 7734 | 理研計器              | 18,500    | 4,590.00  | 84,915,000    | 貸付有価証券<br>3,900株   |
| 7740 | タムロン              | 22,300    | 3,125.00  | 69,687,500    | 貸付有価証券<br>4,800株   |
| 7741 | HOYA              | 637,100   | 14,565.00 | 9,279,361,500 | 貸付有価証券<br>23,200株  |
| 7743 | シード               | 10,000    | 519.00    | 5,190,000     | 貸付有価証券<br>1,900株   |
| 7744 | ノーリツ銅機            | 28,300    | 2,391.00  | 67,665,300    | 貸付有価証券<br>4,100株   |
| 7745 | A & Dホロンホールディングス  | 43,500    | 1,052.00  | 45,762,000    |                    |
| 7747 | 朝日インテック           | 393,900   | 2,298.00  | 905,182,200   | 貸付有価証券<br>60,900株  |
| 7762 | シチズン時計            | 327,900   | 611.00    | 200,346,900   | 貸付有価証券<br>36,400株  |
| 7769 | リズム               | 6,700     | 1,544.00  | 10,344,800    | 貸付有価証券<br>1,400株   |
| 7775 | 大研医器              | 17,000    | 461.00    | 7,837,000     | 貸付有価証券<br>4,700株   |
| 7780 | メニコン              | 102,400   | 2,843.00  | 291,123,200   | 貸付有価証券<br>17,400株  |
| 7782 | シンシア              | 1,800     | 499.00    | 898,200       | 貸付有価証券<br>900株     |
| 7979 | 松風                | 13,500    | 2,353.00  | 31,765,500    | 貸付有価証券<br>3,100株   |
| 8050 | セイコーグループ          | 46,200    | 2,884.00  | 133,240,800   | 貸付有価証券<br>10,100株  |
| 8086 | ニプロ               | 248,600   | 1,041.00  | 258,792,600   | 貸付有価証券<br>39,100株  |
| 7795 | KYORITSU          | 29,400    | 125.00    | 3,675,000     | 貸付有価証券<br>10,600株  |
| 7811 | 中本パックス            | 6,000     | 1,585.00  | 9,510,000     | 貸付有価証券<br>1,900株   |
| 7816 | スノーピーク            | 51,100    | 2,111.00  | 107,872,100   | 貸付有価証券<br>5,000株   |
| 7817 | パラマウントベッドホールディングス | 68,900    | 2,503.00  | 172,456,700   | 貸付有価証券<br>14,800株  |
| 7818 | トランザクション          | 22,900    | 1,556.00  | 35,632,400    | 貸付有価証券<br>800株     |
| 7819 | 粧美堂               | 5,300     | 353.00    | 1,870,900     | 貸付有価証券<br>1,500株   |

|      |                  |         |          |               |                   |
|------|------------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 7820 | ニホンフラッシュ         | 28,000  | 918.00   | 25,704,000    | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 7821 | 前田工織             | 32,400  | 3,295.00 | 106,758,000   | 貸付有価証券<br>6,900株  |
| 7822 | 永大産業             | 23,400  | 225.00   | 5,265,000     | 貸付有価証券<br>9,800株  |
| 7823 | アートネイチャー         | 30,700  | 756.00   | 23,209,200    | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 7832 | バンダイナムコホールディングス  | 272,400 | 8,640.00 | 2,353,536,000 | 貸付有価証券<br>73,600株 |
| 7833 | アイフィスジャパン        | 5,500   | 624.00   | 3,432,000     | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 7839 | SHOEI            | 31,500  | 5,280.00 | 166,320,000   | 貸付有価証券<br>3,800株  |
| 7840 | フランスベッドホールディングス  | 36,900  | 979.00   | 36,125,100    | 貸付有価証券<br>8,100株  |
| 7846 | パイロットコーポレーション    | 46,600  | 4,595.00 | 214,127,000   | 貸付有価証券<br>7,700株  |
| 7856 | 萩原工業             | 19,900  | 1,179.00 | 23,462,100    | 貸付有価証券<br>3,300株  |
| 7864 | フジシールインターナショナル   | 60,400  | 1,628.00 | 98,331,200    | 貸付有価証券<br>13,600株 |
| 7867 | タカラトミー           | 137,700 | 1,258.00 | 173,226,600   | 貸付有価証券<br>30,300株 |
| 7868 | 広済堂ホールディングス      | 13,300  | 1,917.00 | 25,496,100    | 貸付有価証券<br>4,500株  |
| 7872 | エステールホールディングス    | 4,600   | 628.00   | 2,888,800     | 貸付有価証券<br>600株    |
| 7885 | タカノ              | 7,300   | 675.00   | 4,927,500     | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| 7893 | プロネクサス           | 24,700  | 968.00   | 23,909,600    | 貸付有価証券<br>4,800株  |
| 7897 | ホクシン             | 15,100  | 156.00   | 2,355,600     | 貸付有価証券<br>4,600株  |
| 7898 | ウッドワン            | 6,500   | 929.00   | 6,038,500     | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 7905 | 大建工業             | 18,100  | 2,190.00 | 39,639,000    | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| 7911 | 凸版印刷             | 390,100 | 2,093.00 | 816,479,300   | 貸付有価証券<br>49,600株 |
| 7912 | 大日本印刷            | 353,900 | 3,130.00 | 1,107,707,000 | 貸付有価証券<br>86,600株 |
| 7914 | 共同印刷             | 8,400   | 2,847.00 | 23,914,800    | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 7915 | NISSHA           | 56,700  | 1,886.00 | 106,936,200   | 貸付有価証券<br>13,100株 |
| 7916 | 光村印刷             | 1,700   | 1,168.00 | 1,985,600     | 貸付有価証券<br>400株    |
| 7921 | TAKARA & COMPANY | 20,500  | 2,071.00 | 42,455,500    | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| 7936 | アシックス            | 275,300 | 2,971.00 | 817,916,300   | 貸付有価証券<br>46,200株 |

|      |              |           |          |                |                    |
|------|--------------|-----------|----------|----------------|--------------------|
| 7937 | ツツミ          | 6,700     | 1,919.00 | 12,857,300     | 貸付有価証券<br>2,300株   |
| 7944 | ローランド        | 21,900    | 3,590.00 | 78,621,000     | 貸付有価証券<br>4,700株   |
| 7949 | 小松ウオール工業     | 10,900    | 1,850.00 | 20,165,000     | 貸付有価証券<br>600株     |
| 7951 | ヤマハ          | 188,000   | 5,000.00 | 940,000,000    | 貸付有価証券<br>15,200株  |
| 7952 | 河合楽器製作所      | 8,000     | 2,589.00 | 20,712,000     |                    |
| 7955 | クリナップ        | 33,400    | 643.00   | 21,476,200     |                    |
| 7956 | ビジョン         | 190,000   | 2,047.00 | 388,930,000    | 貸付有価証券<br>26,800株  |
| 7961 | 兼松サステック      | 1,400     | 1,598.00 | 2,237,200      | 貸付有価証券<br>200株     |
| 7962 | キングジム        | 26,300    | 899.00   | 23,643,700     | 貸付有価証券<br>5,100株   |
| 7966 | リンテック        | 59,900    | 2,195.00 | 131,480,500    | 貸付有価証券<br>16,600株  |
| 7972 | イトーキ         | 61,100    | 690.00   | 42,159,000     | 貸付有価証券<br>13,700株  |
| 7974 | 任天堂          | 1,883,100 | 5,635.00 | 10,611,268,500 | 貸付有価証券<br>268,500株 |
| 7976 | 三菱鉛筆         | 42,400    | 1,426.00 | 60,462,400     | 貸付有価証券<br>10,900株  |
| 7981 | タカラスタANDARD  | 57,700    | 1,388.00 | 80,087,600     | 貸付有価証券<br>3,300株   |
| 7984 | コクヨ          | 143,600   | 1,829.00 | 262,644,400    | 貸付有価証券<br>21,200株  |
| 7987 | ナカバヤシ        | 32,100    | 488.00   | 15,664,800     | 貸付有価証券<br>7,800株   |
| 7990 | グローブライド      | 24,100    | 2,619.00 | 63,117,900     | 貸付有価証券<br>1,600株   |
| 7994 | オカムラ         | 89,800    | 1,415.00 | 127,067,000    | 貸付有価証券<br>6,700株   |
| 8022 | 美津濃          | 29,600    | 2,802.00 | 82,939,200     | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 9501 | 東京電力ホールディングス | 2,688,700 | 470.00   | 1,263,689,000  | 貸付有価証券<br>353,400株 |
| 9502 | 中部電力         | 1,099,100 | 1,278.00 | 1,404,649,800  | 貸付有価証券<br>193,200株 |
| 9503 | 関西電力         | 1,151,800 | 1,226.00 | 1,412,106,800  | 貸付有価証券<br>242,000株 |
| 9504 | 中国電力         | 475,000   | 673.00   | 319,675,000    | 貸付有価証券<br>61,200株  |
| 9505 | 北陸電力         | 281,500   | 514.00   | 144,691,000    | 貸付有価証券<br>60,000株  |
| 9506 | 東北電力         | 729,200   | 660.00   | 481,272,000    | 貸付有価証券<br>157,400株 |
| 9507 | 四国電力         | 254,600   | 721.00   | 183,566,600    | 貸付有価証券<br>17,800株  |
| 9508 | 九州電力         | 687,600   | 715.00   | 491,634,000    | 貸付有価証券<br>73,700株  |

|      |               |         |           |               |                    |
|------|---------------|---------|-----------|---------------|--------------------|
| 9509 | 北海道電力         | 288,200 | 455.00    | 131,131,000   |                    |
| 9511 | 沖縄電力          | 69,800  | 1,039.00  | 72,522,200    | 貸付有価証券<br>13,800株  |
| 9513 | 電源開発          | 224,600 | 2,067.00  | 464,248,200   |                    |
| 9514 | エフオン          | 21,700  | 516.00    | 11,197,200    | 貸付有価証券<br>3,000株   |
| 9517 | イーレックス        | 52,900  | 2,388.00  | 126,325,200   | 貸付有価証券<br>1,800株   |
| 9519 | レノバ           | 79,300  | 2,254.00  | 178,742,200   | 貸付有価証券<br>7,300株   |
| 9531 | 東京瓦斯          | 630,600 | 2,527.00  | 1,593,526,200 | 貸付有価証券<br>130,400株 |
| 9532 | 大阪瓦斯          | 604,200 | 2,036.00  | 1,230,151,200 | 貸付有価証券<br>85,900株  |
| 9533 | 東邦瓦斯          | 117,400 | 2,366.00  | 277,768,400   | 貸付有価証券<br>4,100株   |
| 9534 | 北海道瓦斯         | 17,800  | 1,667.00  | 29,672,600    | 貸付有価証券<br>1,000株   |
| 9535 | 広島ガス          | 62,900  | 341.00    | 21,448,900    | 貸付有価証券<br>12,700株  |
| 9536 | 西部ガスホールディングス  | 28,000  | 1,738.00  | 48,664,000    | 貸付有価証券<br>2,900株   |
| 9543 | 静岡ガス          | 68,000  | 1,069.00  | 72,692,000    | 貸付有価証券<br>6,500株   |
| 9551 | メタウォーター       | 37,300  | 1,674.00  | 62,440,200    | 貸付有価証券<br>6,600株   |
| 2384 | S B Sホールディングス | 26,600  | 2,934.00  | 78,044,400    | 貸付有価証券<br>3,800株   |
| 9001 | 東武鉄道          | 327,600 | 3,045.00  | 997,542,000   | 貸付有価証券<br>68,100株  |
| 9003 | 相鉄ホールディングス    | 98,500  | 2,211.00  | 217,783,500   | 貸付有価証券<br>24,400株  |
| 9005 | 東急            | 836,400 | 1,656.00  | 1,385,078,400 | 貸付有価証券<br>167,500株 |
| 9006 | 京浜急行電鉄        | 338,300 | 1,352.00  | 457,381,600   | 貸付有価証券<br>37,100株  |
| 9007 | 小田急電鉄         | 452,100 | 1,685.00  | 761,788,500   | 貸付有価証券<br>96,000株  |
| 9008 | 京王電鉄          | 157,700 | 4,665.00  | 735,670,500   | 貸付有価証券<br>24,100株  |
| 9009 | 京成電鉄          | 192,300 | 3,780.00  | 726,894,000   | 貸付有価証券<br>8,900株   |
| 9010 | 富士急行          | 36,700  | 4,580.00  | 168,086,000   | 貸付有価証券<br>10,500株  |
| 9020 | 東日本旅客鉄道       | 505,900 | 7,323.00  | 3,704,705,700 | 貸付有価証券<br>34,800株  |
| 9021 | 西日本旅客鉄道       | 381,000 | 5,559.00  | 2,117,979,000 | 貸付有価証券<br>55,600株  |
| 9022 | 東海旅客鉄道        | 229,800 | 16,005.00 | 3,677,949,000 | 貸付有価証券<br>52,600株  |
| 9024 | 西武ホールディングス    | 360,800 | 1,480.00  | 533,984,000   |                    |

|      |                     |         |          |               |                    |
|------|---------------------|---------|----------|---------------|--------------------|
| 9025 | 鴻池運輸                | 50,800  | 1,500.00 | 76,200,000    | 貸付有価証券<br>2,000株   |
| 9031 | 西日本鉄道               | 79,700  | 2,388.00 | 190,323,600   | 貸付有価証券<br>7,600株   |
| 9037 | ハマキョウレックス           | 23,300  | 3,115.00 | 72,579,500    | 貸付有価証券<br>1,800株   |
| 9039 | サカイ引越センター           | 14,200  | 4,375.00 | 62,125,000    | 貸付有価証券<br>1,000株   |
| 9041 | 近鉄グループホールディングス      | 297,700 | 4,225.00 | 1,257,782,500 | 貸付有価証券<br>60,500株  |
| 9042 | 阪急阪神ホールディングス        | 397,100 | 3,890.00 | 1,544,719,000 | 貸付有価証券<br>79,700株  |
| 9044 | 南海電気鉄道              | 142,300 | 2,844.00 | 404,701,200   |                    |
| 9045 | 京阪ホールディングス          | 123,100 | 3,600.00 | 443,160,000   | 貸付有価証券<br>26,800株  |
| 9046 | 神戸電鉄                | 8,100   | 3,235.00 | 26,203,500    | 貸付有価証券<br>200株     |
| 9048 | 名古屋鉄道               | 329,100 | 2,144.00 | 705,590,400   | 貸付有価証券<br>52,200株  |
| 9052 | 山陽電気鉄道              | 22,400  | 2,156.00 | 48,294,400    | 貸付有価証券<br>1,600株   |
| 9055 | アルプス物流              | 23,700  | 1,174.00 | 27,823,800    | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 9064 | ヤマトホールディングス         | 381,300 | 2,094.00 | 798,442,200   | 貸付有価証券<br>108,600株 |
| 9065 | 山九                  | 75,800  | 4,805.00 | 364,219,000   | 貸付有価証券<br>17,400株  |
| 9067 | 丸運                  | 9,700   | 220.00   | 2,134,000     | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 9068 | 丸全昭和運輸              | 18,400  | 2,995.00 | 55,108,000    | 貸付有価証券<br>4,600株   |
| 9069 | センコーグループホールディングス    | 157,700 | 975.00   | 153,757,500   | 貸付有価証券<br>12,000株  |
| 9070 | トナミホールディングス         | 6,500   | 3,610.00 | 23,465,000    | 貸付有価証券<br>600株     |
| 9072 | ニッコンホールディングス        | 95,300  | 2,425.00 | 231,102,500   | 貸付有価証券<br>3,000株   |
| 9074 | 日本石油輸送              | 2,200   | 2,228.00 | 4,901,600     | 貸付有価証券<br>700株     |
| 9075 | 福山通運                | 22,700  | 3,080.00 | 69,916,000    | 貸付有価証券<br>7,400株   |
| 9076 | セイノーホールディングス        | 185,300 | 1,188.00 | 220,136,400   | 貸付有価証券<br>52,600株  |
| 9078 | エスライン               | 5,500   | 805.00   | 4,427,500     | 貸付有価証券<br>2,100株   |
| 9081 | 神奈川中央交通             | 8,400   | 3,265.00 | 27,426,000    | 貸付有価証券<br>1,800株   |
| 9086 | 日立物流                | 18,800  | 8,900.00 | 167,320,000   |                    |
| 9090 | A Z－C O M丸和ホールディングス | 71,900  | 1,611.00 | 115,830,900   | 貸付有価証券<br>8,800株   |
| 9099 | C & F ロジホールディングス    | 28,700  | 1,212.00 | 34,784,400    | 貸付有価証券<br>5,300株   |



|      |                                        |         |          |               |                    |
|------|----------------------------------------|---------|----------|---------------|--------------------|
| 9142 | 九州旅客鉄道                                 | 210,500 | 2,936.00 | 618,028,000   | 貸付有価証券<br>33,000株  |
| 9143 | S Gホールディングス                            | 571,400 | 1,868.00 | 1,067,375,200 | 貸付有価証券<br>97,000株  |
| 9147 | N I P P O N   E X P R E S S ホール<br>ディン | 111,200 | 7,380.00 | 820,656,000   | 貸付有価証券<br>5,000株   |
| 9101 | 日本郵船                                   | 796,700 | 3,165.00 | 2,521,555,500 | 貸付有価証券<br>107,700株 |
| 9104 | 商船三井                                   | 524,900 | 3,285.00 | 1,724,296,500 | 貸付有価証券<br>108,900株 |
| 9107 | 川崎汽船                                   | 253,600 | 2,754.00 | 698,414,400   | 貸付有価証券<br>53,400株  |
| 9110 | N S ユナイテッド海運                           | 16,000  | 3,895.00 | 62,320,000    | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 9115 | 明治海運                                   | 19,200  | 636.00   | 12,211,200    | 貸付有価証券<br>8,700株   |
| 9119 | 飯野海運                                   | 109,300 | 905.00   | 98,916,500    | 貸付有価証券<br>19,800株  |
| 9130 | 共栄タンカー                                 | 3,600   | 942.00   | 3,391,200     | 貸付有価証券<br>1,600株   |
| 9308 | 乾汽船                                    | 37,800  | 1,993.00 | 75,335,400    | 貸付有価証券<br>4,300株   |
| 9201 | 日本航空                                   | 731,400 | 2,760.00 | 2,018,664,000 | 貸付有価証券<br>119,200株 |
| 9202 | A N A ホールディングス                         | 810,300 | 2,893.00 | 2,344,197,900 | 貸付有価証券<br>155,100株 |
| 9232 | パスコ                                    | 3,900   | 1,413.00 | 5,510,700     | 貸付有価証券<br>1,000株   |
| 9058 | トランコム                                  | 8,600   | 7,670.00 | 65,962,000    | 貸付有価証券<br>300株     |
| 9066 | 日新                                     | 22,600  | 2,182.00 | 49,313,200    | 貸付有価証券<br>1,000株   |
| 9301 | 三菱倉庫                                   | 64,000  | 2,969.00 | 190,016,000   | 貸付有価証券<br>6,100株   |
| 9302 | 三井倉庫ホールディングス                           | 27,800  | 3,680.00 | 102,304,000   | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 9303 | 住友倉庫                                   | 81,700  | 1,973.00 | 161,194,100   | 貸付有価証券<br>21,500株  |
| 9304 | 澁澤倉庫                                   | 11,900  | 2,080.00 | 24,752,000    | 貸付有価証券<br>3,400株   |
| 9306 | 東陽倉庫                                   | 28,800  | 268.00   | 7,718,400     | 貸付有価証券<br>12,600株  |
| 9310 | 日本トランスシティ                              | 59,900  | 517.00   | 30,968,300    |                    |
| 9312 | ケイヒン                                   | 3,500   | 1,491.00 | 5,218,500     | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 9319 | 中央倉庫                                   | 14,400  | 959.00   | 13,809,600    | 貸付有価証券<br>900株     |
| 9322 | 川西倉庫                                   | 3,700   | 994.00   | 3,677,800     | 貸付有価証券<br>1,400株   |
| 9324 | 安田倉庫                                   | 20,300  | 942.00   | 19,122,600    | 貸付有価証券<br>1,600株   |

|      |                   |         |          |               |                    |
|------|-------------------|---------|----------|---------------|--------------------|
| 9325 | ファイブホールディングス      | 4,300   | 905.00   | 3,891,500     | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 9351 | 東洋埠頭              | 5,700   | 1,274.00 | 7,261,800     | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 9364 | 上組                | 142,800 | 2,653.00 | 378,848,400   | 貸付有価証券<br>14,700株  |
| 9366 | サンリツ              | 5,200   | 730.00   | 3,796,000     | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 9368 | キムラユニティー          | 10,600  | 892.00   | 9,455,200     | 貸付有価証券<br>2,600株   |
| 9369 | キューソー流通システム       | 11,800  | 903.00   | 10,655,400    | 貸付有価証券<br>3,800株   |
| 9380 | 東海運               | 11,500  | 283.00   | 3,254,500     | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 9381 | エーアイテイー           | 18,700  | 1,472.00 | 27,526,400    | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 9384 | 内外トランスライン         | 10,700  | 2,134.00 | 22,833,800    | 貸付有価証券<br>400株     |
| 9386 | 日本コンセプト           | 9,300   | 1,528.00 | 14,210,400    | 貸付有価証券<br>600株     |
| 1973 | NECネットエスアイ        | 99,900  | 1,763.00 | 176,123,700   | 貸付有価証券<br>20,700株  |
| 2307 | クロスキャット           | 17,100  | 1,544.00 | 26,402,400    | 貸付有価証券<br>3,200株   |
| 2317 | システナ              | 502,900 | 407.00   | 204,680,300   | 貸付有価証券<br>111,600株 |
| 2326 | デジタルアーツ           | 18,900  | 5,660.00 | 106,974,000   | 貸付有価証券<br>3,100株   |
| 2327 | 日鉄ソリューションズ        | 51,000  | 3,350.00 | 170,850,000   | 貸付有価証券<br>10,000株  |
| 2335 | キューブシステム          | 17,800  | 1,083.00 | 19,277,400    | 貸付有価証券<br>3,300株   |
| 2359 | コア                | 13,200  | 1,502.00 | 19,826,400    | 貸付有価証券<br>2,700株   |
| 2477 | 手間いらず             | 5,100   | 5,110.00 | 26,061,000    | 貸付有価証券<br>800株     |
| 3031 | ラクーンホールディングス      | 29,700  | 1,172.00 | 34,808,400    | 貸付有価証券<br>2,700株   |
| 3040 | ソリトンシステムズ         | 15,400  | 1,159.00 | 17,848,600    | 貸付有価証券<br>3,300株   |
| 3371 | ソフトクリエイイトホールディングス | 12,300  | 3,350.00 | 41,205,000    | 貸付有価証券<br>3,100株   |
| 3626 | T I S             | 336,200 | 3,735.00 | 1,255,707,000 | 貸付有価証券<br>43,500株  |
| 3627 | J N Sホールディングス     | 9,700   | 332.00   | 3,220,400     | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 3632 | グリー               | 160,400 | 698.00   | 111,959,200   | 貸付有価証券<br>48,400株  |
| 3633 | GMOペパボ            | 4,300   | 1,889.00 | 8,122,700     | 貸付有価証券<br>700株     |
| 3635 | コーエーテクモホールディングス   | 187,400 | 2,434.00 | 456,131,600   | 貸付有価証券<br>23,000株  |

|      |                  |         |          |               |                   |
|------|------------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 3636 | 三菱総合研究所          | 14,700  | 5,050.00 | 74,235,000    | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| 3639 | ボルテージ            | 5,700   | 320.00   | 1,824,000     | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 3640 | 電算               | 2,300   | 1,631.00 | 3,751,300     | 貸付有価証券<br>600株    |
| 3648 | A G S            | 8,300   | 713.00   | 5,917,900     | 貸付有価証券<br>3,400株  |
| 3649 | ファインデックス         | 23,700  | 533.00   | 12,632,100    | 貸付有価証券<br>4,900株  |
| 3655 | ブレインパッド          | 29,800  | 737.00   | 21,962,600    | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 3656 | K L a b          | 58,900  | 420.00   | 24,738,000    | 貸付有価証券<br>10,600株 |
| 3657 | ポールトゥウィンホールディングス | 51,100  | 888.00   | 45,376,800    | 貸付有価証券<br>5,300株  |
| 3659 | ネクソン             | 773,300 | 3,125.00 | 2,416,562,500 |                   |
| 3660 | アイスタイル           | 95,700  | 495.00   | 47,371,500    | 貸付有価証券<br>13,500株 |
| 3661 | エムアップホールディングス    | 36,600  | 1,274.00 | 46,628,400    | 貸付有価証券<br>7,200株  |
| 3662 | エイチーム            | 22,100  | 774.00   | 17,105,400    | 貸付有価証券<br>4,000株  |
| 3665 | エニグモ             | 38,100  | 634.00   | 24,155,400    | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 3666 | テクノスジャパン         | 16,300  | 482.00   | 7,856,600     | 貸付有価証券<br>4,400株  |
| 3667 | e n i s h        | 14,900  | 361.00   | 5,378,900     | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 3668 | コロプラ             | 116,000 | 671.00   | 77,836,000    | 貸付有価証券<br>29,000株 |
| 3672 | オルトプラス           | 15,100  | 209.00   | 3,155,900     | 貸付有価証券<br>2,400株  |
| 3673 | ブロードリーフ          | 174,700 | 458.00   | 80,012,600    | 貸付有価証券<br>30,300株 |
| 3675 | クロス・マーケティンググループ  | 8,000   | 754.00   | 6,032,000     | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 3676 | デジタルハーツホールディングス  | 18,700  | 1,854.00 | 34,669,800    | 貸付有価証券<br>3,600株  |
| 3677 | システム情報           | 26,400  | 854.00   | 22,545,600    | 貸付有価証券<br>3,800株  |
| 3678 | メディアドゥ           | 12,100  | 1,739.00 | 21,041,900    | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 3679 | じげん              | 87,200  | 377.00   | 32,874,400    | 貸付有価証券<br>13,000株 |
| 3681 | ブイキューブ           | 35,900  | 738.00   | 26,494,200    | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 3682 | エンカレッジ・テクノロジー    | 4,600   | 496.00   | 2,281,600     | 貸付有価証券<br>900株    |
| 3683 | サイバーリンクス         | 6,300   | 989.00   | 6,230,700     | 貸付有価証券<br>3,400株  |

|      |                      |         |           |             |                   |
|------|----------------------|---------|-----------|-------------|-------------------|
| 3686 | ディー・エル・イー            | 14,100  | 261.00    | 3,680,100   | 貸付有価証券<br>4,600株  |
| 3687 | フィックスターズ             | 33,800  | 1,232.00  | 41,641,600  | 貸付有価証券<br>6,100株  |
| 3688 | CARTA HOLDINGS       | 14,000  | 1,685.00  | 23,590,000  | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 3694 | オプティム                | 24,600  | 1,130.00  | 27,798,000  | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 3696 | セレス                  | 12,000  | 1,052.00  | 12,624,000  | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 3697 | SHIFT                | 21,900  | 25,150.00 | 550,785,000 | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 3738 | ティーガイア               | 31,300  | 1,646.00  | 51,519,800  | 貸付有価証券<br>6,900株  |
| 3741 | セック                  | 3,100   | 3,025.00  | 9,377,500   | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 3762 | テクマトリックス             | 54,600  | 1,770.00  | 96,642,000  | 貸付有価証券<br>7,400株  |
| 3763 | プロシップ                | 13,100  | 1,542.00  | 20,200,200  | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 3765 | ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 91,600  | 2,189.00  | 200,512,400 | 貸付有価証券<br>15,000株 |
| 3769 | GMOペイメントゲートウェイ       | 68,300  | 12,140.00 | 829,162,000 | 貸付有価証券<br>12,200株 |
| 3770 | ザッパラス                | 7,300   | 349.00    | 2,547,700   | 貸付有価証券<br>3,300株  |
| 3771 | システムリサーチ             | 9,300   | 2,175.00  | 20,227,500  | 貸付有価証券<br>1,900株  |
| 3774 | インターネットイニシアティブ       | 166,900 | 2,346.00  | 391,547,400 | 貸付有価証券<br>41,200株 |
| 3778 | さくらインターネット           | 33,600  | 505.00    | 16,968,000  | 貸付有価証券<br>4,700株  |
| 3784 | ヴィンクス                | 5,900   | 1,471.00  | 8,678,900   | 貸付有価証券<br>2,100株  |
| 3788 | GMOグローバルサイン・ホールディングス | 9,100   | 4,150.00  | 37,765,000  | 貸付有価証券<br>1,200株  |
| 3817 | SRAホールディングス          | 15,300  | 3,085.00  | 47,200,500  | 貸付有価証券<br>3,900株  |
| 3826 | システムインテグレータ          | 6,700   | 421.00    | 2,820,700   | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 3834 | 朝日ネット                | 32,100  | 590.00    | 18,939,000  | 貸付有価証券<br>4,500株  |
| 3835 | eBASE                | 42,100  | 587.00    | 24,712,700  | 貸付有価証券<br>5,200株  |
| 3836 | アバントグループ             | 37,800  | 1,463.00  | 55,301,400  | 貸付有価証券<br>5,300株  |
| 3837 | アドソル日進               | 12,600  | 1,370.00  | 17,262,000  | 貸付有価証券<br>1,900株  |
| 3839 | ODKソリューションズ          | 4,400   | 618.00    | 2,719,200   | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 3843 | フリービット               | 18,300  | 1,081.00  | 19,782,300  | 貸付有価証券<br>3,900株  |

|      |                       |         |          |             |                   |
|------|-----------------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| 3844 | コムチュア                 | 39,600  | 2,461.00 | 97,455,600  | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 3852 | サイバーコム                | 3,200   | 1,445.00 | 4,624,000   | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 3853 | アステリア                 | 23,400  | 778.00   | 18,205,200  | 貸付有価証券<br>4,200株  |
| 3854 | アイル                   | 16,800  | 1,923.00 | 32,306,400  | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 3901 | マークラインズ               | 16,200  | 2,663.00 | 43,140,600  | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| 3902 | メディカル・データ・ビジョン        | 44,600  | 976.00   | 43,529,600  | 貸付有価証券<br>5,900株  |
| 3903 | g u m i               | 48,900  | 871.00   | 42,591,900  | 貸付有価証券<br>5,500株  |
| 3909 | ショーケース                | 4,600   | 312.00   | 1,435,200   | 貸付有価証券<br>1,200株  |
| 3912 | モバイルファクトリー            | 4,100   | 927.00   | 3,800,700   | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 3915 | テラスカイ                 | 12,900  | 1,996.00 | 25,748,400  | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 3916 | デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 15,600  | 1,832.00 | 28,579,200  | 貸付有価証券<br>3,300株  |
| 3918 | P C I ホールディングス        | 8,300   | 1,036.00 | 8,598,800   | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 3920 | アイビーシー                | 3,100   | 401.00   | 1,243,100   | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 3921 | ネオジャパン                | 10,000  | 1,007.00 | 10,070,000  | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 3922 | P R T I M E S         | 7,500   | 1,820.00 | 13,650,000  | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 3923 | ラクス                   | 141,500 | 1,794.00 | 253,851,000 | 貸付有価証券<br>14,000株 |
| 3924 | ランドコンピュータ             | 4,800   | 970.00   | 4,656,000   | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 3925 | ダブルスタンダード             | 12,100  | 2,190.00 | 26,499,000  | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 3926 | オーブンドア                | 20,900  | 1,812.00 | 37,870,800  | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 3928 | マイネット                 | 6,400   | 375.00   | 2,400,000   | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 3932 | アカツキ                  | 14,200  | 2,317.00 | 32,901,400  | 貸付有価証券<br>2,300株  |
| 3934 | ベネフィットジャパン            | 1,600   | 1,260.00 | 2,016,000   | 貸付有価証券<br>300株    |
| 3937 | U b i c o mホールディングス   | 9,300   | 2,200.00 | 20,460,000  | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 3939 | カナミックネットワーク           | 42,900  | 571.00   | 24,495,900  | 貸付有価証券<br>4,800株  |
| 3940 | ノムラシステムコーポレーション       | 18,500  | 119.00   | 2,201,500   | 貸付有価証券<br>5,600株  |
| 3962 | チェンジ                  | 73,200  | 2,428.00 | 177,729,600 | 貸付有価証券<br>6,600株  |

|      |                   |         |          |               |                   |
|------|-------------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 3963 | シンクロ・フード          | 10,700  | 442.00   | 4,729,400     | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 3964 | オークネット            | 14,800  | 1,819.00 | 26,921,200    | 貸付有価証券<br>4,000株  |
| 3965 | キャピタル・アセット・プランニング | 3,800   | 598.00   | 2,272,400     | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 3968 | セグエグループ           | 5,500   | 879.00   | 4,834,500     | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 3969 | エイトレッド            | 3,000   | 1,480.00 | 4,440,000     | 貸付有価証券<br>500株    |
| 3978 | マクロミル             | 67,700  | 1,124.00 | 76,094,800    | 貸付有価証券<br>11,700株 |
| 3981 | ビーグリー             | 3,300   | 1,165.00 | 3,844,500     | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 3983 | オロ                | 9,000   | 1,881.00 | 16,929,000    | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 3984 | ユーザーローカル          | 10,700  | 1,266.00 | 13,546,200    | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 3985 | テモナ               | 3,800   | 284.00   | 1,079,200     | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 3992 | ニーズウェル            | 6,100   | 803.00   | 4,898,300     | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 3994 | マネーフォワード          | 72,000  | 4,885.00 | 351,720,000   | 貸付有価証券<br>9,900株  |
| 3996 | サインポスト            | 6,800   | 608.00   | 4,134,400     | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 4053 | Sun Asterisk      | 12,300  | 1,422.00 | 17,490,600    |                   |
| 4072 | 電算システムホールディングス    | 14,400  | 2,167.00 | 31,204,800    | 貸付有価証券<br>2,300株  |
| 4180 | Appier Group      | 66,200  | 1,537.00 | 101,749,400   |                   |
| 4284 | ソルクシーズ            | 16,100  | 354.00   | 5,699,400     | 貸付有価証券<br>5,000株  |
| 4295 | フェイス              | 5,500   | 500.00   | 2,750,000     | 貸付有価証券<br>2,500株  |
| 4298 | プロトコーポレーション       | 37,400  | 1,218.00 | 45,553,200    | 貸付有価証券<br>5,500株  |
| 4299 | ハイマックス            | 9,300   | 1,489.00 | 13,847,700    | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 4307 | 野村総合研究所           | 613,700 | 3,280.00 | 2,012,936,000 |                   |
| 4312 | サイバネットシステム        | 25,000  | 980.00   | 24,500,000    | 貸付有価証券<br>6,500株  |
| 4320 | C Eホールディングス       | 10,200  | 504.00   | 5,140,800     | 貸付有価証券<br>3,500株  |
| 4323 | 日本システム技術          | 7,500   | 1,684.00 | 12,630,000    | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 4326 | インテージホールディングス     | 40,600  | 1,569.00 | 63,701,400    | 貸付有価証券<br>8,600株  |
| 4333 | 東邦システムサイエンス       | 5,500   | 1,014.00 | 5,577,000     | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 4344 | ソースネクスト           | 152,100 | 301.00   | 45,782,100    | 貸付有価証券<br>24,400株 |

|      |                          |         |           |               |                   |
|------|--------------------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| 4348 | インフォコム                   | 38,500  | 2,193.00  | 84,430,500    | 貸付有価証券<br>6,700株  |
| 4373 | シンプレクス・ホールディングス          | 50,100  | 2,234.00  | 111,923,400   | 貸付有価証券<br>8,100株  |
| 4382 | HEROZ                    | 10,100  | 1,105.00  | 11,160,500    | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 4384 | ラクスル                     | 42,200  | 2,899.00  | 122,337,800   | 貸付有価証券<br>4,800株  |
| 4385 | メルカリ                     | 134,500 | 2,709.00  | 364,360,500   | 貸付有価証券<br>8,300株  |
| 4390 | I P S                    | 9,700   | 2,871.00  | 27,848,700    | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 4392 | F I G                    | 22,900  | 373.00    | 8,541,700     | 貸付有価証券<br>5,500株  |
| 4396 | システムサポート                 | 12,700  | 1,533.00  | 19,469,100    | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 4420 | イーソル                     | 19,200  | 793.00    | 15,225,600    | 貸付有価証券<br>3,300株  |
| 4423 | アルテリア・ネットワークス            | 27,900  | 1,253.00  | 34,958,700    | 貸付有価証券<br>6,700株  |
| 4430 | 東海ソフト                    | 3,300   | 934.00    | 3,082,200     | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 4432 | ウイングアーク 1 s t            | 30,800  | 1,966.00  | 60,552,800    |                   |
| 4433 | ヒト・コミュニケーションズ・ホール<br>ディン | 8,000   | 1,653.00  | 13,224,000    | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 4434 | サーバーワークス                 | 6,000   | 2,458.00  | 14,748,000    | 貸付有価証券<br>700株    |
| 4439 | 東名                       | 1,500   | 2,053.00  | 3,079,500     | 貸付有価証券<br>500株    |
| 4440 | ヴィッツ                     | 1,900   | 980.00    | 1,862,000     | 貸付有価証券<br>500株    |
| 4441 | トビラシシステムズ                | 4,900   | 836.00    | 4,096,400     | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 4443 | S a n s a n              | 111,800 | 1,641.00  | 183,463,800   | 貸付有価証券<br>23,600株 |
| 4446 | L i n k－U                | 3,800   | 967.00    | 3,674,600     | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 4449 | ギフティ                     | 32,200  | 2,078.00  | 66,911,600    | 貸付有価証券<br>5,800株  |
| 4480 | メドレー                     | 30,100  | 4,620.00  | 139,062,000   |                   |
| 4481 | ベース                      | 10,100  | 4,295.00  | 43,379,500    | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 4483 | J M D C                  | 49,100  | 4,340.00  | 213,094,000   | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| 4662 | フォーカスシステムズ               | 21,800  | 1,070.00  | 23,326,000    | 貸付有価証券<br>3,200株  |
| 4674 | クレスコ                     | 23,100  | 1,866.00  | 43,104,600    | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 4676 | フジ・メディア・ホールディングス         | 287,300 | 1,086.00  | 312,007,800   | 貸付有価証券<br>42,000株 |
| 4684 | オービック                    | 100,000 | 21,110.00 | 2,111,000,000 | 貸付有価証券<br>6,900株  |

|      |                  |           |          |               |                    |
|------|------------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 4686 | ジャストシステム         | 43,000    | 3,235.00 | 139,105,000   | 貸付有価証券<br>7,000株   |
| 4687 | TDCソフト           | 25,200    | 1,565.00 | 39,438,000    | 貸付有価証券<br>6,200株   |
| 4689 | Zホールディングス        | 4,257,200 | 377.50   | 1,607,093,000 | 貸付有価証券<br>698,900株 |
| 4704 | トレンドマイクロ         | 172,800   | 6,300.00 | 1,088,640,000 | 貸付有価証券<br>21,200株  |
| 4709 | IDホールディングス       | 20,200    | 958.00   | 19,351,600    | 貸付有価証券<br>3,300株   |
| 4716 | 日本オラクル           | 57,200    | 8,910.00 | 509,652,000   | 貸付有価証券<br>12,100株  |
| 4719 | アルファシステムズ        | 9,400     | 4,110.00 | 38,634,000    | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 4722 | フューチャー           | 74,400    | 1,655.00 | 123,132,000   | 貸付有価証券<br>15,400株  |
| 4725 | CAC Holdings     | 18,300    | 1,460.00 | 26,718,000    | 貸付有価証券<br>4,300株   |
| 4726 | SBテクノロジー         | 12,700    | 1,952.00 | 24,790,400    | 貸付有価証券<br>2,900株   |
| 4728 | トーセ              | 5,200     | 744.00   | 3,868,800     | 貸付有価証券<br>700株     |
| 4733 | オービックビジネスコンサルタント | 58,900    | 4,940.00 | 290,966,000   | 貸付有価証券<br>7,000株   |
| 4739 | 伊藤忠テクノソリューションズ   | 160,600   | 3,140.00 | 504,284,000   | 貸付有価証券<br>19,800株  |
| 4743 | アイティフォー          | 39,400    | 869.00   | 34,238,600    | 貸付有価証券<br>7,900株   |
| 4746 | 東計電算             | 4,200     | 5,300.00 | 22,260,000    | 貸付有価証券<br>700株     |
| 4762 | エクスネット           | 3,300     | 1,005.00 | 3,316,500     | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 4768 | 大塚商会             | 169,500   | 4,310.00 | 730,545,000   | 貸付有価証券<br>34,200株  |
| 4776 | サイボウズ            | 41,200    | 2,620.00 | 107,944,000   | 貸付有価証券<br>8,300株   |
| 4812 | 電通国際情報サービス       | 36,400    | 4,220.00 | 153,608,000   | 貸付有価証券<br>9,400株   |
| 4813 | ACCESS           | 35,400    | 945.00   | 33,453,000    | 貸付有価証券<br>5,900株   |
| 4819 | デジタルガレージ         | 53,100    | 4,625.00 | 245,587,500   | 貸付有価証券<br>11,300株  |
| 4820 | EMシステムズ          | 49,900    | 901.00   | 44,959,900    | 貸付有価証券<br>9,400株   |
| 4825 | ウェザーニューズ         | 10,600    | 7,080.00 | 75,048,000    | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 4826 | C I J            | 27,300    | 953.00   | 26,016,900    | 貸付有価証券<br>7,000株   |
| 4828 | ビジネスエンジニアリング     | 4,800     | 2,390.00 | 11,472,000    | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 4829 | 日本エンタープライズ       | 20,500    | 129.00   | 2,644,500     | 貸付有価証券<br>4,400株   |



|      |                     |         |          |             |                   |
|------|---------------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| 4839 | WOWOW               | 16,900  | 1,278.00 | 21,598,200  | 貸付有価証券<br>3,900株  |
| 4845 | スカラ                 | 29,600  | 723.00   | 21,400,800  | 貸付有価証券<br>4,300株  |
| 4847 | インテリジェント ウェイブ       | 10,500  | 754.00   | 7,917,000   | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 5128 | WOW WORLD GROUP     | 2,900   | 1,091.00 | 3,163,900   | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 6879 | IMAGICA GROUP       | 25,000  | 686.00   | 17,150,000  | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 7518 | ネットワンシステムズ          | 111,500 | 3,540.00 | 394,710,000 | 貸付有価証券<br>16,500株 |
| 7527 | システムソフト             | 104,100 | 91.00    | 9,473,100   | 貸付有価証券<br>4,200株  |
| 7595 | アルゴグラフィックス          | 27,400  | 3,790.00 | 103,846,000 | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 7844 | マーベラス               | 48,600  | 698.00   | 33,922,800  | 貸付有価証券<br>14,200株 |
| 7860 | エイベックス              | 50,800  | 1,741.00 | 88,442,800  | 貸付有価証券<br>11,200株 |
| 8056 | B I P R O G Y       | 110,100 | 3,420.00 | 376,542,000 | 貸付有価証券<br>20,100株 |
| 8096 | 兼松エレクトロニクス          | 19,200  | 4,605.00 | 88,416,000  | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 8157 | 都築電気                | 15,800  | 1,350.00 | 21,330,000  | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 9401 | T B Sホールディングス       | 153,100 | 1,534.00 | 234,855,400 | 貸付有価証券<br>38,000株 |
| 9404 | 日本テレビホールディングス       | 264,800 | 1,051.00 | 278,304,800 | 貸付有価証券<br>48,000株 |
| 9405 | 朝日放送グループホールディングス    | 28,000  | 646.00   | 18,088,000  | 貸付有価証券<br>6,400株  |
| 9409 | テレビ朝日ホールディングス       | 72,600  | 1,338.00 | 97,138,800  | 貸付有価証券<br>15,800株 |
| 9412 | スカパーJ S A Tホールディングス | 265,400 | 502.00   | 133,230,800 | 貸付有価証券<br>19,500株 |
| 9413 | テレビ東京ホールディングス       | 21,500  | 1,939.00 | 41,688,500  | 貸付有価証券<br>700株    |
| 9414 | 日本B S放送             | 7,100   | 916.00   | 6,503,600   | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 9416 | ビジョン                | 39,300  | 1,457.00 | 57,260,100  | 貸付有価証券<br>6,100株  |
| 9417 | スマートバリュー            | 4,800   | 424.00   | 2,035,200   | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 9418 | USEN-NEXT HOLDING S | 26,800  | 2,201.00 | 58,986,800  | 貸付有価証券<br>600株    |
| 9419 | ワイヤレスゲート            | 8,600   | 258.00   | 2,218,800   | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 9422 | コネクシオ               | 20,000  | 1,909.00 | 38,180,000  | 貸付有価証券<br>5,200株  |
| 9424 | 日本通信                | 276,100 | 222.00   | 61,294,200  | 貸付有価証券<br>54,400株 |

|      |                          |           |           |                |                    |
|------|--------------------------|-----------|-----------|----------------|--------------------|
| 9428 | クロップス                    | 3,900     | 1,027.00  | 4,005,300      | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 9432 | 日本電信電話                   | 3,833,100 | 3,907.00  | 14,975,921,700 | 貸付有価証券<br>313,200株 |
| 9433 | KDDI                     | 2,311,600 | 4,108.00  | 9,496,052,800  | 貸付有価証券<br>110,800株 |
| 9434 | ソフトバンク                   | 4,805,700 | 1,489.50  | 7,158,090,150  | 貸付有価証券<br>64,000株  |
| 9435 | 光通信                      | 35,200    | 18,860.00 | 663,872,000    | 貸付有価証券<br>2,900株   |
| 9438 | エムティーアイ                  | 27,300    | 516.00    | 14,086,800     | 貸付有価証券<br>6,900株   |
| 9449 | GMOインターネットグループ           | 111,100   | 2,585.00  | 287,193,500    | 貸付有価証券<br>21,300株  |
| 9450 | ファイバーゲート                 | 16,100    | 945.00    | 15,214,500     | 貸付有価証券<br>1,400株   |
| 9466 | アイドママーケティングコミュニケー<br>ション | 4,500     | 280.00    | 1,260,000      | 貸付有価証券<br>1,900株   |
| 9468 | KADOKAWA                 | 158,100   | 2,453.00  | 387,819,300    | 貸付有価証券<br>15,300株  |
| 9470 | 学研ホールディングス               | 49,800    | 981.00    | 48,853,800     |                    |
| 9474 | ゼンリン                     | 51,100    | 806.00    | 41,186,600     | 貸付有価証券<br>8,600株   |
| 9475 | 昭文社ホールディングス              | 8,500     | 292.00    | 2,482,000      | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 9479 | インプレスホールディングス            | 17,500    | 208.00    | 3,640,000      | 貸付有価証券<br>5,900株   |
| 9600 | アイネット                    | 18,100    | 1,348.00  | 24,398,800     | 貸付有価証券<br>3,600株   |
| 9601 | 松竹                       | 17,100    | 10,860.00 | 185,706,000    | 貸付有価証券<br>2,900株   |
| 9602 | 東宝                       | 187,200   | 4,800.00  | 898,560,000    | 貸付有価証券<br>22,300株  |
| 9605 | 東映                       | 8,200     | 17,280.00 | 141,696,000    | 貸付有価証券<br>2,500株   |
| 9613 | エヌ・ティ・ティ・データ             | 938,600   | 2,014.00  | 1,890,340,400  | 貸付有価証券<br>118,300株 |
| 9629 | ピー・シー・エー                 | 18,000    | 1,378.00  | 24,804,000     | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 9658 | ビジネスブレイン太田昭和             | 12,800    | 2,003.00  | 25,638,400     | 貸付有価証券<br>2,000株   |
| 9682 | D T S                    | 63,700    | 3,120.00  | 198,744,000    | 貸付有価証券<br>11,000株  |
| 9684 | スクウェア・エニックス・ホールディ<br>ングス | 150,300   | 6,230.00  | 936,369,000    | 貸付有価証券<br>28,800株  |
| 9692 | シーイーシー                   | 41,900    | 1,509.00  | 63,227,100     |                    |
| 9697 | カプコン                     | 297,300   | 4,200.00  | 1,248,660,000  | 貸付有価証券<br>46,200株  |
| 9702 | アイ・エス・ビー                 | 15,200    | 1,205.00  | 18,316,000     | 貸付有価証券<br>400株     |
| 9717 | ジャステック                   | 18,400    | 1,213.00  | 22,319,200     | 貸付有価証券<br>4,500株   |

|      |                  |           |          |                |                    |
|------|------------------|-----------|----------|----------------|--------------------|
| 9719 | ＳＣＳＫ             | 244,100   | 2,108.00 | 514,562,800    | 貸付有価証券<br>45,200株  |
| 9739 | ＮＳＷ              | 11,600    | 2,076.00 | 24,081,600     | 貸付有価証券<br>1,100株   |
| 9742 | アイネス             | 21,000    | 1,367.00 | 28,707,000     | 貸付有価証券<br>8,200株   |
| 9746 | ＴＫＣ              | 53,700    | 3,625.00 | 194,662,500    | 貸付有価証券<br>10,800株  |
| 9749 | 富士ソフト            | 33,800    | 7,750.00 | 261,950,000    | 貸付有価証券<br>3,400株   |
| 9759 | ＮＳＤ              | 106,700   | 2,329.00 | 248,504,300    | 貸付有価証券<br>21,800株  |
| 9766 | コナミグループ          | 128,000   | 6,430.00 | 823,040,000    | 貸付有価証券<br>18,600株  |
| 9790 | 福井コンピュータホールディングス | 20,800    | 2,914.00 | 60,611,200     | 貸付有価証券<br>2,000株   |
| 9889 | ＪＢＣＣホールディングス     | 21,800    | 1,831.00 | 39,915,800     | 貸付有価証券<br>100株     |
| 9928 | ミロク情報サービス        | 27,200    | 1,569.00 | 42,676,800     | 貸付有価証券<br>5,300株   |
| 9984 | ソフトバンクグループ       | 1,729,600 | 6,198.00 | 10,720,060,800 | 貸付有価証券<br>163,000株 |
| 2676 | 高千穂交易            | 7,500     | 2,291.00 | 17,182,500     | 貸付有価証券<br>2,600株   |
| 2689 | オルバヘルスケアホールディングス | 3,500     | 1,526.00 | 5,341,000      | 貸付有価証券<br>800株     |
| 2692 | 伊藤忠食品            | 7,100     | 4,895.00 | 34,754,500     | 貸付有価証券<br>1,700株   |
| 2715 | エレマテック           | 28,300    | 1,702.00 | 48,166,600     | 貸付有価証券<br>5,500株   |
| 2733 | あらた              | 24,100    | 4,145.00 | 99,894,500     | 貸付有価証券<br>5,100株   |
| 2737 | トーメンデバイス         | 4,600     | 5,970.00 | 27,462,000     | 貸付有価証券<br>800株     |
| 2760 | 東京エレクトロン デバイス    | 11,700    | 7,660.00 | 89,622,000     | 貸付有価証券<br>2,300株   |
| 2767 | 円谷フィールズホールディングス  | 27,100    | 2,424.00 | 65,690,400     | 貸付有価証券<br>5,100株   |
| 2768 | 双日               | 335,000   | 2,578.00 | 863,630,000    | 貸付有価証券<br>48,100株  |
| 2784 | アルフレッサ ホールディングス  | 316,700   | 1,627.00 | 515,270,900    | 貸付有価証券<br>48,500株  |
| 2874 | 横浜冷凍             | 85,900    | 1,079.00 | 92,686,100     | 貸付有価証券<br>17,200株  |
| 3004 | 神栄               | 3,100     | 806.00   | 2,498,600      | 貸付有価証券<br>600株     |
| 3023 | ラサ商事             | 9,600     | 1,196.00 | 11,481,600     | 貸付有価証券<br>2,300株   |
| 3036 | アルコニックス          | 41,500    | 1,384.00 | 57,436,000     | 貸付有価証券<br>6,500株   |
| 3038 | 神戸物産             | 244,100   | 3,825.00 | 933,682,500    | 貸付有価証券<br>38,000株  |

|      |                     |         |          |             |                   |
|------|---------------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| 3054 | ハイパー                | 3,900   | 453.00   | 1,766,700   | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 3076 | あい ホールディングス         | 50,500  | 2,145.00 | 108,322,500 | 貸付有価証券<br>11,200株 |
| 3079 | ディーブイエックス           | 7,200   | 1,061.00 | 7,639,200   | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 3107 | ダイワボウホールディングス       | 129,000 | 1,949.00 | 251,421,000 | 貸付有価証券<br>27,900株 |
| 3132 | マクニカホールディングス        | 77,300  | 3,345.00 | 258,568,500 | 貸付有価証券<br>15,800株 |
| 3139 | ラクト・ジャパン            | 12,200  | 1,985.00 | 24,217,000  | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 3150 | グリムス                | 13,100  | 2,040.00 | 26,724,000  | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 3151 | バイタルケーエスケー・ホールディングス | 46,100  | 833.00   | 38,401,300  | 貸付有価証券<br>12,600株 |
| 3153 | 八洲電機                | 25,500  | 1,089.00 | 27,769,500  | 貸付有価証券<br>4,300株  |
| 3154 | メディアスホールディングス       | 20,200  | 739.00   | 14,927,800  | 貸付有価証券<br>4,300株  |
| 3156 | レスターホールディングス        | 30,200  | 2,182.00 | 65,896,400  | 貸付有価証券<br>5,400株  |
| 3157 | ジュテックホールディングス       | 4,100   | 1,239.00 | 5,079,900   | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 3160 | 大光                  | 8,900   | 632.00   | 5,624,800   | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 3166 | OCHIホールディングス        | 4,700   | 1,313.00 | 6,171,100   | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 3167 | TOKAIホールディングス       | 155,800 | 855.00   | 133,209,000 | 貸付有価証券<br>29,900株 |
| 3168 | 黒谷                  | 5,700   | 615.00   | 3,505,500   | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 3173 | Cominix             | 3,700   | 749.00   | 2,771,300   | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 3176 | 三洋貿易                | 32,400  | 1,138.00 | 36,871,200  | 貸付有価証券<br>7,000株  |
| 3180 | ビューティガレージ           | 5,700   | 3,645.00 | 20,776,500  | 貸付有価証券<br>900株    |
| 3183 | ウイン・パートナーズ          | 23,000  | 1,006.00 | 23,138,000  | 貸付有価証券<br>4,600株  |
| 3321 | ミタチ産業               | 5,300   | 1,134.00 | 6,010,200   | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 3360 | シップヘルスケアホールディングス    | 113,400 | 2,551.00 | 289,283,400 | 貸付有価証券<br>22,400株 |
| 3388 | 明治電機工業              | 11,700  | 1,115.00 | 13,045,500  | 貸付有価証券<br>1,900株  |
| 3392 | デリカフーズホールディングス      | 8,200   | 514.00   | 4,214,800   | 貸付有価証券<br>2,100株  |
| 3393 | スターティアホールディングス      | 4,800   | 1,016.00 | 4,876,800   | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 3543 | コメダホールディングス         | 77,300  | 2,401.00 | 185,597,300 | 貸付有価証券<br>3,100株  |

|      |                  |         |          |             |                  |
|------|------------------|---------|----------|-------------|------------------|
| 3559 | ピーバンドットコム        | 2,900   | 521.00   | 1,510,900   | 貸付有価証券<br>800株   |
| 3565 | アセンテック           | 10,600  | 498.00   | 5,278,800   | 貸付有価証券<br>1,100株 |
| 5009 | 富士興産             | 5,300   | 1,281.00 | 6,789,300   | 貸付有価証券<br>1,900株 |
| 6973 | 協栄産業             | 2,100   | 1,742.00 | 3,658,200   | 貸付有価証券<br>700株   |
| 7128 | フルサト・マルカホールディングス | 31,400  | 3,380.00 | 106,132,000 | 貸付有価証券<br>5,900株 |
| 7130 | ヤマエグループホールディングス  | 17,800  | 1,385.00 | 24,653,000  | 貸付有価証券<br>1,400株 |
| 7414 | 小野建              | 29,000  | 1,533.00 | 44,457,000  |                  |
| 7417 | 南陽               | 4,000   | 1,959.00 | 7,836,000   | 貸付有価証券<br>1,000株 |
| 7420 | 佐鳥電機             | 13,100  | 1,379.00 | 18,064,900  | 貸付有価証券<br>3,200株 |
| 7427 | エコートレーディング       | 4,400   | 711.00   | 3,128,400   | 貸付有価証券<br>1,300株 |
| 7433 | 伯東               | 18,100  | 4,515.00 | 81,721,500  | 貸付有価証券<br>4,000株 |
| 7438 | コンドーテック          | 24,200  | 1,011.00 | 24,466,200  | 貸付有価証券<br>1,900株 |
| 7442 | 中山福              | 11,100  | 328.00   | 3,640,800   | 貸付有価証券<br>2,500株 |
| 7447 | ナガイレーベン          | 39,900  | 1,942.00 | 77,485,800  | 貸付有価証券<br>8,400株 |
| 7451 | 三菱食品             | 29,100  | 3,080.00 | 89,628,000  | 貸付有価証券<br>2,300株 |
| 7456 | 松田産業             | 24,000  | 2,375.00 | 57,000,000  | 貸付有価証券<br>5,000株 |
| 7458 | 第一興商             | 61,100  | 3,990.00 | 243,789,000 | 貸付有価証券<br>7,500株 |
| 7459 | メディパルホールディングス    | 327,300 | 1,728.00 | 565,574,400 |                  |
| 7466 | S P K            | 14,000  | 1,448.00 | 20,272,000  | 貸付有価証券<br>600株   |
| 7467 | 萩原電気ホールディングス     | 12,100  | 2,576.00 | 31,169,600  |                  |
| 7476 | アズワン             | 46,200  | 5,800.00 | 267,960,000 | 貸付有価証券<br>5,800株 |
| 7480 | スズデン             | 11,000  | 2,359.00 | 25,949,000  | 貸付有価証券<br>2,100株 |
| 7481 | 尾家産業             | 4,900   | 913.00   | 4,473,700   | 貸付有価証券<br>1,600株 |
| 7482 | シモジマ             | 21,600  | 934.00   | 20,174,400  | 貸付有価証券<br>3,400株 |
| 7483 | ドウシシャ            | 33,400  | 1,623.00 | 54,208,200  | 貸付有価証券<br>2,900株 |
| 7487 | 小津産業             | 4,700   | 1,548.00 | 7,275,600   | 貸付有価証券<br>1,000株 |
| 7504 | 高速               | 16,400  | 1,834.00 | 30,077,600  | 貸付有価証券<br>2,600株 |

|      |              |           |          |               |                    |
|------|--------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 7510 | たけびし         | 12,000    | 1,580.00 | 18,960,000    | 貸付有価証券<br>2,200株   |
| 7525 | リックス         | 4,300     | 2,207.00 | 9,490,100     | 貸付有価証券<br>1,400株   |
| 7537 | 丸文           | 28,200    | 1,029.00 | 29,017,800    | 貸付有価証券<br>5,300株   |
| 7552 | ハピネット        | 26,800    | 2,008.00 | 53,814,400    | 貸付有価証券<br>4,800株   |
| 7570 | 橋本総業ホールディングス | 12,500    | 1,074.00 | 13,425,000    | 貸付有価証券<br>2,600株   |
| 7575 | 日本ライフライン     | 92,500    | 951.00   | 87,967,500    |                    |
| 7590 | タカショー        | 27,500    | 682.00   | 18,755,000    | 貸付有価証券<br>900株     |
| 7599 | I D O M      | 95,400    | 816.00   | 77,846,400    | 貸付有価証券<br>5,300株   |
| 7607 | 進和           | 20,900    | 2,106.00 | 44,015,400    | 貸付有価証券<br>4,100株   |
| 7608 | エスケイジャパン     | 5,100     | 554.00   | 2,825,400     | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 7609 | ダイトロン        | 12,400    | 2,392.00 | 29,660,800    | 貸付有価証券<br>3,200株   |
| 7613 | シークス         | 45,000    | 1,364.00 | 61,380,000    | 貸付有価証券<br>8,900株   |
| 7619 | 田中商事         | 6,500     | 572.00   | 3,718,000     |                    |
| 7628 | オーハシテクニカ     | 15,800    | 1,502.00 | 23,731,600    | 貸付有価証券<br>3,800株   |
| 7637 | 白銅           | 11,400    | 2,617.00 | 29,833,800    | 貸付有価証券<br>2,200株   |
| 7673 | ダイコー通産       | 2,500     | 1,073.00 | 2,682,500     | 貸付有価証券<br>700株     |
| 8001 | 伊藤忠商事        | 1,944,600 | 4,160.00 | 8,089,536,000 | 貸付有価証券<br>36,600株  |
| 8002 | 丸紅           | 2,491,500 | 1,597.50 | 3,980,171,250 | 貸付有価証券<br>153,000株 |
| 8007 | 高島           | 3,000     | 2,927.00 | 8,781,000     | 貸付有価証券<br>300株     |
| 8012 | 長瀬産業         | 148,300   | 2,048.00 | 303,718,400   | 貸付有価証券<br>30,900株  |
| 8014 | 蝶理           | 16,900    | 2,299.00 | 38,853,100    | 貸付有価証券<br>1,100株   |
| 8015 | 豊田通商         | 276,400   | 5,390.00 | 1,489,796,000 | 貸付有価証券<br>69,400株  |
| 8018 | 三共生興         | 45,300    | 473.00   | 21,426,900    |                    |
| 8020 | 兼松           | 122,500   | 1,524.00 | 186,690,000   | 貸付有価証券<br>15,000株  |
| 8025 | ツカモトコーポレーション | 3,500     | 1,388.00 | 4,858,000     | 貸付有価証券<br>1,100株   |
| 8031 | 三井物産         | 2,309,100 | 3,909.00 | 9,026,271,900 | 貸付有価証券<br>160,600株 |
| 8032 | 日本紙パルプ商事     | 16,800    | 5,060.00 | 85,008,000    |                    |

|      |                 |           |          |               |                   |
|------|-----------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 8037 | カメイ             | 33,500    | 1,375.00 | 46,062,500    | 貸付有価証券<br>3,400株  |
| 8038 | 東都水産            | 1,100     | 5,220.00 | 5,742,000     | 貸付有価証券<br>600株    |
| 8041 | ＯＵＧホールディングス     | 3,100     | 2,374.00 | 7,359,400     | 貸付有価証券<br>1,200株  |
| 8043 | スターゼン           | 24,000    | 2,123.00 | 50,952,000    | 貸付有価証券<br>4,800株  |
| 8051 | 山善              | 85,000    | 1,039.00 | 88,315,000    | 貸付有価証券<br>27,200株 |
| 8052 | 椿本興業            | 5,100     | 4,155.00 | 21,190,500    | 貸付有価証券<br>800株    |
| 8053 | 住友商事            | 1,954,400 | 2,331.00 | 4,555,706,400 | 貸付有価証券<br>37,300株 |
| 8057 | 内田洋行            | 13,900    | 4,640.00 | 64,496,000    | 貸付有価証券<br>3,500株  |
| 8058 | 三菱商事            | 1,973,100 | 4,437.00 | 8,754,644,700 | 貸付有価証券<br>26,900株 |
| 8059 | 第一実業            | 11,100    | 4,660.00 | 51,726,000    | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 8060 | キヤノンマーケティングジャパン | 73,100    | 3,025.00 | 221,127,500   | 貸付有価証券<br>21,300株 |
| 8061 | 西華産業            | 12,400    | 1,633.00 | 20,249,200    | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 8065 | 佐藤商事            | 21,900    | 1,319.00 | 28,886,100    | 貸付有価証券<br>6,200株  |
| 8068 | 菱洋エレクトロ         | 26,900    | 2,385.00 | 64,156,500    | 貸付有価証券<br>6,400株  |
| 8070 | 東京産業            | 28,800    | 766.00   | 22,060,800    | 貸付有価証券<br>5,800株  |
| 8074 | ユアサ商事           | 28,400    | 3,610.00 | 102,524,000   | 貸付有価証券<br>4,200株  |
| 8075 | 神鋼商事            | 7,900     | 5,570.00 | 44,003,000    | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 8077 | トルク             | 11,200    | 208.00   | 2,329,600     | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 8078 | 阪和興業            | 56,700    | 4,010.00 | 227,367,000   | 貸付有価証券<br>12,800株 |
| 8079 | 正栄食品工業          | 21,000    | 4,080.00 | 85,680,000    | 貸付有価証券<br>4,600株  |
| 8081 | カナデン            | 25,500    | 1,120.00 | 28,560,000    | 貸付有価証券<br>3,900株  |
| 8084 | 菱電商事            | 25,500    | 1,752.00 | 44,676,000    | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 8088 | 岩谷産業            | 71,900    | 5,570.00 | 400,483,000   | 貸付有価証券<br>13,300株 |
| 8089 | ナイス             | 6,500     | 1,302.00 | 8,463,000     | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 8091 | ニチモウ            | 2,500     | 2,911.00 | 7,277,500     | 貸付有価証券<br>900株    |
| 8093 | 極東貿易            | 18,800    | 1,407.00 | 26,451,600    | 貸付有価証券<br>3,000株  |

|      |                   |        |          |             |                   |
|------|-------------------|--------|----------|-------------|-------------------|
| 8095 | アステナホールディングス      | 54,600 | 415.00   | 22,659,000  | 貸付有価証券<br>9,700株  |
| 8097 | 三愛オブリ             | 87,100 | 1,314.00 | 114,449,400 | 貸付有価証券<br>7,600株  |
| 8098 | 稲畑産業              | 63,700 | 2,487.00 | 158,421,900 | 貸付有価証券<br>13,300株 |
| 8101 | G S I クレオス        | 18,300 | 1,498.00 | 27,413,400  | 貸付有価証券<br>3,400株  |
| 8103 | 明和産業              | 41,900 | 679.00   | 28,450,100  | 貸付有価証券<br>7,100株  |
| 8104 | クワザワホールディングス      | 7,500  | 434.00   | 3,255,000   | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 8125 | ワキタ               | 58,000 | 1,193.00 | 69,194,000  | 貸付有価証券<br>4,200株  |
| 8129 | 東邦ホールディングス        | 78,600 | 2,087.00 | 164,038,200 |                   |
| 8130 | サンゲツ              | 79,200 | 2,250.00 | 178,200,000 | 貸付有価証券<br>11,000株 |
| 8131 | ミツウロコグループホールディングス | 40,600 | 1,142.00 | 46,365,200  | 貸付有価証券<br>6,400株  |
| 8132 | シナネンホールディングス      | 10,200 | 3,910.00 | 39,882,000  | 貸付有価証券<br>700株    |
| 8133 | 伊藤忠エネクス           | 78,200 | 1,095.00 | 85,629,000  |                   |
| 8136 | サンリオ              | 89,400 | 4,675.00 | 417,945,000 | 貸付有価証券<br>17,500株 |
| 8137 | サンワテクノス           | 16,100 | 1,615.00 | 26,001,500  | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 8140 | リョーサン             | 33,500 | 3,040.00 | 101,840,000 | 貸付有価証券<br>5,400株  |
| 8141 | 新光商事              | 42,400 | 1,274.00 | 54,017,600  |                   |
| 8142 | トーヨー              | 13,500 | 1,574.00 | 21,249,000  | 貸付有価証券<br>3,100株  |
| 8150 | 三信電気              | 12,700 | 2,505.00 | 31,813,500  | 貸付有価証券<br>4,000株  |
| 8151 | 東陽テクニカ            | 34,900 | 1,360.00 | 47,464,000  | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 8153 | モスフードサービス         | 46,400 | 3,055.00 | 141,752,000 | 貸付有価証券<br>6,900株  |
| 8154 | 加賀電子              | 25,600 | 4,215.00 | 107,904,000 | 貸付有価証券<br>5,700株  |
| 8158 | ソーダニッカ            | 16,900 | 733.00   | 12,387,700  | 貸付有価証券<br>6,200株  |
| 8159 | 立花エレテック           | 23,000 | 1,813.00 | 41,699,000  | 貸付有価証券<br>5,300株  |
| 8275 | フォーバル             | 12,400 | 1,048.00 | 12,995,200  | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| 8283 | P A L T A C       | 49,600 | 4,635.00 | 229,896,000 | 貸付有価証券<br>8,200株  |
| 8285 | 三谷産業              | 55,100 | 319.00   | 17,576,900  | 貸付有価証券<br>8,000株  |
| 8835 | 太平洋興発             | 7,800  | 915.00   | 7,137,000   | 貸付有価証券<br>2,200株  |



|      |                     |         |          |               |                   |
|------|---------------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 9260 | 西本Wismettacホールディングス | 8,000   | 3,530.00 | 28,240,000    | 貸付有価証券<br>200株    |
| 9265 | ヤマシタヘルスケアホールディングス   | 1,900   | 1,689.00 | 3,209,100     | 貸付有価証券<br>500株    |
| 9273 | コーア商事ホールディングス       | 22,100  | 646.00   | 14,276,600    | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 9274 | KPPグループホールディングス     | 73,500  | 833.00   | 61,225,500    | 貸付有価証券<br>14,400株 |
| 9305 | ヤマタネ                | 13,900  | 1,690.00 | 23,491,000    | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 9763 | 丸紅建材リース             | 1,800   | 1,758.00 | 3,164,400     | 貸付有価証券<br>300株    |
| 9810 | 日鉄物産                | 21,600  | 9,240.00 | 199,584,000   | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| 9824 | 泉州電業                | 15,800  | 3,310.00 | 52,298,000    | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 9830 | トラスコ中山              | 66,300  | 2,056.00 | 136,312,800   |                   |
| 9832 | オートバックスセブン          | 109,800 | 1,417.00 | 155,586,600   | 貸付有価証券<br>16,200株 |
| 9837 | モリト                 | 22,600  | 953.00   | 21,537,800    | 貸付有価証券<br>4,500株  |
| 9869 | 加藤産業                | 38,300  | 3,565.00 | 136,539,500   | 貸付有価証券<br>3,900株  |
| 9872 | 北恵                  | 4,700   | 686.00   | 3,224,200     | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 9882 | イエローハット             | 55,700  | 1,722.00 | 95,915,400    |                   |
| 9896 | JKホールディングス          | 24,900  | 1,064.00 | 26,493,600    | 貸付有価証券<br>6,200株  |
| 9902 | 日伝                  | 18,700  | 1,782.00 | 33,323,400    | 貸付有価証券<br>4,000株  |
| 9930 | 北沢産業                | 11,100  | 222.00   | 2,464,200     | 貸付有価証券<br>4,400株  |
| 9932 | 杉本商事                | 14,000  | 1,989.00 | 27,846,000    | 貸付有価証券<br>3,800株  |
| 9934 | 因幡電機産業              | 81,800  | 2,792.00 | 228,385,600   | 貸付有価証券<br>11,600株 |
| 9960 | 東テク                 | 10,500  | 3,590.00 | 37,695,000    | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 9962 | ミスミグループ本社           | 476,200 | 3,245.00 | 1,545,269,000 | 貸付有価証券<br>54,600株 |
| 9972 | アルテック               | 11,600  | 268.00   | 3,108,800     | 貸付有価証券<br>5,000株  |
| 9982 | タキヒヨー               | 5,700   | 885.00   | 5,044,500     | 貸付有価証券<br>1,900株  |
| 9986 | 蔵王産業                | 4,100   | 1,794.00 | 7,355,400     | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 9987 | スズケン                | 98,200  | 3,400.00 | 333,880,000   | 貸付有価証券<br>100株    |
| 9991 | ジェコス                | 20,300  | 876.00   | 17,782,800    | 貸付有価証券<br>1,900株  |
| 9995 | グローセル               | 22,900  | 412.00   | 9,434,800     | 貸付有価証券<br>4,300株  |

|      |                 |         |          |             |                   |
|------|-----------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| 2651 | ローソン            | 78,300  | 5,100.00 | 399,330,000 |                   |
| 2659 | サンエー            | 24,100  | 4,040.00 | 97,364,000  | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 2664 | カワチ薬品           | 24,700  | 2,236.00 | 55,229,200  | 貸付有価証券<br>5,300株  |
| 2670 | エービーシー・マート      | 46,000  | 6,940.00 | 319,240,000 | 貸付有価証券<br>6,800株  |
| 2674 | ハードオフコーポレーション   | 9,300   | 1,237.00 | 11,504,100  | 貸付有価証券<br>2,400株  |
| 2678 | アスクル            | 76,100  | 1,726.00 | 131,348,600 | 貸付有価証券<br>2,400株  |
| 2681 | ゲオホールディングス      | 33,100  | 1,870.00 | 61,897,000  | 貸付有価証券<br>10,000株 |
| 2685 | アダストリア          | 38,100  | 2,126.00 | 81,000,600  |                   |
| 2686 | ジーフット           | 12,700  | 296.00   | 3,759,200   | 貸付有価証券<br>3,900株  |
| 2687 | シー・ヴィ・エス・ベイエリア  | 3,100   | 406.00   | 1,258,600   | 貸付有価証券<br>800株    |
| 2695 | くら寿司            | 36,900  | 3,030.00 | 111,807,000 | 貸付有価証券<br>6,600株  |
| 2698 | キャンドゥ           | 11,200  | 2,339.00 | 26,196,800  | 貸付有価証券<br>700株    |
| 2722 | I Kホールディングス     | 6,700   | 383.00   | 2,566,100   | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 2726 | バルグループホールディングス  | 31,000  | 2,713.00 | 84,103,000  | 貸付有価証券<br>3,100株  |
| 2730 | エディオン           | 124,900 | 1,284.00 | 160,371,600 | 貸付有価証券<br>38,400株 |
| 2734 | サーラコーポレーション     | 66,300  | 745.00   | 49,393,500  | 貸付有価証券<br>8,900株  |
| 2735 | ワッツ             | 10,200  | 682.00   | 6,956,400   | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 2742 | ハローズ            | 14,300  | 3,085.00 | 44,115,500  | 貸付有価証券<br>500株    |
| 2752 | フジオフードグループ本社    | 26,300  | 1,401.00 | 36,846,300  | 貸付有価証券<br>4,800株  |
| 2753 | あみやき亭           | 7,600   | 2,926.00 | 22,237,600  | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 2764 | ひらまつ            | 44,800  | 187.00   | 8,377,600   | 貸付有価証券<br>12,400株 |
| 2791 | 大黒天物産           | 11,300  | 5,020.00 | 56,726,000  | 貸付有価証券<br>500株    |
| 2792 | ハニーズホールディングス    | 28,000  | 1,402.00 | 39,256,000  | 貸付有価証券<br>3,800株  |
| 2796 | ファーマライズホールディングス | 4,500   | 625.00   | 2,812,500   | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 3028 | アルペン            | 26,000  | 1,921.00 | 49,946,000  | 貸付有価証券<br>5,700株  |
| 3030 | ハブ              | 6,900   | 665.00   | 4,588,500   | 貸付有価証券<br>2,100株  |
| 3034 | クオールホールディングス    | 43,400  | 1,169.00 | 50,734,600  | 貸付有価証券<br>8,400株  |

|      |                        |         |          |               |                   |
|------|------------------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 3046 | ジンズホールディングス            | 18,700  | 4,005.00 | 74,893,500    | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 3048 | ビックカメラ                 | 209,900 | 1,204.00 | 252,719,600   | 貸付有価証券<br>25,900株 |
| 3050 | D C Mホールディングス          | 192,600 | 1,179.00 | 227,075,400   |                   |
| 3053 | ペッパーフードサービス            | 65,900  | 176.00   | 11,598,400    | 貸付有価証券<br>11,600株 |
| 3064 | M o n o t a R O        | 447,400 | 2,002.00 | 895,694,800   | 貸付有価証券<br>78,100株 |
| 3067 | 東京一番フーズ                | 4,800   | 481.00   | 2,308,800     | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 3073 | D Dホールディングス            | 11,100  | 771.00   | 8,558,100     | 貸付有価証券<br>2,500株  |
| 3082 | きちりホールディングス            | 5,600   | 577.00   | 3,231,200     | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 3085 | アークランドサービスホールディング<br>ス | 25,800  | 2,149.00 | 55,444,200    | 貸付有価証券<br>4,000株  |
| 3086 | J. フロント リテイリング         | 392,300 | 1,209.00 | 474,290,700   |                   |
| 3087 | ドトール・日レスホールディングス       | 56,000  | 1,862.00 | 104,272,000   | 貸付有価証券<br>7,000株  |
| 3088 | マツキヨココカラ&カンパニー         | 191,400 | 6,520.00 | 1,247,928,000 | 貸付有価証券<br>25,800株 |
| 3091 | ブロンコビリー                | 16,800  | 2,440.00 | 40,992,000    | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 3092 | Z O Z O                | 208,600 | 3,315.00 | 691,509,000   | 貸付有価証券<br>28,300株 |
| 3093 | トレジャー・ファクトリー           | 6,200   | 2,208.00 | 13,689,600    | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 3097 | 物語コーポレーション             | 17,500  | 6,430.00 | 112,525,000   | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 3099 | 三越伊勢丹ホールディングス          | 531,200 | 1,413.00 | 750,585,600   | 貸付有価証券<br>97,000株 |
| 3134 | H a m e e              | 12,700  | 763.00   | 9,690,100     | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 3135 | マーケットエンタープライズ          | 2,100   | 974.00   | 2,045,400     | 貸付有価証券<br>400株    |
| 3141 | ウエルシアホールディングス          | 163,700 | 2,878.00 | 471,128,600   |                   |
| 3148 | クリエイト S Dホールディングス      | 52,200  | 3,445.00 | 179,829,000   | 貸付有価証券<br>10,000株 |
| 3159 | 丸善 C H I ホールディングス      | 24,700  | 333.00   | 8,225,100     | 貸付有価証券<br>6,100株  |
| 3169 | ミサワ                    | 4,300   | 671.00   | 2,885,300     | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 3172 | ティーライフ                 | 2,800   | 1,292.00 | 3,617,600     | 貸付有価証券<br>800株    |
| 3175 | エー・ピーホールディングス          | 4,100   | 455.00   | 1,865,500     | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 3178 | チムニー                   | 6,500   | 1,111.00 | 7,221,500     | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 3179 | シュッピン                  | 23,500  | 1,109.00 | 26,061,500    | 貸付有価証券<br>5,900株  |

|      |                      |           |           |               |                   |
|------|----------------------|-----------|-----------|---------------|-------------------|
| 3182 | オイシックス・ラ・大地          | 42,400    | 2,131.00  | 90,354,400    | 貸付有価証券<br>5,800株  |
| 3186 | ネクステージ               | 72,000    | 2,775.00  | 199,800,000   | 貸付有価証券<br>8,500株  |
| 3191 | ジョイフル本田              | 101,500   | 1,895.00  | 192,342,500   | 貸付有価証券<br>12,800株 |
| 3193 | 鳥貴族ホールディングス          | 11,700    | 2,051.00  | 23,996,700    | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 3196 | ホットランド               | 24,100    | 1,396.00  | 33,643,600    | 貸付有価証券<br>5,100株  |
| 3197 | すかいらくホールディングス        | 431,400   | 1,526.00  | 658,316,400   | 貸付有価証券<br>60,600株 |
| 3198 | S F Pホールディングス        | 17,300    | 1,767.00  | 30,569,100    | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 3199 | 綿半ホールディングス           | 24,400    | 1,384.00  | 33,769,600    | 貸付有価証券<br>4,600株  |
| 3221 | ヨシックスホールディングス        | 4,100     | 2,114.00  | 8,667,400     | 貸付有価証券<br>900株    |
| 3222 | ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 102,800   | 1,113.00  | 114,416,400   | 貸付有価証券<br>12,700株 |
| 3319 | ゴルフダイジェスト・オンライン      | 14,300    | 1,490.00  | 21,307,000    | 貸付有価証券<br>2,500株  |
| 3328 | B E E N O S          | 17,900    | 1,962.00  | 35,119,800    | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 3333 | あさひ                  | 26,300    | 1,388.00  | 36,504,400    | 貸付有価証券<br>5,000株  |
| 3341 | 日本調剤                 | 21,400    | 1,170.00  | 25,038,000    | 貸付有価証券<br>4,200株  |
| 3349 | コスモス薬品               | 35,700    | 12,620.00 | 450,534,000   | 貸付有価証券<br>5,400株  |
| 3361 | トーエル                 | 9,300     | 740.00    | 6,882,000     | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| 3382 | セブン&アイ・ホールディングス      | 1,087,600 | 6,109.00  | 6,644,148,400 | 貸付有価証券<br>54,100株 |
| 3387 | クリエイト・レストランツ・ホールディング | 237,400   | 952.00    | 226,004,800   |                   |
| 3391 | ツルハホールディングス          | 77,300    | 9,390.00  | 725,847,000   | 貸付有価証券<br>5,200株  |
| 3395 | サンマルクホールディングス        | 25,400    | 1,748.00  | 44,399,200    | 貸付有価証券<br>5,200株  |
| 3396 | フェリシモ                | 4,700     | 998.00    | 4,690,600     | 貸付有価証券<br>500株    |
| 3397 | トリドールホールディングス        | 78,400    | 2,780.00  | 217,952,000   | 貸付有価証券<br>18,000株 |
| 3415 | T O K Y O B A S E    | 32,500    | 396.00    | 12,870,000    | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 3538 | ウイルプラスホールディングス       | 4,000     | 1,112.00  | 4,448,000     | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 3539 | J Mホールディングス          | 26,800    | 1,765.00  | 47,302,000    |                   |
| 3544 | サツドラホールディングス         | 9,500     | 761.00    | 7,229,500     | 貸付有価証券<br>2,400株  |

|      |                      |         |          |             |                   |
|------|----------------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| 3546 | アレンザホールディングス         | 23,600  | 1,036.00 | 24,449,600  | 貸付有価証券<br>400株    |
| 3547 | 串カツ田中ホールディングス        | 8,400   | 1,644.00 | 13,809,600  | 貸付有価証券<br>1,200株  |
| 3548 | バロックジャパンリミテッド        | 20,500  | 851.00   | 17,445,500  | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 3549 | クスリのアオキホールディングス      | 31,700  | 7,300.00 | 231,410,000 | 貸付有価証券<br>6,400株  |
| 3561 | 力の源ホールディングス          | 11,200  | 1,062.00 | 11,894,400  | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 3563 | FOOD & LIFE COMPANIE | 181,300 | 2,997.00 | 543,356,100 | 貸付有価証券<br>21,900株 |
| 4350 | メディカルシステムネットワーク      | 27,300  | 405.00   | 11,056,500  | 貸付有価証券<br>5,300株  |
| 7127 | 一家ホールディングス           | 4,500   | 639.00   | 2,875,500   | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 7135 | ジャパングラフトホールディングス     | 6,500   | 604.00   | 3,926,000   | 貸付有価証券<br>800株    |
| 7416 | はるやまホールディングス         | 9,900   | 433.00   | 4,286,700   | 貸付有価証券<br>2,500株  |
| 7419 | ノジマ                  | 103,000 | 1,354.00 | 139,462,000 | 貸付有価証券<br>20,800株 |
| 7421 | カッパ・クリエイト            | 49,600  | 1,421.00 | 70,481,600  | 貸付有価証券<br>7,000株  |
| 7445 | ライトオン                | 15,800  | 569.00   | 8,990,200   | 貸付有価証券<br>2,500株  |
| 7453 | 良品計画                 | 407,100 | 1,422.00 | 578,896,200 |                   |
| 7455 | パリミキホールディングス         | 26,100  | 272.00   | 7,099,200   | 貸付有価証券<br>7,200株  |
| 7463 | アドヴァングループ            | 30,000  | 885.00   | 26,550,000  | 貸付有価証券<br>9,200株  |
| 7475 | アルビス                 | 10,300  | 2,398.00 | 24,699,400  | 貸付有価証券<br>2,100株  |
| 7494 | コナカ                  | 22,800  | 341.00   | 7,774,800   | 貸付有価証券<br>7,900株  |
| 7506 | ハウス オブ ローゼ           | 2,600   | 1,638.00 | 4,258,800   | 貸付有価証券<br>300株    |
| 7508 | G-7ホールディングス          | 39,300  | 1,592.00 | 62,565,600  | 貸付有価証券<br>5,200株  |
| 7512 | イオン北海道               | 46,700  | 952.00   | 44,458,400  | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 7513 | コジマ                  | 60,800  | 564.00   | 34,291,200  | 貸付有価証券<br>4,500株  |
| 7514 | ヒマラヤ                 | 6,600   | 929.00   | 6,131,400   | 貸付有価証券<br>2,100株  |
| 7516 | コーナン商事               | 42,600  | 3,290.00 | 140,154,000 | 貸付有価証券<br>6,200株  |
| 7520 | エコス                  | 11,700  | 1,861.00 | 21,773,700  | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 7522 | ワタミ                  | 38,100  | 981.00   | 37,376,100  | 貸付有価証券<br>7,500株  |

|      |                                     |         |          |               |                   |
|------|-------------------------------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 7524 | マルシェ                                | 6,900   | 393.00   | 2,711,700     | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 7532 | パン・パシフィック・インターナショナルホ                | 707,700 | 2,428.00 | 1,718,295,600 | 貸付有価証券<br>66,400株 |
| 7545 | 西松屋チェーン                             | 69,900  | 1,501.00 | 104,919,900   | 貸付有価証券<br>6,600株  |
| 7550 | ゼンショーホールディングス                       | 172,700 | 3,290.00 | 568,183,000   | 貸付有価証券<br>27,400株 |
| 7554 | 幸楽苑ホールディングス                         | 20,600  | 1,081.00 | 22,268,600    | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| 7561 | ハークスレイ                              | 8,800   | 835.00   | 7,348,000     | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 7581 | サイゼリヤ                               | 52,500  | 3,155.00 | 165,637,500   | 貸付有価証券<br>9,500株  |
| 7593 | V Tホールディングス                         | 119,800 | 496.00   | 59,420,800    | 貸付有価証券<br>6,600株  |
| 7596 | 魚力                                  | 9,800   | 2,161.00 | 21,177,800    | 貸付有価証券<br>800株    |
| 7601 | ポプラ                                 | 4,600   | 140.00   | 644,000       | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 7605 | フジ・コーポレーション                         | 17,800  | 1,330.00 | 23,674,000    | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 7606 | ユナイテッドアローズ                          | 33,700  | 1,724.00 | 58,098,800    | 貸付有価証券<br>7,500株  |
| 7611 | ハイデイ日高                              | 46,800  | 2,035.00 | 95,238,000    | 貸付有価証券<br>10,500株 |
| 7615 | Y U - W A C r e a t i o n H o l d i | 12,400  | 201.00   | 2,492,400     | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| 7616 | コロワイド                               | 145,400 | 1,791.00 | 260,411,400   | 貸付有価証券<br>24,000株 |
| 7618 | ピーシーデポコーポレーション                      | 35,200  | 284.00   | 9,996,800     | 貸付有価証券<br>8,300株  |
| 7630 | 壱番屋                                 | 24,900  | 4,680.00 | 116,532,000   | 貸付有価証券<br>5,500株  |
| 7640 | トップカルチャー                            | 6,700   | 187.00   | 1,252,900     | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| 7646 | P L A N T                           | 4,900   | 672.00   | 3,292,800     | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 7649 | スギホールディングス                          | 63,600  | 5,650.00 | 359,340,000   | 貸付有価証券<br>5,600株  |
| 7679 | 薬王堂ホールディングス                         | 17,600  | 2,608.00 | 45,900,800    | 貸付有価証券<br>900株    |
| 7918 | ヴィア・ホールディングス                        | 27,800  | 99.00    | 2,752,200     | 貸付有価証券<br>6,600株  |
| 8005 | スクロール                               | 46,800  | 724.00   | 33,883,200    | 貸付有価証券<br>6,700株  |
| 8008 | ヨンドシーホールディングス                       | 27,100  | 1,779.00 | 48,210,900    |                   |
| 8160 | 木曽路                                 | 47,800  | 2,124.00 | 101,527,200   | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| 8163 | S R Sホールディングス                       | 52,000  | 888.00   | 46,176,000    | 貸付有価証券<br>5,100株  |

|      |                  |         |           |             |                   |
|------|------------------|---------|-----------|-------------|-------------------|
| 8165 | 千趣会              | 58,100  | 397.00    | 23,065,700  | 貸付有価証券<br>13,100株 |
| 8166 | タカキュー            | 14,300  | 77.00     | 1,101,100   | 貸付有価証券<br>5,000株  |
| 8167 | リテールパートナーズ       | 46,800  | 1,324.00  | 61,963,200  | 貸付有価証券<br>5,900株  |
| 8168 | ケーヨー             | 50,900  | 888.00    | 45,199,200  | 貸付有価証券<br>15,000株 |
| 8173 | 上新電機             | 28,100  | 1,962.00  | 55,132,200  | 貸付有価証券<br>7,100株  |
| 8174 | 日本瓦斯             | 169,100 | 2,038.00  | 344,625,800 |                   |
| 8179 | ロイヤルホールディングス     | 61,200  | 2,421.00  | 148,165,200 | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 8181 | 東天紅              | 1,500   | 759.00    | 1,138,500   | 貸付有価証券<br>100株    |
| 8182 | いなげや             | 30,700  | 1,284.00  | 39,418,800  | 貸付有価証券<br>5,400株  |
| 8185 | チヨダ              | 30,100  | 788.00    | 23,718,800  | 貸付有価証券<br>3,600株  |
| 8194 | ライフコーポレーション      | 27,600  | 2,739.00  | 75,596,400  | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 8200 | リンガーハット          | 40,700  | 2,253.00  | 91,697,100  | 貸付有価証券<br>6,900株  |
| 8203 | MrMaxHD          | 44,200  | 655.00    | 28,951,000  | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 8207 | テンアライド           | 21,200  | 263.00    | 5,575,600   | 貸付有価証券<br>8,300株  |
| 8214 | AOKIホールディングス     | 58,700  | 681.00    | 39,974,700  | 貸付有価証券<br>12,500株 |
| 8217 | オークワ             | 50,500  | 921.00    | 46,510,500  | 貸付有価証券<br>8,800株  |
| 8218 | コメリ              | 48,600  | 2,637.00  | 128,158,200 | 貸付有価証券<br>9,000株  |
| 8219 | 青山商事             | 67,500  | 878.00    | 59,265,000  | 貸付有価証券<br>5,600株  |
| 8227 | しまむら             | 37,100  | 12,160.00 | 451,136,000 |                   |
| 8230 | はせがわ             | 11,200  | 332.00    | 3,718,400   | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 8233 | 高島屋              | 237,900 | 1,813.00  | 431,312,700 | 貸付有価証券<br>11,500株 |
| 8237 | 松屋               | 53,500  | 1,128.00  | 60,348,000  | 貸付有価証券<br>14,300株 |
| 8242 | エイチ・ツー・オー リテイリング | 153,600 | 1,267.00  | 194,611,200 | 貸付有価証券<br>31,700株 |
| 8244 | 近鉄百貨店            | 10,100  | 2,572.00  | 25,977,200  | 貸付有価証券<br>2,400株  |
| 8252 | 丸井グループ           | 232,700 | 2,181.00  | 507,518,700 | 貸付有価証券<br>52,300株 |
| 8255 | アクシアル リテイリング     | 21,500  | 3,445.00  | 74,067,500  | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 8260 | 井筒屋              | 9,900   | 350.00    | 3,465,000   | 貸付有価証券<br>3,300株  |

|      |                                 |           |           |               |                    |
|------|---------------------------------|-----------|-----------|---------------|--------------------|
| 8267 | イオン                             | 1,069,800 | 2,616.00  | 2,798,596,800 | 貸付有価証券<br>258,300株 |
| 8273 | イズミ                             | 48,000    | 2,877.00  | 138,096,000   | 貸付有価証券<br>2,200株   |
| 8276 | 平和堂                             | 52,700    | 2,096.00  | 110,459,200   | 貸付有価証券<br>12,100株  |
| 8278 | フジ                              | 48,400    | 1,843.00  | 89,201,200    | 貸付有価証券<br>5,200株   |
| 8279 | ヤオコー                            | 35,700    | 6,690.00  | 238,833,000   | 貸付有価証券<br>7,500株   |
| 8281 | ゼビオホールディングス                     | 42,800    | 920.00    | 39,376,000    | 貸付有価証券<br>3,100株   |
| 8282 | ケーズホールディングス                     | 251,000   | 1,150.00  | 288,650,000   | 貸付有価証券<br>65,000株  |
| 8289 | O l y m p i cグループ               | 9,300     | 512.00    | 4,761,600     | 貸付有価証券<br>3,700株   |
| 8291 | 日産東京販売ホールディングス                  | 31,100    | 296.00    | 9,205,600     | 貸付有価証券<br>6,400株   |
| 9262 | シルバーライフ                         | 7,200     | 1,691.00  | 12,175,200    | 貸付有価証券<br>1,000株   |
| 9267 | G e n k y   D r u g S t o r e s | 15,500    | 3,640.00  | 56,420,000    | 貸付有価証券<br>3,000株   |
| 9275 | ナルミヤ・インターナショナル                  | 4,700     | 917.00    | 4,309,900     | 貸付有価証券<br>300株     |
| 9278 | ブックオフグループホールディングス               | 12,300    | 1,247.00  | 15,338,100    | 貸付有価証券<br>900株     |
| 9279 | ギフトホールディングス                     | 6,700     | 4,200.00  | 28,140,000    | 貸付有価証券<br>1,000株   |
| 9627 | アインホールディングス                     | 43,500    | 5,590.00  | 243,165,000   | 貸付有価証券<br>9,300株   |
| 9828 | 元気寿司                            | 9,900     | 3,035.00  | 30,046,500    | 貸付有価証券<br>1,700株   |
| 9831 | ヤマダホールディングス                     | 1,294,000 | 468.00    | 605,592,000   | 貸付有価証券<br>188,300株 |
| 9842 | アー克蘭ズ                           | 46,200    | 1,428.00  | 65,973,600    | 貸付有価証券<br>11,000株  |
| 9843 | ニトリホールディングス                     | 127,700   | 16,790.00 | 2,144,083,000 |                    |
| 9850 | グルメ杵屋                           | 25,600    | 1,009.00  | 25,830,400    | 貸付有価証券<br>5,100株   |
| 9854 | 愛眼                              | 15,500    | 166.00    | 2,573,000     | 貸付有価証券<br>6,400株   |
| 9856 | ケーユーホールディングス                    | 18,500    | 1,401.00  | 25,918,500    | 貸付有価証券<br>3,100株   |
| 9861 | 吉野家ホールディングス                     | 123,500   | 2,343.00  | 289,360,500   | 貸付有価証券<br>22,900株  |
| 9887 | 松屋フーズホールディングス                   | 14,900    | 3,960.00  | 59,004,000    | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 9900 | サガミホールディングス                     | 50,700    | 1,229.00  | 62,310,300    | 貸付有価証券<br>8,100株   |
| 9919 | 関西フードマーケット                      | 28,500    | 1,315.00  | 37,477,500    | 貸付有価証券<br>4,900株   |



|      |                     |           |           |               |                    |
|------|---------------------|-----------|-----------|---------------|--------------------|
| 9936 | 王将フードサービス           | 20,800    | 5,920.00  | 123,136,000   | 貸付有価証券<br>4,600株   |
| 9945 | プレナス                | 9,900     | 2,634.00  | 26,076,600    |                    |
| 9946 | ミニストップ              | 22,900    | 1,406.00  | 32,197,400    | 貸付有価証券<br>1,000株   |
| 9948 | アークス                | 57,900    | 2,135.00  | 123,616,500   | 貸付有価証券<br>13,200株  |
| 9956 | バローホールディングス         | 60,200    | 1,822.00  | 109,684,400   | 貸付有価証券<br>9,700株   |
| 9974 | ベルク                 | 15,700    | 5,450.00  | 85,565,000    | 貸付有価証券<br>2,200株   |
| 9979 | 大庄                  | 11,300    | 1,038.00  | 11,729,400    | 貸付有価証券<br>3,900株   |
| 9983 | ファーストリテイリング         | 47,300    | 77,330.00 | 3,657,709,000 | 貸付有価証券<br>5,800株   |
| 9989 | サンドラッグ              | 119,800   | 3,600.00  | 431,280,000   |                    |
| 9990 | サックスパー ホールディングス     | 30,000    | 757.00    | 22,710,000    | 貸付有価証券<br>5,300株   |
| 9993 | ヤマザワ                | 4,400     | 1,314.00  | 5,781,600     | 貸付有価証券<br>1,400株   |
| 9994 | やまや                 | 4,300     | 2,512.00  | 10,801,600    | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 9997 | ベルーナ                | 75,900    | 697.00    | 52,902,300    | 貸付有価証券<br>9,400株   |
| 5830 | いよぎんホールディングス        | 349,600   | 720.00    | 251,712,000   | 貸付有価証券<br>62,100株  |
| 5831 | しずおかフィナンシャルグループ     | 663,800   | 1,072.00  | 711,593,600   | 貸付有価証券<br>134,100株 |
| 5832 | ちゅうぎんフィナンシャルグループ    | 247,300   | 944.00    | 233,451,200   | 貸付有価証券<br>37,600株  |
| 7150 | 島根銀行                | 6,700     | 490.00    | 3,283,000     | 貸付有価証券<br>1,100株   |
| 7161 | じもとホールディングス         | 14,000    | 440.00    | 6,160,000     | 貸付有価証券<br>4,300株   |
| 7167 | めぶきフィナンシャルグループ      | 1,457,700 | 326.00    | 475,210,200   | 貸付有価証券<br>319,900株 |
| 7173 | 東京きらぼしフィナンシャルグループ   | 37,600    | 2,845.00  | 106,972,000   |                    |
| 7180 | 九州フィナンシャルグループ       | 516,900   | 467.00    | 241,392,300   | 貸付有価証券<br>87,500株  |
| 7182 | ゆうちょ銀行              | 836,500   | 1,140.00  | 953,610,000   | 貸付有価証券<br>174,400株 |
| 7184 | 富山第一銀行              | 73,200    | 632.00    | 46,262,400    | 貸付有価証券<br>15,100株  |
| 7186 | コンコルディア・フィナンシャルグループ | 1,619,100 | 572.00    | 926,125,200   |                    |
| 7189 | 西日本フィナンシャルホールディングス  | 186,000   | 1,050.00  | 195,300,000   | 貸付有価証券<br>29,600株  |
| 7322 | 三十三フィナンシャルグループ      | 26,300    | 1,630.00  | 42,869,000    |                    |
| 7327 | 第四北越フィナンシャルグループ     | 46,100    | 2,880.00  | 132,768,000   | 貸付有価証券<br>13,000株  |

|      |                   |            |          |                |                      |
|------|-------------------|------------|----------|----------------|----------------------|
| 7337 | ひろぎんホールディングス      | 383,300    | 662.00   | 253,744,600    | 貸付有価証券<br>64,400株    |
| 7350 | おきなわフィナンシャルグループ   | 28,000     | 2,340.00 | 65,520,000     | 貸付有価証券<br>2,700株     |
| 7380 | 十六フィナンシャルグループ     | 38,100     | 3,025.00 | 115,252,500    |                      |
| 7381 | 北國フィナンシャルホールディングス | 24,800     | 4,135.00 | 102,548,000    |                      |
| 7384 | プロクレアホールディングス     | 36,000     | 2,250.00 | 81,000,000     | 貸付有価証券<br>3,000株     |
| 7389 | あいちフィナンシャルグループ    | 41,100     | 2,301.00 | 94,571,100     | 貸付有価証券<br>4,700株     |
| 8303 | ＳＢＩ新生銀行           | 86,700     | 2,367.00 | 205,218,900    | 貸付有価証券<br>10,900株    |
| 8304 | あおぞら銀行            | 184,700    | 2,600.00 | 480,220,000    | 貸付有価証券<br>9,700株     |
| 8306 | 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ | 18,651,800 | 952.00   | 17,756,513,600 | 貸付有価証券<br>3,005,600株 |
| 8308 | りそなホールディングス       | 3,749,300  | 732.80   | 2,747,487,040  | 貸付有価証券<br>479,100株   |
| 8309 | 三井住友トラスト・ホールディングス | 533,900    | 4,757.00 | 2,539,762,300  | 貸付有価証券<br>119,300株   |
| 8316 | 三井住友フィナンシャルグループ   | 2,146,700  | 5,646.00 | 12,120,268,200 | 貸付有価証券<br>92,400株    |
| 8331 | 千葉銀行              | 818,700    | 969.00   | 793,320,300    | 貸付有価証券<br>222,200株   |
| 8334 | 群馬銀行              | 570,000    | 490.00   | 279,300,000    | 貸付有価証券<br>83,000株    |
| 8336 | 武蔵野銀行             | 37,700     | 2,186.00 | 82,412,200     | 貸付有価証券<br>100株       |
| 8337 | 千葉興業銀行            | 45,600     | 483.00   | 22,024,800     | 貸付有価証券<br>17,700株    |
| 8338 | 筑波銀行              | 128,900    | 236.00   | 30,420,400     | 貸付有価証券<br>29,700株    |
| 8341 | 七十七銀行             | 94,100     | 2,177.00 | 204,855,700    | 貸付有価証券<br>15,500株    |
| 8343 | 秋田銀行              | 19,700     | 1,819.00 | 35,834,300     | 貸付有価証券<br>1,900株     |
| 8344 | 山形銀行              | 32,600     | 1,260.00 | 41,076,000     | 貸付有価証券<br>7,100株     |
| 8345 | 岩手銀行              | 20,100     | 2,056.00 | 41,325,600     | 貸付有価証券<br>4,100株     |
| 8346 | 東邦銀行              | 232,400    | 241.00   | 56,008,400     | 貸付有価証券<br>26,000株    |
| 8349 | 東北銀行              | 9,500      | 1,029.00 | 9,775,500      | 貸付有価証券<br>3,300株     |
| 8354 | ふくおかフィナンシャルグループ   | 234,500    | 3,000.00 | 703,500,000    | 貸付有価証券<br>63,500株    |
| 8358 | スルガ銀行             | 258,900    | 422.00   | 109,255,800    | 貸付有価証券<br>74,700株    |
| 8359 | 八十二銀行             | 602,600    | 549.00   | 330,827,400    | 貸付有価証券<br>105,400株   |
| 8360 | 山梨中央銀行            | 30,200     | 1,188.00 | 35,877,600     | 貸付有価証券<br>3,200株     |

|      |                 |           |          |               |                   |
|------|-----------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 8361 | 大垣共立銀行          | 56,000    | 1,911.00 | 107,016,000   | 貸付有価証券<br>7,800株  |
| 8362 | 福井銀行            | 26,300    | 1,608.00 | 42,290,400    | 貸付有価証券<br>3,800株  |
| 8364 | 清水銀行            | 11,700    | 1,545.00 | 18,076,500    | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 8365 | 富山銀行            | 3,300     | 1,790.00 | 5,907,000     | 貸付有価証券<br>800株    |
| 8366 | 滋賀銀行            | 48,900    | 2,777.00 | 135,795,300   | 貸付有価証券<br>8,700株  |
| 8367 | 南都銀行            | 44,200    | 2,627.00 | 116,113,400   |                   |
| 8368 | 百五銀行            | 276,400   | 408.00   | 112,771,200   | 貸付有価証券<br>9,000株  |
| 8369 | 京都銀行            | 93,100    | 5,940.00 | 553,014,000   | 貸付有価証券<br>15,700株 |
| 8370 | 紀陽銀行            | 105,100   | 1,598.00 | 167,949,800   |                   |
| 8377 | ほくほくフィナンシャルグループ | 186,700   | 1,017.00 | 189,873,900   | 貸付有価証券<br>5,000株  |
| 8381 | 山陰合同銀行          | 183,800   | 782.00   | 143,731,600   | 貸付有価証券<br>3,800株  |
| 8383 | 鳥取銀行            | 6,700     | 1,172.00 | 7,852,400     | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 8386 | 百十四銀行           | 26,800    | 2,004.00 | 53,707,200    |                   |
| 8387 | 四国銀行            | 46,700    | 984.00   | 45,952,800    | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 8388 | 阿波銀行            | 43,400    | 2,127.00 | 92,311,800    | 貸付有価証券<br>7,100株  |
| 8392 | 大分銀行            | 17,700    | 2,115.00 | 37,435,500    |                   |
| 8393 | 宮崎銀行            | 19,200    | 2,583.00 | 49,593,600    | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| 8395 | 佐賀銀行            | 17,200    | 1,789.00 | 30,770,800    |                   |
| 8399 | 琉球銀行            | 67,300    | 936.00   | 62,992,800    |                   |
| 8410 | セブン銀行           | 1,052,300 | 264.00   | 277,807,200   | 貸付有価証券<br>76,700株 |
| 8411 | みずほフィナンシャルグループ  | 4,248,400 | 2,018.50 | 8,575,395,400 |                   |
| 8416 | 高知銀行            | 6,700     | 724.00   | 4,850,800     | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 8418 | 山口フィナンシャルグループ   | 324,300   | 880.00   | 285,384,000   | 貸付有価証券<br>54,500株 |
| 8521 | 長野銀行            | 6,500     | 1,386.00 | 9,009,000     | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 8522 | 名古屋銀行           | 19,400    | 3,480.00 | 67,512,000    | 貸付有価証券<br>3,500株  |
| 8524 | 北洋銀行            | 445,100   | 274.00   | 121,957,400   | 貸付有価証券<br>35,800株 |
| 8537 | 大光銀行            | 6,300     | 1,227.00 | 7,730,100     | 貸付有価証券<br>2,400株  |
| 8541 | 愛媛銀行            | 39,600    | 920.00   | 36,432,000    | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 8542 | トマト銀行           | 6,400     | 1,051.00 | 6,726,400     |                   |

|      |                          |           |          |               |                    |
|------|--------------------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 8544 | 京葉銀行                     | 136,500   | 599.00   | 81,763,500    | 貸付有価証券<br>31,600株  |
| 8550 | 栃木銀行                     | 134,500   | 306.00   | 41,157,000    | 貸付有価証券<br>31,600株  |
| 8551 | 北日本銀行                    | 10,300    | 2,165.00 | 22,299,500    | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 8558 | 東和銀行                     | 53,900    | 612.00   | 32,986,800    | 貸付有価証券<br>11,100株  |
| 8562 | 福島銀行                     | 22,400    | 257.00   | 5,756,800     | 貸付有価証券<br>6,300株   |
| 8563 | 大東銀行                     | 9,300     | 746.00   | 6,937,800     | 貸付有価証券<br>3,300株   |
| 8600 | トモニホールディングス              | 237,400   | 384.00   | 91,161,600    | 貸付有価証券<br>57,800株  |
| 8713 | フィデアホールディングス             | 30,400    | 1,447.00 | 43,988,800    | 貸付有価証券<br>1,100株   |
| 8714 | 池田泉州ホールディングス             | 376,100   | 248.00   | 93,272,800    | 貸付有価証券<br>50,000株  |
| 7148 | F P G                    | 119,200   | 1,080.00 | 128,736,000   | 貸付有価証券<br>4,500株   |
| 7172 | ジャパンインベストメントアドバイ<br>ザー   | 24,000    | 1,201.00 | 28,824,000    | 貸付有価証券<br>2,500株   |
| 7347 | マーキュリアホールディングス           | 11,400    | 703.00   | 8,014,200     | 貸付有価証券<br>2,300株   |
| 8473 | S B I ホールディングス           | 425,200   | 2,769.00 | 1,177,378,800 | 貸付有価証券<br>57,300株  |
| 8518 | 日本アジア投資                  | 16,700    | 229.00   | 3,824,300     | 貸付有価証券<br>5,200株   |
| 8595 | ジャフコ グループ                | 98,100    | 2,423.00 | 237,696,300   | 貸付有価証券<br>28,800株  |
| 8601 | 大和証券グループ本社               | 2,100,600 | 605.00   | 1,270,863,000 | 貸付有価証券<br>534,400株 |
| 8604 | 野村ホールディングス               | 5,410,100 | 516.00   | 2,791,611,600 | 貸付有価証券<br>195,600株 |
| 8609 | 岡三証券グループ                 | 257,900   | 428.00   | 110,381,200   | 貸付有価証券<br>53,200株  |
| 8613 | 丸三証券                     | 97,700    | 426.00   | 41,620,200    | 貸付有価証券<br>22,500株  |
| 8614 | 東洋証券                     | 97,400    | 283.00   | 27,564,200    | 貸付有価証券<br>22,600株  |
| 8616 | 東海東京フィナンシャル・ホールディ<br>ングス | 319,700   | 380.00   | 121,486,000   | 貸付有価証券<br>74,100株  |
| 8617 | 光世証券                     | 4,400     | 367.00   | 1,614,800     | 貸付有価証券<br>1,500株   |
| 8622 | 水戸証券                     | 78,800    | 310.00   | 24,428,000    | 貸付有価証券<br>21,000株  |
| 8624 | いちよし証券                   | 54,100    | 628.00   | 33,974,800    | 貸付有価証券<br>14,200株  |
| 8628 | 松井証券                     | 173,500   | 772.00   | 133,942,000   | 貸付有価証券<br>41,300株  |
| 8698 | マネックスグループ                | 328,100   | 488.00   | 160,112,800   | 貸付有価証券<br>5,000株   |

|      |                            |           |          |               |                    |
|------|----------------------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 8706 | 極東証券                       | 36,600    | 599.00   | 21,923,400    | 貸付有価証券<br>3,200株   |
| 8707 | 岩井コスモホールディングス              | 33,500    | 1,372.00 | 45,962,000    | 貸付有価証券<br>7,100株   |
| 8708 | アイザワ証券グループ                 | 42,400    | 710.00   | 30,104,000    | 貸付有価証券<br>10,800株  |
| 8732 | マネーパートナーズグループ              | 22,500    | 267.00   | 6,007,500     | 貸付有価証券<br>6,800株   |
| 8739 | スパークス・グループ                 | 32,700    | 1,760.00 | 57,552,000    | 貸付有価証券<br>4,700株   |
| 8742 | 小林洋行                       | 7,500     | 222.00   | 1,665,000     | 貸付有価証券<br>1,800株   |
| 7181 | かんぽ生命保険                    | 356,700   | 2,327.00 | 830,040,900   | 貸付有価証券<br>1,700株   |
| 8630 | SOMPOホールディングス              | 504,200   | 5,742.00 | 2,895,116,400 | 貸付有価証券<br>6,200株   |
| 8715 | アニコム ホールディングス              | 99,800    | 624.00   | 62,275,200    | 貸付有価証券<br>19,200株  |
| 8725 | MS & ADインシュアランスグループ<br>ホール | 597,800   | 4,255.00 | 2,543,639,000 | 貸付有価証券<br>21,100株  |
| 8750 | 第一生命ホールディングス               | 1,495,400 | 3,061.00 | 4,577,419,400 | 貸付有価証券<br>22,500株  |
| 8766 | 東京海上ホールディングス               | 2,958,100 | 2,769.00 | 8,190,978,900 | 貸付有価証券<br>684,600株 |
| 8795 | T & Dホールディングス              | 788,400   | 2,046.00 | 1,613,066,400 | 貸付有価証券<br>198,900株 |
| 8798 | アドバンスクリエイト                 | 17,000    | 1,154.00 | 19,618,000    | 貸付有価証券<br>800株     |
| 7164 | 全国保証                       | 76,800    | 4,905.00 | 376,704,000   | 貸付有価証券<br>17,100株  |
| 7183 | あんしん保証                     | 8,400     | 270.00   | 2,268,000     | 貸付有価証券<br>2,300株   |
| 7187 | ジェイリース                     | 7,100     | 2,598.00 | 18,445,800    | 貸付有価証券<br>600株     |
| 7191 | イントラスト                     | 8,900     | 865.00   | 7,698,500     | 貸付有価証券<br>2,200株   |
| 7192 | 日本モーゲージサービス                | 11,700    | 875.00   | 10,237,500    | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 7196 | C a s a                    | 7,500     | 875.00   | 6,562,500     | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 7198 | アルヒ                        | 36,200    | 1,021.00 | 36,960,200    |                    |
| 7199 | プレミアムグループ                  | 49,300    | 1,616.00 | 79,668,800    | 貸付有価証券<br>10,200株  |
| 7383 | ネットプロテクションズホールディン<br>グス    | 97,000    | 563.00   | 54,611,000    | 貸付有価証券<br>6,600株   |
| 8253 | クレディセゾン                    | 186,200   | 1,686.00 | 313,933,200   | 貸付有価証券<br>30,600株  |
| 8424 | 芙蓉総合リース                    | 27,000    | 8,810.00 | 237,870,000   | 貸付有価証券<br>5,300株   |
| 8425 | みずほリース                     | 43,700    | 3,410.00 | 149,017,000   | 貸付有価証券<br>2,900株   |

|      |                  |           |           |               |                    |
|------|------------------|-----------|-----------|---------------|--------------------|
| 8439 | 東京センチュリー         | 54,900    | 4,480.00  | 245,952,000   | 貸付有価証券<br>16,500株  |
| 8511 | 日本証券金融           | 117,800   | 1,152.00  | 135,705,600   | 貸付有価証券<br>30,700株  |
| 8515 | アイフル             | 486,500   | 388.00    | 188,762,000   | 貸付有価証券<br>66,600株  |
| 8566 | リコーリース           | 27,900    | 3,785.00  | 105,601,500   | 貸付有価証券<br>1,100株   |
| 8570 | イオンフィナンシャルサービス   | 168,700   | 1,308.00  | 220,659,600   | 貸付有価証券<br>36,800株  |
| 8572 | アコム              | 523,100   | 317.00    | 165,822,700   | 貸付有価証券<br>48,100株  |
| 8584 | ジャックス            | 31,300    | 4,100.00  | 128,330,000   | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 8585 | オリエントコーポレーション    | 76,700    | 1,169.00  | 89,662,300    | 貸付有価証券<br>12,300株  |
| 8591 | オリックス            | 1,964,900 | 2,265.50  | 4,451,480,950 | 貸付有価証券<br>132,000株 |
| 8593 | 三菱ＨＣキャピタル        | 1,145,300 | 665.00    | 761,624,500   | 貸付有価証券<br>6,300株   |
| 8596 | 九州リースサービス        | 9,100     | 769.00    | 6,997,900     | 貸付有価証券<br>2,200株   |
| 8697 | 日本取引所グループ        | 825,400   | 1,901.00  | 1,569,085,400 | 貸付有価証券<br>47,000株  |
| 8771 | イー・ギャランティ        | 47,400    | 2,399.00  | 113,712,600   | 貸付有価証券<br>4,600株   |
| 8772 | アサックス            | 11,000    | 609.00    | 6,699,000     | 貸付有価証券<br>3,100株   |
| 8793 | ＮＥＣキャピタルソリューション  | 14,400    | 2,268.00  | 32,659,200    | 貸付有価証券<br>2,700株   |
| 1878 | 大東建託             | 107,600   | 14,340.00 | 1,542,984,000 |                    |
| 2337 | いちご              | 338,200   | 298.00    | 100,783,600   | 貸付有価証券<br>20,300株  |
| 2353 | 日本駐車場開発          | 349,700   | 258.00    | 90,222,600    | 貸付有価証券<br>35,700株  |
| 2975 | スター・マイカ・ホールディングス | 26,500    | 705.00    | 18,682,500    | 貸付有価証券<br>7,600株   |
| 2980 | ＳＲＥホールディングス      | 14,400    | 3,955.00  | 56,952,000    | 貸付有価証券<br>1,000株   |
| 2982 | ＡＤワークスグループ       | 47,400    | 142.00    | 6,730,800     | 貸付有価証券<br>11,700株  |
| 3003 | ヒューリック           | 685,200   | 1,051.00  | 720,145,200   | 貸付有価証券<br>140,800株 |
| 3228 | 三栄建築設計           | 14,200    | 1,481.00  | 21,030,200    | 貸付有価証券<br>700株     |
| 3231 | 野村不動産ホールディングス    | 183,600   | 2,908.00  | 533,908,800   | 貸付有価証券<br>26,600株  |
| 3232 | 三重交通グループホールディングス | 62,800    | 500.00    | 31,400,000    | 貸付有価証券<br>8,900株   |
| 3244 | サムティ             | 46,700    | 2,054.00  | 95,921,800    | 貸付有価証券<br>8,600株   |

|      |                |         |          |             |                    |
|------|----------------|---------|----------|-------------|--------------------|
| 3245 | ディア・ライフ        | 45,100  | 625.00   | 28,187,500  | 貸付有価証券<br>6,800株   |
| 3246 | コーセーアールイー      | 6,200   | 894.00   | 5,542,800   | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 3252 | 地主             | 22,400  | 1,868.00 | 41,843,200  | 貸付有価証券<br>3,400株   |
| 3254 | プレサンスコーポレーション  | 38,600  | 1,629.00 | 62,879,400  | 貸付有価証券<br>13,900株  |
| 3271 | THEグローバル社      | 11,300  | 228.00   | 2,576,400   | 貸付有価証券<br>3,000株   |
| 3275 | ハウスコム          | 3,700   | 1,100.00 | 4,070,000   | 貸付有価証券<br>900株     |
| 3276 | JPMC           | 14,900  | 1,010.00 | 15,049,000  | 貸付有価証券<br>3,500株   |
| 3277 | サンセイランディック     | 5,700   | 817.00   | 4,656,900   | 貸付有価証券<br>1,600株   |
| 3280 | エストラスト         | 2,500   | 604.00   | 1,510,000   | 貸付有価証券<br>900株     |
| 3284 | フージャースホールディングス | 45,300  | 784.00   | 35,515,200  | 貸付有価証券<br>14,200株  |
| 3288 | オープンハウスグループ    | 107,500 | 5,030.00 | 540,725,000 | 貸付有価証券<br>17,800株  |
| 3289 | 東急不動産ホールディングス  | 883,200 | 655.00   | 578,496,000 | 貸付有価証券<br>118,700株 |
| 3291 | 飯田グループホールディングス | 257,300 | 2,148.00 | 552,680,400 | 貸付有価証券<br>37,200株  |
| 3294 | イーグランド         | 3,000   | 1,548.00 | 4,644,000   | 貸付有価証券<br>700株     |
| 3299 | ムゲンエステート       | 13,000  | 497.00   | 6,461,000   | 貸付有価証券<br>3,600株   |
| 3452 | ビーロット          | 13,300  | 532.00   | 7,075,600   | 貸付有価証券<br>3,000株   |
| 3454 | ファーストブラザーズ     | 3,900   | 862.00   | 3,361,800   | 貸付有価証券<br>1,400株   |
| 3457 | And Doホールディングス | 17,500  | 830.00   | 14,525,000  | 貸付有価証券<br>2,800株   |
| 3458 | シーアールイー        | 13,400  | 1,112.00 | 14,900,800  | 貸付有価証券<br>1,500株   |
| 3464 | プロパティエージェント    | 2,500   | 1,209.00 | 3,022,500   | 貸付有価証券<br>900株     |
| 3465 | ケイアイスター不動産     | 14,200  | 4,835.00 | 68,657,000  | 貸付有価証券<br>1,700株   |
| 3467 | アグレ都市デザイン      | 3,500   | 1,588.00 | 5,558,000   | 貸付有価証券<br>1,000株   |
| 3475 | グッドコムアセット      | 27,200  | 780.00   | 21,216,000  | 貸付有価証券<br>5,600株   |
| 3480 | ジェイ・エス・ビー      | 7,300   | 4,110.00 | 30,003,000  | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 3482 | ロードスターキャピタル    | 12,600  | 1,625.00 | 20,475,000  | 貸付有価証券<br>700株     |
| 3484 | テンポイノベーション     | 5,900   | 1,049.00 | 6,189,100   | 貸付有価証券<br>1,400株   |

|      |                       |           |          |               |                   |
|------|-----------------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 3486 | グローバル・リンク・マネジメント      | 3,700     | 1,156.00 | 4,277,200     | 貸付有価証券<br>900株    |
| 3489 | フェイスネットワーク            | 2,700     | 1,382.00 | 3,731,400     | 貸付有価証券<br>500株    |
| 4666 | パーク 2 4               | 228,900   | 2,257.00 | 516,627,300   | 貸付有価証券<br>39,600株 |
| 4809 | パラカ                   | 10,300    | 1,903.00 | 19,600,900    | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 6620 | 宮越ホールディングス            | 13,400    | 940.00   | 12,596,000    | 貸付有価証券<br>2,300株  |
| 8801 | 三井不動産                 | 1,276,700 | 2,445.00 | 3,121,531,500 | 貸付有価証券<br>3,400株  |
| 8802 | 三菱地所                  | 1,772,500 | 1,685.00 | 2,986,662,500 | 貸付有価証券<br>9,400株  |
| 8803 | 平和不動産                 | 47,700    | 3,700.00 | 176,490,000   | 貸付有価証券<br>4,800株  |
| 8804 | 東京建物                  | 280,000   | 1,621.00 | 453,880,000   | 貸付有価証券<br>15,100株 |
| 8818 | 京阪神ビルディング             | 37,100    | 1,361.00 | 50,493,100    | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 8830 | 住友不動産                 | 531,000   | 3,194.00 | 1,696,014,000 | 貸付有価証券<br>45,000株 |
| 8841 | テーオーシー                | 53,100    | 672.00   | 35,683,200    | 貸付有価証券<br>11,200株 |
| 8842 | 東京楽天地                 | 5,100     | 4,220.00 | 21,522,000    | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 8848 | レオパレス 2 1             | 330,700   | 326.00   | 107,808,200   | 貸付有価証券<br>68,400株 |
| 8850 | スターツコーポレーション          | 42,200    | 2,557.00 | 107,905,400   | 貸付有価証券<br>2,400株  |
| 8860 | フジ住宅                  | 41,100    | 687.00   | 28,235,700    |                   |
| 8864 | 空港施設                  | 35,500    | 530.00   | 18,815,000    | 貸付有価証券<br>6,700株  |
| 8869 | 明和地所                  | 9,900     | 864.00   | 8,553,600     | 貸付有価証券<br>4,200株  |
| 8871 | ゴールドクレスト              | 27,900    | 1,733.00 | 48,350,700    | 貸付有価証券<br>4,400株  |
| 8877 | エスリード                 | 13,800    | 2,048.00 | 28,262,400    | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 8881 | 日神グループホールディングス        | 47,100    | 452.00   | 21,289,200    | 貸付有価証券<br>10,400株 |
| 8892 | 日本エスコン                | 66,000    | 787.00   | 51,942,000    | 貸付有価証券<br>3,100株  |
| 8897 | M I R A R T Hホールディングス | 148,500   | 383.00   | 56,875,500    | 貸付有価証券<br>10,200株 |
| 8904 | A V A N T I A         | 9,900     | 796.00   | 7,880,400     | 貸付有価証券<br>3,500株  |
| 8905 | イオンモール                | 152,300   | 1,828.00 | 278,404,400   | 貸付有価証券<br>16,200株 |
| 8908 | 毎日コムネット               | 7,200     | 675.00   | 4,860,000     | 貸付有価証券<br>1,400株  |



|      |                   |           |          |             |                    |
|------|-------------------|-----------|----------|-------------|--------------------|
| 8917 | ファースト住建           | 7,900     | 1,026.00 | 8,105,400   | 貸付有価証券<br>2,700株   |
| 8918 | ランド               | 1,768,000 | 9.00     | 15,912,000  | 貸付有価証券<br>109,200株 |
| 8919 | カチタス              | 79,000    | 3,080.00 | 243,320,000 | 貸付有価証券<br>14,500株  |
| 8923 | トーセイ              | 48,900    | 1,473.00 | 72,029,700  | 貸付有価証券<br>2,900株   |
| 8928 | 穴吹興産              | 4,600     | 1,999.00 | 9,195,400   | 貸付有価証券<br>1,400株   |
| 8934 | サンフロンティア不動産       | 48,900    | 1,116.00 | 54,572,400  | 貸付有価証券<br>8,200株   |
| 8935 | F J ネクストホールディングス  | 30,900    | 1,011.00 | 31,239,900  | 貸付有価証券<br>5,000株   |
| 8940 | インテリックス           | 4,700     | 525.00   | 2,467,500   | 貸付有価証券<br>1,800株   |
| 8944 | ランドビジネス           | 7,100     | 230.00   | 1,633,000   | 貸付有価証券<br>700株     |
| 8945 | サンネクスタグループ        | 6,400     | 909.00   | 5,817,600   | 貸付有価証券<br>1,700株   |
| 8999 | グランディハウス          | 14,400    | 576.00   | 8,294,400   | 貸付有価証券<br>4,200株   |
| 9706 | 日本空港ビルデング         | 103,900   | 6,870.00 | 713,793,000 | 貸付有価証券<br>23,100株  |
| 1717 | 明豊ファシリティワークス      | 9,300     | 713.00   | 6,630,900   | 貸付有価証券<br>2,700株   |
| 1954 | 日本工営              | 21,800    | 3,485.00 | 75,973,000  | 貸付有価証券<br>2,800株   |
| 2120 | L I F U L L       | 104,800   | 220.00   | 23,056,000  | 貸付有価証券<br>21,200株  |
| 2121 | M I X I           | 69,800    | 2,514.00 | 175,477,200 | 貸付有価証券<br>11,900株  |
| 2124 | ジェイエイシーリクルートメント   | 27,700    | 2,410.00 | 66,757,000  | 貸付有価証券<br>4,100株   |
| 2127 | 日本M&Aセンターホールディングス | 526,100   | 1,747.00 | 919,096,700 | 貸付有価証券<br>83,600株  |
| 2130 | メンバーズ             | 8,900     | 1,993.00 | 17,737,700  | 貸付有価証券<br>2,300株   |
| 2139 | 中広                | 3,300     | 375.00   | 1,237,500   | 貸付有価証券<br>700株     |
| 2146 | U T グループ          | 45,000    | 2,597.00 | 116,865,000 | 貸付有価証券<br>9,800株   |
| 2148 | アイティメディア          | 11,600    | 1,600.00 | 18,560,000  | 貸付有価証券<br>1,600株   |
| 2153 | E ・ J ホールディングス    | 19,700    | 1,334.00 | 26,279,800  | 貸付有価証券<br>1,400株   |
| 2154 | オープンアップグループ       | 112,000   | 1,915.00 | 214,480,000 | 貸付有価証券<br>6,200株   |
| 2157 | コシダカホールディングス      | 91,800    | 894.00   | 82,069,200  | 貸付有価証券<br>4,600株   |
| 2163 | アルトナー             | 4,900     | 1,016.00 | 4,978,400   | 貸付有価証券<br>400株     |

|      |                  |         |          |             |                   |
|------|------------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| 2168 | パソナグループ          | 37,200  | 2,086.00 | 77,599,200  | 貸付有価証券<br>7,000株  |
| 2169 | C D S            | 5,100   | 1,758.00 | 8,965,800   | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 2170 | リンクアンドモチベーション    | 88,300  | 646.00   | 57,041,800  | 貸付有価証券<br>14,300株 |
| 2175 | エス・エム・エス         | 116,600 | 3,415.00 | 398,189,000 | 貸付有価証券<br>13,300株 |
| 2180 | サニーサイドアップグループ    | 7,100   | 549.00   | 3,897,900   | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 2181 | パーソルホールディングス     | 343,200 | 2,855.00 | 979,836,000 | 貸付有価証券<br>55,500株 |
| 2183 | リニカル             | 11,500  | 717.00   | 8,245,500   | 貸付有価証券<br>3,300株  |
| 2193 | クックパッド           | 83,900  | 221.00   | 18,541,900  | 貸付有価証券<br>17,600株 |
| 2196 | エスクリ             | 9,200   | 316.00   | 2,907,200   | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 2198 | アイ・ケイ・ケイホールディングス | 10,000  | 619.00   | 6,190,000   | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 2301 | 学情               | 13,900  | 1,427.00 | 19,835,300  | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| 2305 | スタジオアリス          | 15,300  | 2,160.00 | 33,048,000  | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 2309 | シミックホールディングス     | 16,900  | 1,770.00 | 29,913,000  | 貸付有価証券<br>3,500株  |
| 2311 | エプコ              | 4,300   | 771.00   | 3,315,300   | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 2325 | N J S            | 6,700   | 2,190.00 | 14,673,000  | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 2331 | 総合警備保障           | 113,800 | 3,515.00 | 400,007,000 | 貸付有価証券<br>24,400株 |
| 2371 | カカクコム            | 229,000 | 2,167.00 | 496,243,000 | 貸付有価証券<br>45,200株 |
| 2372 | アイロムグループ         | 11,000  | 2,365.00 | 26,015,000  | 貸付有価証券<br>2,500株  |
| 2374 | セントケア・ホールディング    | 19,500  | 829.00   | 16,165,500  | 貸付有価証券<br>4,000株  |
| 2376 | サイネックス           | 3,500   | 566.00   | 1,981,000   | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 2378 | ルネサンス            | 21,500  | 923.00   | 19,844,500  | 貸付有価証券<br>3,600株  |
| 2379 | ディップ             | 53,700  | 3,885.00 | 208,624,500 | 貸付有価証券<br>2,500株  |
| 2389 | デジタルホールディングス     | 23,900  | 1,272.00 | 30,400,800  | 貸付有価証券<br>3,500株  |
| 2395 | 新日本科学            | 32,500  | 2,322.00 | 75,465,000  | 貸付有価証券<br>4,600株  |
| 2410 | キャリアデザインセンター     | 4,200   | 1,453.00 | 6,102,600   | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 2412 | ベネフィット・ワン        | 142,100 | 2,132.00 | 302,957,200 | 貸付有価証券<br>18,800株 |

|      |                  |         |          |               |                    |
|------|------------------|---------|----------|---------------|--------------------|
| 2413 | エムスリー            | 605,800 | 3,599.00 | 2,180,274,200 | 貸付有価証券<br>124,300株 |
| 2418 | ツカダ・グローバルホールディング | 13,100  | 379.00   | 4,964,900     | 貸付有価証券<br>3,700株   |
| 2424 | プラス              | 2,700   | 998.00   | 2,694,600     | 貸付有価証券<br>700株     |
| 2427 | アウトソーシング         | 182,600 | 999.00   | 182,417,400   | 貸付有価証券<br>28,700株  |
| 2428 | ウェルネット           | 18,100  | 585.00   | 10,588,500    | 貸付有価証券<br>5,600株   |
| 2429 | ワールドホールディングス     | 13,800  | 2,655.00 | 36,639,000    | 貸付有価証券<br>1,900株   |
| 2432 | ディー・エヌ・エー        | 130,700 | 1,805.00 | 235,913,500   | 貸付有価証券<br>24,000株  |
| 2433 | 博報堂ＤＹホールディングス    | 391,100 | 1,406.00 | 549,886,600   | 貸付有価証券<br>58,900株  |
| 2440 | ぐるなび             | 56,300  | 393.00   | 22,125,900    | 貸付有価証券<br>10,000株  |
| 2445 | タカミヤ             | 41,600  | 382.00   | 15,891,200    | 貸付有価証券<br>7,700株   |
| 2453 | ジャパンベストレスキューシステム | 19,000  | 830.00   | 15,770,000    | 貸付有価証券<br>2,900株   |
| 2461 | ファンコミュニケーションズ    | 60,100  | 420.00   | 25,242,000    | 貸付有価証券<br>15,600株  |
| 2462 | ライク              | 11,400  | 2,187.00 | 24,931,800    | 貸付有価証券<br>2,600株   |
| 2464 | ビジネス・ブレークスルー     | 7,600   | 384.00   | 2,918,400     | 貸付有価証券<br>2,500株   |
| 2471 | エスプール            | 88,100  | 801.00   | 70,568,100    | 貸付有価証券<br>14,000株  |
| 2475 | ＷＤＢホールディングス      | 15,700  | 2,124.00 | 33,346,800    | 貸付有価証券<br>1,900株   |
| 2485 | ティア              | 11,900  | 425.00   | 5,057,500     | 貸付有価証券<br>2,500株   |
| 2487 | ＣＤＧ              | 2,200   | 1,079.00 | 2,373,800     | 貸付有価証券<br>500株     |
| 2489 | アドウェイズ           | 42,200  | 511.00   | 21,564,200    | 貸付有価証券<br>10,600株  |
| 2491 | バリューコマース         | 23,100  | 1,997.00 | 46,130,700    | 貸付有価証券<br>4,500株   |
| 2492 | インフォマート          | 318,300 | 412.00   | 131,139,600   | 貸付有価証券<br>62,400株  |
| 2749 | ＪＰホールディングス       | 88,200  | 381.00   | 33,604,200    | 貸付有価証券<br>13,200株  |
| 3521 | エコナックホールディングス    | 35,300  | 90.00    | 3,177,000     | 貸付有価証券<br>11,100株  |
| 4286 | ＣＬホールディングス       | 8,500   | 815.00   | 6,927,500     | 貸付有価証券<br>1,500株   |
| 4290 | プレステージ・インターナショナル | 128,900 | 758.00   | 97,706,200    | 貸付有価証券<br>21,800株  |
| 4301 | アミューズ            | 16,600  | 1,733.00 | 28,767,800    | 貸付有価証券<br>4,000株   |

|      |                    |         |           |               |                   |
|------|--------------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| 4310 | ドリームインキュベータ        | 9,300   | 2,599.00  | 24,170,700    | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 4318 | クイック               | 23,400  | 2,062.00  | 48,250,800    | 貸付有価証券<br>3,600株  |
| 4319 | T A C              | 11,100  | 203.00    | 2,253,300     | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| 4324 | 電通グループ             | 301,300 | 4,355.00  | 1,312,161,500 | 貸付有価証券<br>45,300株 |
| 4331 | テイクアンドギヴ・ニーズ       | 9,600   | 1,308.00  | 12,556,800    | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 4337 | ぴあ                 | 10,300  | 3,285.00  | 33,835,500    | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 4343 | イオンファンタジー          | 13,200  | 2,888.00  | 38,121,600    | 貸付有価証券<br>1,200株  |
| 4345 | シーティーエス            | 33,900  | 817.00    | 27,696,300    | 貸付有価証券<br>7,200株  |
| 4346 | ネクシィーズグループ         | 6,300   | 661.00    | 4,164,300     | 貸付有価証券<br>2,300株  |
| 4544 | H. U. グループホールディングス | 89,700  | 2,797.00  | 250,890,900   | 貸付有価証券<br>16,500株 |
| 4641 | アルプス技研             | 26,700  | 2,203.00  | 58,820,100    | 貸付有価証券<br>6,400株  |
| 4651 | サニックス              | 49,100  | 220.00    | 10,802,000    | 貸付有価証券<br>10,800株 |
| 4658 | 日本空調サービス           | 32,900  | 705.00    | 23,194,500    | 貸付有価証券<br>6,700株  |
| 4661 | オリエンタルランド          | 324,500 | 21,245.00 | 6,894,002,500 | 貸付有価証券<br>16,200株 |
| 4665 | ダスキン               | 68,300  | 3,000.00  | 204,900,000   | 貸付有価証券<br>20,700株 |
| 4668 | 明光ネットワークジャパン       | 40,300  | 612.00    | 24,663,600    | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 4671 | ファルコホールディングス       | 13,800  | 1,861.00  | 25,681,800    | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 4678 | 秀英予備校              | 4,500   | 438.00    | 1,971,000     | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 4679 | 田谷                 | 3,700   | 543.00    | 2,009,100     | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 4680 | ラウンドワン             | 256,400 | 471.00    | 120,764,400   | 貸付有価証券<br>60,300株 |
| 4681 | リゾートトラスト           | 121,000 | 2,356.00  | 285,076,000   | 貸付有価証券<br>25,200株 |
| 4694 | ビー・エム・エル           | 38,000  | 3,370.00  | 128,060,000   | 貸付有価証券<br>9,200株  |
| 4708 | りらいあコミュニケーションズ     | 50,600  | 1,457.00  | 73,724,200    | 貸付有価証券<br>7,600株  |
| 4714 | リソー教育              | 139,400 | 361.00    | 50,323,400    | 貸付有価証券<br>11,700株 |
| 4718 | 早稲田アカデミー           | 17,000  | 1,154.00  | 19,618,000    | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 4732 | ユー・エス・エス           | 315,300 | 2,114.00  | 666,544,200   | 貸付有価証券<br>79,400株 |

|      |                    |           |          |             |                    |
|------|--------------------|-----------|----------|-------------|--------------------|
| 4745 | 東京個別指導学院           | 36,300    | 539.00   | 19,565,700  | 貸付有価証券<br>2,800株   |
| 4751 | サイバーエージェント         | 733,600   | 1,236.00 | 906,729,600 | 貸付有価証券<br>97,200株  |
| 4755 | 楽天グループ             | 1,418,900 | 653.00   | 926,541,700 | 貸付有価証券<br>303,600株 |
| 4763 | クリーク・アンド・リバー社      | 18,000    | 2,171.00 | 39,078,000  | 貸付有価証券<br>900株     |
| 4765 | モーニングスター           | 50,000    | 462.00   | 23,100,000  | 貸付有価証券<br>3,600株   |
| 4767 | テー・オー・ダブリュー        | 65,500    | 292.00   | 19,126,000  | 貸付有価証券<br>10,800株  |
| 4792 | 山田コンサルティンググループ     | 15,500    | 1,174.00 | 18,197,000  | 貸付有価証券<br>3,300株   |
| 4801 | セントラルスポーツ          | 11,500    | 2,476.00 | 28,474,000  | 貸付有価証券<br>2,800株   |
| 4848 | フルキャストホールディングス     | 29,300    | 2,842.00 | 83,270,600  | 貸付有価証券<br>6,000株   |
| 4849 | エン・ジャパン            | 55,500    | 2,495.00 | 138,472,500 | 貸付有価証券<br>9,900株   |
| 5261 | リソルホールディングス        | 2,200     | 4,630.00 | 10,186,000  | 貸付有価証券<br>1,100株   |
| 6028 | テクノプロ・ホールディングス     | 205,600   | 4,040.00 | 830,624,000 | 貸付有価証券<br>35,100株  |
| 6029 | アトラグループ            | 4,600     | 188.00   | 864,800     | 貸付有価証券<br>1,000株   |
| 6032 | インターワークス           | 5,900     | 367.00   | 2,165,300   | 貸付有価証券<br>800株     |
| 6035 | アイ・アールジャパンホールディングス | 15,900    | 1,839.00 | 29,240,100  | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 6036 | KeePer 技研          | 22,100    | 3,420.00 | 75,582,000  | 貸付有価証券<br>4,400株   |
| 6037 | ファーストロジック          | 3,100     | 858.00   | 2,659,800   | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 6044 | 三機サービス             | 3,500     | 885.00   | 3,097,500   | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 6047 | Gunosy             | 18,900    | 604.00   | 11,415,600  | 貸付有価証券<br>4,800株   |
| 6048 | デザインワン・ジャパン        | 6,100     | 206.00   | 1,256,600   | 貸付有価証券<br>1,100株   |
| 6050 | イー・ガーディアン          | 11,600    | 2,687.00 | 31,169,200  | 貸付有価証券<br>3,000株   |
| 6054 | リブセンス              | 9,400     | 308.00   | 2,895,200   | 貸付有価証券<br>3,700株   |
| 6055 | ジャパンマテリアル          | 93,800    | 2,387.00 | 223,900,600 | 貸付有価証券<br>12,900株  |
| 6058 | ベクトル               | 48,100    | 1,253.00 | 60,269,300  | 貸付有価証券<br>1,500株   |
| 6059 | ウチヤマホールディングス       | 10,100    | 267.00   | 2,696,700   | 貸付有価証券<br>3,400株   |
| 6062 | チャーム・ケア・コーポレーション   | 25,500    | 1,185.00 | 30,217,500  | 貸付有価証券<br>4,300株   |

|      |                     |           |          |               |                   |
|------|---------------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 6070 | キャリアリンク             | 11,200    | 2,701.00 | 30,251,200    | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 6071 | I B J               | 18,700    | 998.00   | 18,662,600    | 貸付有価証券<br>4,500株  |
| 6073 | アサンテ                | 15,200    | 1,640.00 | 24,928,000    | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 6078 | バリューHR              | 26,700    | 1,692.00 | 45,176,400    | 貸付有価証券<br>4,800株  |
| 6080 | M&Aキャピタルパートナーズ      | 28,300    | 5,150.00 | 145,745,000   | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 6082 | ライドオンエクスプレスホールディングス | 10,900    | 1,090.00 | 11,881,000    | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 6083 | E R I ホールディングス      | 5,700     | 1,346.00 | 7,672,200     | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 6087 | アビスト                | 3,200     | 2,947.00 | 9,430,400     | 貸付有価証券<br>800株    |
| 6088 | シグマクシス・ホールディングス     | 46,500    | 1,387.00 | 64,495,500    | 貸付有価証券<br>8,800株  |
| 6089 | ウィルグループ             | 25,500    | 1,249.00 | 31,849,500    | 貸付有価証券<br>3,600株  |
| 6093 | エスクロー・エージェント・ジャパン   | 21,300    | 148.00   | 3,152,400     | 貸付有価証券<br>7,800株  |
| 6095 | メドピア                | 24,100    | 1,441.00 | 34,728,100    | 貸付有価証券<br>2,300株  |
| 6096 | レアジョブ               | 3,900     | 976.00   | 3,806,400     | 貸付有価証券<br>1,200株  |
| 6098 | リクルートホールディングス       | 2,270,000 | 4,271.00 | 9,695,170,000 | 貸付有価証券<br>800株    |
| 6099 | エラン                 | 40,600    | 996.00   | 40,437,600    | 貸付有価証券<br>6,600株  |
| 6171 | 土木管理総合試験所           | 8,500     | 305.00   | 2,592,500     | 貸付有価証券<br>2,300株  |
| 6178 | 日本郵政                | 4,018,500 | 1,122.00 | 4,508,757,000 |                   |
| 6183 | ベルシステム 2 4 ホールディングス | 41,100    | 1,491.00 | 61,280,100    | 貸付有価証券<br>11,200株 |
| 6184 | 鎌倉新書                | 34,800    | 1,038.00 | 36,122,400    | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 6185 | SMN                 | 4,700     | 472.00   | 2,218,400     | 貸付有価証券<br>900株    |
| 6186 | 一蔵                  | 2,600     | 455.00   | 1,183,000     | 貸付有価証券<br>800株    |
| 6189 | グローバルキッズCOMPANY     | 3,100     | 796.00   | 2,467,600     | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 6191 | エアトリ                | 19,800    | 2,620.00 | 51,876,000    | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 6194 | アトラエ                | 24,100    | 1,257.00 | 30,293,700    | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 6196 | ストライク               | 15,100    | 4,805.00 | 72,555,500    | 貸付有価証券<br>2,400株  |
| 6197 | ソラスト                | 84,500    | 679.00   | 57,375,500    | 貸付有価証券<br>15,200株 |

|      |                          |         |          |               |                   |
|------|--------------------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 6199 | セラク                      | 10,900  | 1,414.00 | 15,412,600    | 貸付有価証券<br>700株    |
| 6200 | インソース                    | 76,100  | 1,494.00 | 113,693,400   | 貸付有価証券<br>8,000株  |
| 6532 | ベイカレント・コンサルティング          | 242,700 | 5,590.00 | 1,356,693,000 | 貸付有価証券<br>12,000株 |
| 6533 | Orchestra Holdings       | 6,600   | 2,068.00 | 13,648,800    | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 6535 | アイモバイル                   | 15,900  | 1,257.00 | 19,986,300    | 貸付有価証券<br>500株    |
| 6538 | キャリアインデックス               | 7,000   | 322.00   | 2,254,000     | 貸付有価証券<br>2,500株  |
| 6539 | MS-Japan                 | 8,300   | 1,055.00 | 8,756,500     | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 6540 | 船場                       | 3,500   | 703.00   | 2,460,500     | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 6544 | ジャパンエレベーターサービスホール<br>ディン | 109,300 | 1,788.00 | 195,428,400   | 貸付有価証券<br>11,000株 |
| 6546 | フルテック                    | 2,900   | 1,087.00 | 3,152,300     | 貸付有価証券<br>900株    |
| 6547 | グリーンズ                    | 7,700   | 1,169.00 | 9,001,300     | 貸付有価証券<br>2,300株  |
| 6551 | ツナググループ・ホールディングス         | 5,700   | 488.00   | 2,781,600     | 貸付有価証券<br>700株    |
| 6552 | GameWith                 | 6,100   | 347.00   | 2,116,700     | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 6555 | MS&Consulting            | 3,000   | 599.00   | 1,797,000     | 貸付有価証券<br>800株    |
| 6556 | ウェルビー                    | 22,500  | 720.00   | 16,200,000    | 貸付有価証券<br>2,400株  |
| 6560 | エル・ティー・エス                | 3,900   | 2,843.00 | 11,087,700    | 貸付有価証券<br>800株    |
| 6564 | ミダックホールディングス             | 18,600  | 2,820.00 | 52,452,000    | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 6569 | 日総工産                     | 23,000  | 594.00   | 13,662,000    | 貸付有価証券<br>4,800株  |
| 6571 | キュービーネットホールディングス         | 16,000  | 1,479.00 | 23,664,000    | 貸付有価証券<br>4,100株  |
| 6572 | RPAホールディングス              | 41,500  | 363.00   | 15,064,500    | 貸付有価証券<br>600株    |
| 7030 | スプリックス                   | 7,000   | 901.00   | 6,307,000     | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 7033 | マネジメントソリューションズ           | 16,900  | 3,625.00 | 61,262,500    | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| 7034 | プロレド・パートナーズ              | 7,500   | 510.00   | 3,825,000     | 貸付有価証券<br>900株    |
| 7035 | and factory              | 5,900   | 364.00   | 2,147,600     | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 7037 | テノ. ホールディングス             | 2,500   | 921.00   | 2,302,500     | 貸付有価証券<br>800株    |
| 7038 | フロンティア・マネジメント            | 10,200  | 1,431.00 | 14,596,200    | 貸付有価証券<br>1,700株  |

|      |                    |         |          |             |                   |
|------|--------------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| 7044 | ピアラ                | 3,300   | 541.00   | 1,785,300   | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 7059 | コプロ・ホールディングス       | 4,000   | 1,123.00 | 4,492,000   | 貸付有価証券<br>800株    |
| 7060 | ギークス               | 3,500   | 905.00   | 3,167,500   | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 7085 | カーブスホールディングス       | 94,200  | 810.00   | 76,302,000  | 貸付有価証券<br>17,200株 |
| 7088 | フォーラムエンジニアリング      | 17,900  | 884.00   | 15,823,600  | 貸付有価証券<br>3,200株  |
| 7092 | Fast Fitness Japan | 10,400  | 1,189.00 | 12,365,600  |                   |
| 7354 | ダイレクトマーケティングミックス   | 35,300  | 1,641.00 | 57,927,300  | 貸付有価証券<br>6,800株  |
| 7358 | ポピンズ               | 4,500   | 2,053.00 | 9,238,500   | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 7366 | LITALICO           | 23,900  | 2,460.00 | 58,794,000  | 貸付有価証券<br>4,200株  |
| 8769 | アドバンテッジリスクマネジメント   | 10,300  | 399.00   | 4,109,700   | 貸付有価証券<br>3,100株  |
| 8876 | リロググループ            | 170,700 | 2,228.00 | 380,319,600 | 貸付有価証券<br>33,100株 |
| 8920 | 東祥                 | 21,400  | 1,171.00 | 25,059,400  | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 9216 | ビーウィズ              | 9,200   | 1,417.00 | 13,036,400  | 貸付有価証券<br>500株    |
| 9247 | TREホールディングス        | 64,600  | 1,492.00 | 96,383,200  | 貸付有価証券<br>6,800株  |
| 9248 | 人・夢・技術グループ         | 13,700  | 1,479.00 | 20,262,300  | 貸付有価証券<br>1,200株  |
| 9336 | 大栄環境               | 5,900   | 1,828.00 | 10,785,200  |                   |
| 9603 | エイチ・アイ・エス          | 80,200  | 2,128.00 | 170,665,600 | 貸付有価証券<br>6,600株  |
| 9612 | ラックランド             | 9,500   | 2,915.00 | 27,692,500  | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 9616 | 共立メンテナンス           | 52,500  | 5,830.00 | 306,075,000 | 貸付有価証券<br>11,100株 |
| 9619 | イチネンホールディングス       | 32,500  | 1,273.00 | 41,372,500  | 貸付有価証券<br>3,600株  |
| 9621 | 建設技術研究所            | 15,800  | 3,255.00 | 51,429,000  | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 9622 | スペース               | 22,300  | 925.00   | 20,627,500  | 貸付有価証券<br>4,100株  |
| 9628 | 燦ホールディングス          | 13,600  | 1,848.00 | 25,132,800  | 貸付有価証券<br>3,100株  |
| 9632 | スバル興業              | 1,300   | 9,100.00 | 11,830,000  | 貸付有価証券<br>100株    |
| 9633 | 東京テアトル             | 7,500   | 1,118.00 | 8,385,000   | 貸付有価証券<br>2,400株  |
| 9644 | タナベコンサルティンググループ    | 7,900   | 647.00   | 5,111,300   | 貸付有価証券<br>2,200株  |



|      |                    |         |          |               |                   |
|------|--------------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 9663 | ナガワ                | 8,200   | 7,870.00 | 64,534,000    | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 9672 | 東京都競馬              | 25,700  | 3,900.00 | 100,230,000   | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 9675 | 常磐興産               | 7,100   | 1,200.00 | 8,520,000     | 貸付有価証券<br>2,300株  |
| 9678 | カナモト               | 56,200  | 2,256.00 | 126,787,200   | 貸付有価証券<br>3,300株  |
| 9699 | 西尾レントオール           | 28,500  | 3,075.00 | 87,637,500    | 貸付有価証券<br>6,100株  |
| 9704 | アゴーラ ホスピタリティー グループ | 112,700 | 22.00    | 2,479,400     | 貸付有価証券<br>39,500株 |
| 9715 | トランス・コスモス          | 38,100  | 3,390.00 | 129,159,000   | 貸付有価証券<br>5,800株  |
| 9716 | 乃村工藝社              | 133,700 | 919.00   | 122,870,300   | 貸付有価証券<br>8,600株  |
| 9722 | 藤田観光               | 13,600  | 3,380.00 | 45,968,000    | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| 9726 | KNT－CTホールディングス     | 18,300  | 1,691.00 | 30,945,300    | 貸付有価証券<br>3,300株  |
| 9728 | 日本管財               | 32,200  | 2,535.00 | 81,627,000    |                   |
| 9729 | トーカイ               | 27,100  | 1,911.00 | 51,788,100    | 貸付有価証券<br>3,400株  |
| 9731 | 白洋舎                | 1,900   | 1,756.00 | 3,336,400     | 貸付有価証券<br>500株    |
| 9735 | セコム                | 312,300 | 7,782.00 | 2,430,318,600 | 貸付有価証券<br>65,400株 |
| 9740 | セントラル警備保障          | 16,500  | 2,589.00 | 42,718,500    | 貸付有価証券<br>3,600株  |
| 9743 | 丹青社                | 59,400  | 728.00   | 43,243,200    |                   |
| 9744 | メイテック              | 122,200 | 2,477.00 | 302,689,400   | 貸付有価証券<br>11,300株 |
| 9755 | 応用地質               | 28,600  | 2,127.00 | 60,832,200    | 貸付有価証券<br>3,600株  |
| 9757 | 船井総研ホールディングス       | 64,400  | 2,778.00 | 178,903,200   |                   |
| 9760 | 進学会ホールディングス        | 6,700   | 298.00   | 1,996,600     | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 9765 | オオバ                | 12,800  | 708.00   | 9,062,400     | 貸付有価証券<br>4,800株  |
| 9768 | いであ                | 4,500   | 1,701.00 | 7,654,500     | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 9769 | 学究社                | 12,200  | 1,945.00 | 23,729,000    | 貸付有価証券<br>600株    |
| 9783 | ベネッセホールディングス       | 114,400 | 1,985.00 | 227,084,000   | 貸付有価証券<br>25,500株 |
| 9787 | イオンディライト           | 33,900  | 3,035.00 | 102,886,500   | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 9788 | ナック                | 13,600  | 964.00   | 13,110,400    | 貸付有価証券<br>3,300株  |
| 9793 | ダイセキ               | 62,600  | 4,435.00 | 277,631,000   | 貸付有価証券<br>4,800株  |

|      |      |             |          |                 |                |
|------|------|-------------|----------|-----------------|----------------|
| 9795 | ステップ | 12,600      | 1,788.00 | 22,528,800      | 貸付有価証券<br>700株 |
| 合 計  |      | 348,154,200 |          | 849,205,825,410 |                |

## (2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

## 外国株式インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

[令和 5年 1月26日現在]

|                   |                   |
|-------------------|-------------------|
| 資産の部              |                   |
| 流動資産              |                   |
| 預金                | 28,834,509,647    |
| コール・ローン           | 4,576,308,829     |
| 株式                | 1,955,804,252,672 |
| 投資証券              | 46,201,461,286    |
| 派生商品評価勘定          | 763,123,724       |
| 未収入金              | 191,599,044       |
| 未収配当金             | 1,353,345,138     |
| 差入委託証拠金           | 16,922,004,643    |
| 流動資産合計            | 2,054,646,604,983 |
| 資産合計              |                   |
| 2,054,646,604,983 |                   |
| 負債の部              |                   |
| 流動負債              |                   |
| 派生商品評価勘定          | 63,111,704        |
| 未払金               | 1,275,901         |
| 未払解約金             | 57,323,256        |
| 未払利息              | 2,057             |
| 流動負債合計            | 121,712,918       |
| 負債合計              |                   |
| 121,712,918       |                   |
| 純資産の部             |                   |
| 元本等               |                   |
| 元本                | 447,735,229,199   |
| 剰余金               |                   |
| 剰余金又は欠損金（△）       | 1,606,789,662,866 |
| 元本等合計             | 2,054,524,892,065 |
| 純資産合計             |                   |
| 2,054,524,892,065 |                   |
| 負債純資産合計           |                   |
| 2,054,646,604,983 |                   |

### 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （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 5年 1月26日現在]  |
|----------------------------------|------------------|
| 1. 期首                            | 令和 4年 1月27日      |
| 期首元本額                            | 317,906,949,929円 |
| 期中追加設定元本額                        | 228,126,194,105円 |
| 期中一部解約元本額                        | 98,297,914,835円  |
| 元本の内訳※                           |                  |
| 三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）           | 229,318,137円     |
| 三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）         | 1,014,733,382円   |
| 三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）           | 891,950,692円     |
| MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信         | 3,052,319,463円   |
| MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信       | 3,898,975,490円   |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）      | 1,788,614,370円   |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）    | 10,122,294,431円  |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）      | 10,613,838,555円  |
| 三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）        | 54,730,516円      |
| 三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（成長型）           | 142,254,463円     |
| ファンド・マネジャー（海外株式）                 | 781,552円         |
| eMAXIS 先進国株式インデックス               | 13,546,942,522円  |
| eMAXIS バランス（8資産均等型）              | 1,134,756,868円   |
| eMAXIS バランス（波乗り型）                | 39,655,892円      |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）      | 1,815,168,235円   |
| コアバランス                           | 179,823円         |
| 三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金） | 217,687,950円     |

|                                  | [令和 5年 1月26日現在]  |
|----------------------------------|------------------|
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金） | 251,703,389円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金） | 228,577,099円     |
| eMAXIS Slim 先進国株式インデックス          | 84,322,602,279円  |
| 海外株式セレクション（ラップ向け）                | 2,258,843,580円   |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）         | 4,741,282,599円   |
| つみたて先進国株式                        | 21,324,234,179円  |
| つみたて8資産均等バランス                    | 2,214,802,437円   |
| つみたて4資産均等バランス                    | 727,991,548円     |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s            | 1,768,285円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s            | 3,123,358円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s            | 4,402,060円       |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金） | 180,162,159円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金） | 189,187,209円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金） | 119,214,519円     |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式15）             | 58,398,493円      |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式40）             | 437,612,258円     |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式65）             | 940,923,657円     |
| eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）          | 38,551,647,174円  |
| eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）        | 466,982,595円     |
| 三菱UFJ DC年金インデックス（先進国株式）          | 3,082,865,096円   |
| eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）     | 151,989,880,464円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金） | 106,590,879円     |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式25）             | 37,160,291円      |
| つみたて全世界株式                        | 166,173,287円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金） | 40,017,775円      |
| ラップ向けインデックスf 先進国株式               | 3,628,114,779円   |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式80）             | 13,461,615円      |
| ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）         | 3,255,298,288円   |
| ラップ向けダイナミックアロケーションファンド           | 20,917,125円      |
| 三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド           | 28,700,363,642円  |
| eMAXIS 全世界株式インデックス               | 4,379,564,144円   |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）        | 259,744,004円     |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）        | 533,699,845円     |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）       | 99,198,204円      |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）   | 245,407,217円     |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）        | 177,911,120円     |
| eMAXIS バランス（4資産均等型）              | 322,369,008円     |

|                                           | [令和 5年 1月26日現在] |
|-------------------------------------------|-----------------|
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）                 | 91,013,923円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）                 | 108,149,213円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）                | 404,074,363円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）                   | 318,094,960円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）                  | 613,914,007円    |
| 三菱UFJ 外国株式ファンドVA（適格機関投資家限定）               | 1,659,118,596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）     | 14,976円         |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）             | 6,368,330円      |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）             | 4,421,473,055円  |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）           | 52,829,280円     |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）           | 844,590,773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）            | 10,641,296,708円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）           | 605,383円        |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）             | 658,325,423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）           | 5,280,737,964円  |
| アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）            | 9,208,601円      |
| アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）           | 64,872,362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）   | 738,529,437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）  | 232,695,247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）     | 375,225,753円    |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）                | 55,154,227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）         | 1,055,899,707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）   | 59,008,454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）          | 2,313,381,138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）       | 373,741,168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） | 22,287,982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）                | 123,819円        |
| 外国株式インデックスファンドV（適格機関投資家限定）                | 2,383,389,637円  |
| 海外株式インデックスファンドS                           | 1,545,557,579円  |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンド                      | 2,658,152,854円  |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA                | 845,569円        |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA              | 2,424,066円      |

|                                       | [令和 5年 1月26日現在]  |
|---------------------------------------|------------------|
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA            | 809,271円         |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA            | 2,102,249円       |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA                | 30,500,838円      |
| 三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）            | 1,181,942円       |
| 三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）            | 10,388,167円      |
| 三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）            | 1,665,331円       |
| 三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）            | 15,726,967円      |
| 三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド              | 6,651,322,413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）   | 101,884,699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） | 414,582,530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）   | 437,240,943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）   | 430,321,294円     |
| 合計                                    | 447,735,229,199円 |
| 2. 受益権の総数                             | 447,735,229,199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 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |

| 区分               | 自 令和 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26日                                                                                                                                                                           |
|------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                        | [令和 5年 1月26日現在]                                                                                                                                                                                                                    |
|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                                                             |
| 2.時価の算定方法                 | <p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価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 5年 1月26日現在]    |
|------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 株式   | 69,264,074,954     |
| 投資証券 | △1,590,103,545     |
| 合計   | 67,673,971,409     |

(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 5年 1月26日現在]

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|

| 区分   | 種類             | 契約額等（円）        | うち1年超 | 時価（円）          | 評価損益（円）     |
|------|----------------|----------------|-------|----------------|-------------|
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 50,436,106,589 | —     | 51,169,152,003 | 733,045,414 |
| 合計   |                | 50,436,106,589 | —     | 51,169,152,003 | 733,045,414 |

（注）時価の算定方法

1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 通貨関連

[令和 5年 1月26日現在]

| 区分            | 種類         | 契約額等（円）       | うち1年超 | 時価（円）         | 評価損益（円）     |
|---------------|------------|---------------|-------|---------------|-------------|
|               |            |               |       |               |             |
| 市場取引以外<br>の取引 | 為替予約取引     |               |       |               |             |
|               | 買建         |               |       |               |             |
|               | アメリカドル     | 3,169,897,920 | —     | 3,142,781,832 | △27,116,088 |
|               | カナダドル      | 147,451,684   | —     | 146,001,171   | △1,450,513  |
|               | オーストラリアドル  | 263,628,223   | —     | 263,613,957   | △14,266     |
|               | イギリスポンド    | 200,439,033   | —     | 200,156,611   | △282,422    |
|               | スイスフラン     | 134,286,300   | —     | 133,841,320   | △444,980    |
|               | 香港ドル       | 92,629,149    | —     | 91,852,736    | △776,413    |
|               | シンガポールドル   | 18,667,530    | —     | 18,608,524    | △59,006     |
|               | ニュージーランドドル | 18,909,632    | —     | 18,764,547    | △145,085    |
|               | スウェーデンクローネ | 53,823,042    | —     | 53,362,249    | △460,793    |
|               | デンマーククローネ  | 41,400,128    | —     | 41,141,247    | △258,881    |
|               | ユーロ        | 354,525,152   | —     | 352,417,840   | △2,107,312  |
|               | 売建         |               |       |               |             |
|               | アメリカドル     | 964,552,650   | —     | 964,487,704   | 64,946      |
|               | カナダドル      | 48,037,578    | —     | 48,037,727    | △149        |
|               | オーストラリアドル  | 35,081,657    | —     | 35,081,925    | △268        |
|               | イギリスポンド    | 61,889,078    | —     | 61,886,415    | 2,663       |
|               | スイスフラン     | 40,570,560    | —     | 40,571,280    | △720        |
|               | 香港ドル       | 42,452,495    | —     | 42,439,613    | 12,882      |
|               | スウェーデンクローネ | 14,793,654    | —     | 14,794,238    | △584        |
|               | デンマーククローネ  | 15,978,643    | —     | 15,980,160    | △1,517      |
|               | ユーロ        | 128,783,762   | —     | 128,778,650   | 5,112       |



|    |               |   |               |             |
|----|---------------|---|---------------|-------------|
| 合計 | 5,847,797,870 | — | 5,814,599,746 | △33,033,394 |
|----|---------------|---|---------------|-------------|

## （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 5年 1月26日現在] |
|--------------|-----------------|
| 1口当たり純資産額    | 4.5887円         |
| (1万口当たり純資産額) | (45,887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 | APA CORP               | 101,800 | 44.09  | 4,488,362.00   |    |
|        | BAKER HUGHES CO        | 309,448 | 31.00  | 9,592,888.00   |    |
|        | CHENIERE ENERGY INC    | 69,912  | 148.84 | 10,405,702.08  |    |
|        | CHESAPEAKE ENERGY CORP | 29,775  | 91.20  | 2,715,480.00   |    |
|        | CHEVRON CORP           | 581,439 | 179.08 | 104,124,096.12 |    |
|        | CONOCOPHILLIPS         | 398,099 | 120.37 | 47,919,176.63  |    |
|        | COTERRA ENERGY INC     | 253,523 | 25.10  | 6,363,427.30   |    |
|        | DEVON ENERGY CORP      | 196,754 | 64.17  | 12,625,704.18  |    |
|        | DIAMONDBACK ENERGY INC | 52,814  | 147.08 | 7,767,883.12   |    |
|        | EOG RESOURCES INC      | 183,298 | 132.50 | 24,286,985.00  |    |
|        | EQT CORP               | 101,061 | 33.22  | 3,357,246.42   |    |

|                              |           |          |                |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| EXXON MOBIL CORP             | 1,302,862 | 113.21   | 147,497,007.02 |
| HALLIBURTON CO               | 286,727   | 40.03    | 11,477,681.81  |
| HESS CORP                    | 87,447    | 157.89   | 13,807,006.83  |
| HF SINCLAIR CORP             | 47,286    | 57.49    | 2,718,472.14   |
| KINDER MORGAN INC            | 642,148   | 18.45    | 11,847,630.60  |
| MARATHON OIL CORP            | 217,347   | 27.86    | 6,055,287.42   |
| MARATHON PETROLEUM CORP      | 154,611   | 129.81   | 20,070,053.91  |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 291,156   | 64.52    | 18,785,385.12  |
| ONEOK INC                    | 138,754   | 69.04    | 9,579,576.16   |
| OVINTIV INC                  | 82,940    | 50.00    | 4,147,000.00   |
| PHILLIPS 66                  | 149,605   | 108.85   | 16,284,504.25  |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 70,869    | 236.22   | 16,740,675.18  |
| SCHLUMBERGER LTD             | 442,608   | 56.25    | 24,896,700.00  |
| TARGA RESOURCES CORP         | 68,999    | 75.31    | 5,196,314.69   |
| TEXAS PACIFIC LAND CORP      | 1,863     | 2,084.40 | 3,883,237.20   |
| VALERO ENERGY CORP           | 122,641   | 143.35   | 17,580,587.35  |
| WILLIAMS COS INC             | 382,001   | 31.40    | 11,994,831.40  |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 69,195    | 312.05   | 21,592,299.75  |
| ALBEMARLE CORP               | 36,700    | 270.98   | 9,944,966.00   |
| ALCOA CORP                   | 53,760    | 52.19    | 2,805,734.40   |
| AMCOR PLC                    | 478,670   | 11.78    | 5,638,732.60   |
| AVERY DENNISON CORP          | 24,955    | 185.09   | 4,618,920.95   |
| BALL CORP                    | 101,553   | 56.64    | 5,751,961.92   |
| CELANESE CORP                | 32,123    | 121.47   | 3,901,980.81   |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   | 62,407    | 83.76    | 5,227,210.32   |
| CLEVELAND-CLIFFS INC         | 151,119   | 20.78    | 3,140,252.82   |
| CORTEVA INC                  | 225,641   | 63.13    | 14,244,716.33  |
| CROWN HOLDINGS INC           | 37,452    | 87.00    | 3,258,324.00   |
| DOW INC                      | 227,708   | 57.89    | 13,182,016.12  |
| DUPONT DE NEMOURS INC        | 156,712   | 73.53    | 11,523,033.36  |
| EASTMAN CHEMICAL CO          | 40,284    | 90.80    | 3,657,787.20   |
| ECOLAB INC                   | 80,351    | 152.40   | 12,245,492.40  |
| FMC CORP                     | 39,430    | 128.88   | 5,081,738.40   |
| FREEMPORT-MCMORAN INC        | 446,713   | 46.64    | 20,834,694.32  |
| INTERNATIONAL PAPER CO       | 111,608   | 36.32    | 4,053,602.56   |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 79,918    | 111.80   | 8,934,832.40   |
| LINDE PLC                    | 155,608   | 326.36   | 50,784,226.88  |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 80,174    | 92.97    | 7,453,776.78   |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 19,157    | 347.42   | 6,655,524.94   |
| MOSAIC CO/THE                | 113,000   | 48.10    | 5,435,300.00   |
| NEWMONT CORP                 | 248,777   | 55.09    | 13,705,124.93  |
| NUCOR CORP                   | 82,264    | 156.67   | 12,888,300.88  |

|                                |         |        |               |
|--------------------------------|---------|--------|---------------|
| PACKAGING CORP OF AMERICA      | 30,858  | 129.15 | 3,985,310.70  |
| PPG INDUSTRIES INC             | 73,192  | 128.15 | 9,379,554.80  |
| RPM INTERNATIONAL INC          | 39,891  | 88.04  | 3,512,003.64  |
| SEALED AIR CORP                | 49,467  | 51.68  | 2,556,454.56  |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE        | 76,969  | 247.09 | 19,018,270.21 |
| STEEL DYNAMICS INC             | 56,193  | 110.41 | 6,204,269.13  |
| VULCAN MATERIALS CO            | 40,584  | 178.67 | 7,251,143.28  |
| WESTLAKE CORP                  | 13,051  | 116.25 | 1,517,178.75  |
| WESTROCK CO                    | 81,719  | 36.68  | 2,997,452.92  |
| 3M CO                          | 173,017 | 112.93 | 19,538,809.81 |
| AERCAP HOLDINGS NV             | 45,293  | 63.79  | 2,889,240.47  |
| ALLEGION PLC                   | 26,361  | 113.35 | 2,988,019.35  |
| AMETEK INC                     | 71,543  | 142.80 | 10,216,340.40 |
| BOEING CO/THE                  | 176,458 | 212.68 | 37,529,087.44 |
| CARLISLE COS INC               | 16,689  | 240.74 | 4,017,709.86  |
| CARRIER GLOBAL CORP            | 262,743 | 43.51  | 11,431,947.93 |
| CATERPILLAR INC                | 165,086 | 258.44 | 42,664,825.84 |
| CUMMINS INC                    | 44,170  | 246.26 | 10,877,304.20 |
| DEERE & CO                     | 90,794  | 413.64 | 37,556,030.16 |
| DOVER CORP                     | 45,752  | 141.85 | 6,489,921.20  |
| EATON CORP PLC                 | 124,458 | 159.14 | 19,806,246.12 |
| EMERSON ELECTRIC CO            | 184,505 | 89.08  | 16,435,705.40 |
| FASTENAL CO                    | 180,413 | 49.47  | 8,925,031.11  |
| FERGUSON PLC                   | 63,831  | 138.07 | 8,813,146.17  |
| FORTIVE CORP                   | 105,645 | 66.76  | 7,052,860.20  |
| FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I   | 38,725  | 62.73  | 2,429,219.25  |
| GENERAC HOLDINGS INC           | 18,213  | 111.21 | 2,025,467.73  |
| GENERAL DYNAMICS CORP          | 72,997  | 226.88 | 16,561,559.36 |
| GENERAL ELECTRIC CO            | 342,669 | 80.79  | 27,684,228.51 |
| HEICO CORP                     | 12,279  | 168.40 | 2,067,783.60  |
| HEICO CORP-CLASS A             | 22,744  | 132.60 | 3,015,854.40  |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC    | 210,669 | 206.67 | 43,538,962.23 |
| HOWMET AEROSPACE INC           | 113,499 | 39.61  | 4,495,695.39  |
| HUBBELL INC                    | 17,543  | 228.00 | 3,999,804.00  |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE   | 13,307  | 216.86 | 2,885,756.02  |
| IDEX CORP                      | 24,460  | 232.80 | 5,694,288.00  |
| ILLINOIS TOOL WORKS            | 96,916  | 228.38 | 22,133,676.08 |
| INGERSOLL-RAND INC             | 128,498 | 55.95  | 7,189,463.10  |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD     | 52,400  | 53.03  | 2,778,772.00  |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL | 214,635 | 68.10  | 14,616,643.50 |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC      | 60,154  | 197.68 | 11,891,242.72 |
| LENNOX INTERNATIONAL INC       | 9,451   | 247.73 | 2,341,296.23  |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 74,782  | 454.16 | 33,962,993.12 |
| MASCO CORP                   | 67,470  | 51.32  | 3,462,560.40  |
| NORDSON CORP                 | 16,618  | 235.02 | 3,905,562.36  |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 46,136  | 463.29 | 21,374,347.44 |
| OTIS WORLDWIDE CORP          | 131,196 | 80.96  | 10,621,628.16 |
| OWENS CORNING                | 29,948  | 91.86  | 2,751,023.28  |
| PACCAR INC                   | 109,739 | 110.81 | 12,160,178.59 |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 40,291  | 310.20 | 12,498,268.20 |
| PENTAIR PLC                  | 53,508  | 50.74  | 2,714,995.92  |
| PLUG POWER INC               | 170,755 | 16.34  | 2,790,136.70  |
| QUANTA SERVICES INC          | 45,857  | 148.89 | 6,827,648.73  |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP   | 462,549 | 100.01 | 46,259,525.49 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 36,379  | 278.08 | 10,116,272.32 |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 47,364  | 46.18  | 2,187,269.52  |
| SMITH (A.O.) CORP            | 41,076  | 60.52  | 2,485,919.52  |
| SNAP-ON INC                  | 16,363  | 240.62 | 3,937,265.06  |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   | 44,255  | 85.80  | 3,797,079.00  |
| TEXTRON INC                  | 68,142  | 70.15  | 4,780,161.30  |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC       | 72,614  | 174.23 | 12,651,537.22 |
| TRANSDIGM GROUP INC          | 16,103  | 700.50 | 11,280,151.50 |
| UNITED RENTALS INC           | 22,028  | 392.48 | 8,645,549.44  |
| WABTEC CORP                  | 53,444  | 103.71 | 5,542,677.24  |
| WW GRAINGER INC              | 14,094  | 559.85 | 7,890,525.90  |
| XYLEM INC                    | 55,430  | 102.54 | 5,683,792.20  |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 40,983  | 97.16  | 3,981,908.28  |
| CINTAS CORP                  | 28,545  | 436.87 | 12,470,454.15 |
| CLARIVATE PLC                | 115,796 | 10.92  | 1,264,492.32  |
| COPART INC                   | 136,293 | 65.93  | 8,985,797.49  |
| COSTAR GROUP INC             | 123,594 | 77.37  | 9,562,467.78  |
| EQUIFAX INC                  | 39,313  | 215.30 | 8,464,088.90  |
| JACOBS SOLUTIONS INC         | 40,785  | 121.90 | 4,971,691.50  |
| LEIDOS HOLDINGS INC          | 38,646  | 98.15  | 3,793,104.90  |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 69,006  | 124.28 | 8,576,065.68  |
| ROBERT HALF INTL INC         | 31,924  | 78.88  | 2,518,165.12  |
| ROLLINS INC                  | 65,665  | 36.34  | 2,386,266.10  |
| TRANSUNION                   | 63,235  | 69.17  | 4,373,964.95  |
| VERISK ANALYTICS INC         | 48,167  | 180.11 | 8,675,358.37  |
| WASTE CONNECTIONS INC        | 81,624  | 131.71 | 10,750,697.04 |
| WASTE MANAGEMENT INC         | 129,107 | 153.11 | 19,767,572.77 |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC  | 40,475  | 96.84  | 3,919,599.00  |
| CSX CORP                     | 669,362 | 31.05  | 20,783,690.10 |
| DELTA AIR LINES INC          | 42,389  | 39.38  | 1,669,278.82  |

|                              |           |          |                |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| EXPEDITORS INTL WASH INC     | 51,822    | 107.75   | 5,583,820.50   |
| FEDEX CORP                   | 77,215    | 187.81   | 14,501,749.15  |
| GRAB HOLDINGS LTD - CL A     | 367,326   | 3.68     | 1,351,759.68   |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC  | 25,635    | 188.61   | 4,835,017.35   |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION  | 49,106    | 57.39    | 2,818,193.34   |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 73,430    | 242.97   | 17,841,287.10  |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE    | 30,505    | 320.56   | 9,778,682.80   |
| SOUTHWEST AIRLINES CO        | 50,383    | 36.87    | 1,857,621.21   |
| U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING | 27,432    | 61.53    | 1,687,890.96   |
| UBER TECHNOLOGIES INC        | 464,613   | 30.29    | 14,073,127.77  |
| UNION PACIFIC CORP           | 195,299   | 200.12   | 39,083,235.88  |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B   | 228,984   | 177.46   | 40,635,500.64  |
| ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV | 19,700    | 18.35    | 361,495.00     |
| APTIV PLC                    | 83,427    | 105.77   | 8,824,073.79   |
| BORGWARNER INC               | 78,768    | 44.85    | 3,532,744.80   |
| FORD MOTOR CO                | 1,236,567 | 12.79    | 15,815,691.93  |
| GENERAL MOTORS CO            | 433,556   | 36.32    | 15,746,753.92  |
| LEAR CORP                    | 17,306    | 134.72   | 2,331,464.32   |
| LUCID GROUP INC              | 108,300   | 8.87     | 960,621.00     |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A      | 88,300    | 18.69    | 1,650,327.00   |
| TESLA INC                    | 832,993   | 144.43   | 120,309,178.99 |
| DR HORTON INC                | 104,075   | 95.48    | 9,937,081.00   |
| GARMIN LTD                   | 48,921    | 98.62    | 4,824,589.02   |
| HASBRO INC                   | 42,578    | 64.10    | 2,729,249.80   |
| LENNAR CORP-A                | 77,896    | 99.04    | 7,714,819.84   |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 36,575    | 309.52   | 11,320,694.00  |
| MOHAWK INDUSTRIES INC        | 16,546    | 118.59   | 1,962,190.14   |
| NEWELL BRANDS INC            | 130,633   | 15.75    | 2,057,469.75   |
| NIKE INC -CL B               | 395,325   | 126.82   | 50,135,116.50  |
| NVR INC                      | 962       | 5,069.06 | 4,876,435.72   |
| PULTEGROUP INC               | 69,042    | 51.98    | 3,588,803.16   |
| VF CORP                      | 98,705    | 29.89    | 2,950,292.45   |
| WHIRLPOOL CORP               | 16,596    | 152.03   | 2,523,089.88   |
| AIRBNB INC-CLASS A           | 120,389   | 104.44   | 12,573,427.16  |
| ARAMARK                      | 72,988    | 44.70    | 3,262,563.60   |
| BOOKING HOLDINGS INC         | 12,403    | 2,390.75 | 29,652,472.25  |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC    | 67,558    | 51.85    | 3,502,882.30   |
| CARNIVAL CORP                | 322,950   | 10.88    | 3,513,696.00   |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 8,743     | 1,563.98 | 13,673,877.14  |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 38,486    | 147.78   | 5,687,461.08   |
| DOMINO'S PIZZA INC           | 10,935    | 350.64   | 3,834,248.40   |
| EXPEDIA GROUP INC            | 48,175    | 116.44   | 5,609,497.00   |

|                               |           |        |                |
|-------------------------------|-----------|--------|----------------|
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN  | 85,489    | 142.27 | 12,162,520.03  |
| LAS VEGAS SANDS CORP          | 109,170   | 55.02  | 6,006,533.40   |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A  | 86,490    | 172.33 | 14,904,821.70  |
| MCDONALD'S CORP               | 229,992   | 273.00 | 62,787,816.00  |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL     | 91,154    | 40.28  | 3,671,683.12   |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD   | 71,580    | 63.88  | 4,572,530.40   |
| STARBUCKS CORP                | 358,530   | 106.98 | 38,355,539.40  |
| VAIL RESORTS INC              | 12,637    | 252.70 | 3,193,369.90   |
| WYNN RESORTS LTD              | 33,881    | 98.59  | 3,340,327.79   |
| YUM! BRANDS INC               | 90,052    | 129.20 | 11,634,718.40  |
| ACTIVISION BLIZZARD INC       | 244,648   | 74.64  | 18,260,526.72  |
| ALPHABET INC-CL A             | 2,387,610 | 95.22  | 227,348,224.20 |
| ALPHABET INC-CL C             | 1,226,634 | 96.73  | 118,652,306.82 |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A  | 35,151    | 403.76 | 14,192,567.76  |
| COMCAST CORP-CLASS A          | 1,376,697 | 40.10  | 55,205,549.70  |
| DISH NETWORK CORP-A           | 84,434    | 14.68  | 1,239,491.12   |
| ELECTRONIC ARTS INC           | 88,747    | 127.56 | 11,320,567.32  |
| FOX CORP - CLASS A            | 94,197    | 33.49  | 3,154,657.53   |
| FOX CORP - CLASS B            | 50,847    | 31.33  | 1,593,036.51   |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC  | 116,863   | 36.31  | 4,243,295.53   |
| LIBERTY BROADBAND-C           | 37,365    | 92.54  | 3,457,757.10   |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A  | 22,942    | 40.28  | 924,103.76     |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C  | 50,965    | 40.19  | 2,048,283.35   |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C  | 58,729    | 70.08  | 4,115,728.32   |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN  | 51,866    | 77.53  | 4,021,170.98   |
| MATCH GROUP INC               | 89,286    | 50.54  | 4,512,514.44   |
| META PLATFORMS INC-CLASS A    | 713,286   | 141.50 | 100,929,969.00 |
| NETFLIX INC                   | 139,028   | 367.96 | 51,156,742.88  |
| NEWS CORP - CLASS A           | 109,126   | 20.64  | 2,252,360.64   |
| OMNICOM GROUP                 | 63,760    | 86.76  | 5,531,817.60   |
| PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B      | 194,365   | 21.93  | 4,262,424.45   |
| PINTEREST INC- CLASS A        | 179,393   | 26.12  | 4,685,745.16   |
| ROBLOX CORP -CLASS A          | 116,296   | 35.70  | 4,151,767.20   |
| ROKU INC                      | 38,981    | 52.15  | 2,032,859.15   |
| SEA LTD-ADR                   | 109,949   | 64.26  | 7,065,322.74   |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC        | 234,669   | 5.91   | 1,386,893.79   |
| SNAP INC - A                  | 350,310   | 9.67   | 3,387,497.70   |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 50,531    | 110.70 | 5,593,781.70   |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A   | 143,640   | 48.71  | 6,996,704.40   |
| WALT DISNEY CO/THE            | 569,835   | 108.12 | 61,610,560.20  |
| WARNER BROS DISCOVERY INC     | 729,902   | 14.53  | 10,605,476.06  |
| ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC     | 90,161    | 26.19  | 2,361,316.59   |

|                              |           |          |                |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| ADVANCE AUTO PARTS INC       | 19,129    | 149.11   | 2,852,325.19   |
| AMAZON.COM INC               | 2,866,864 | 97.18    | 278,601,843.52 |
| AUTOZONE INC                 | 6,092     | 2,357.81 | 14,363,778.52  |
| BATH & BODY WORKS INC        | 70,761    | 45.30    | 3,205,473.30   |
| BEST BUY CO INC              | 63,663    | 84.00    | 5,347,692.00   |
| BURLINGTON STORES INC        | 21,172    | 223.41   | 4,730,036.52   |
| CARMAX INC                   | 49,982    | 66.31    | 3,314,306.42   |
| CHEWY INC - CLASS A          | 31,027    | 44.81    | 1,390,319.87   |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 70,487    | 238.42   | 16,805,510.54  |
| DOLLAR TREE INC              | 69,978    | 149.56   | 10,465,909.68  |
| DOORDASH INC - A             | 77,241    | 59.53    | 4,598,156.73   |
| EBAY INC                     | 171,616   | 48.93    | 8,397,170.88   |
| ETSY INC                     | 41,138    | 135.86   | 5,589,008.68   |
| GENUINE PARTS CO             | 45,108    | 166.47   | 7,509,128.76   |
| HOME DEPOT INC               | 320,089   | 317.26   | 101,551,436.14 |
| LKQ CORP                     | 80,873    | 57.60    | 4,658,284.80   |
| LOWE'S COS INC               | 194,048   | 206.11   | 39,995,233.28  |
| MERCADOLIBRE INC             | 14,183    | 1,130.64 | 16,035,867.12  |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 19,783    | 800.47   | 15,835,698.01  |
| POOL CORP                    | 11,764    | 363.50   | 4,276,214.00   |
| ROSS STORES INC              | 109,791   | 120.20   | 13,196,878.20  |
| TARGET CORP                  | 143,882   | 164.21   | 23,626,863.22  |
| TJX COMPANIES INC            | 362,770   | 82.65    | 29,982,940.50  |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY       | 33,889    | 213.82   | 7,246,145.98   |
| ULTA BEAUTY INC              | 16,178    | 502.63   | 8,131,548.14   |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 138,483   | 490.88   | 67,978,535.04  |
| KROGER CO                    | 214,168   | 44.90    | 9,616,143.20   |
| SYSCO CORP                   | 159,336   | 79.15    | 12,611,444.40  |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 229,434   | 36.28    | 8,323,865.52   |
| WALMART INC                  | 471,311   | 142.34   | 67,086,407.74  |
| ALTRIA GROUP INC             | 563,278   | 44.93    | 25,308,080.54  |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    | 175,317   | 85.57    | 15,001,875.69  |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    | 96,533    | 68.35    | 6,598,030.55   |
| BUNGE LTD                    | 49,109    | 96.88    | 4,757,679.92   |
| CAMPBELL SOUP CO             | 67,404    | 51.66    | 3,482,090.64   |
| COCA-COLA CO/THE             | 1,284,384 | 60.93    | 78,257,517.12  |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE | 66,711    | 56.04    | 3,738,484.44   |
| CONAGRA BRANDS INC           | 144,308   | 37.14    | 5,359,599.12   |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 49,810    | 228.93   | 11,403,003.30  |
| DARLING INGREDIENTS INC      | 46,660    | 66.04    | 3,081,426.40   |
| GENERAL MILLS INC            | 186,107   | 77.87    | 14,492,152.09  |
| HERSHEY CO/THE               | 46,600    | 220.99   | 10,298,134.00  |

|                              |         |        |                |
|------------------------------|---------|--------|----------------|
| HORMEL FOODS CORP            | 91,879  | 44.76  | 4,112,504.04   |
| JM SMUCKER CO/THE            | 34,139  | 150.13 | 5,125,288.07   |
| KELLOGG CO                   | 77,861  | 68.02  | 5,296,105.22   |
| KEURIG DR PEPPER INC         | 243,679 | 34.96  | 8,519,017.84   |
| KRAFT HEINZ CO/THE           | 229,905 | 39.95  | 9,184,704.75   |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC     | 46,449  | 97.76  | 4,540,854.24   |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 78,366  | 77.98  | 6,110,980.68   |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO - B | 62,806  | 52.92  | 3,323,693.52   |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 427,786 | 65.00  | 27,806,090.00  |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 124,055 | 103.52 | 12,842,173.60  |
| PEPSICO INC                  | 431,475 | 171.93 | 74,183,496.75  |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 484,606 | 103.42 | 50,117,952.52  |
| TYSON FOODS INC-CL A         | 90,533  | 65.81  | 5,957,976.73   |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 76,721  | 82.12  | 6,300,328.52   |
| CLOROX COMPANY               | 37,180  | 141.47 | 5,259,854.60   |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 248,345 | 75.77  | 18,817,100.65  |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 72,334  | 273.94 | 19,815,175.96  |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 105,792 | 132.06 | 13,970,891.52  |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 746,140 | 141.72 | 105,742,960.80 |
| ABBOTT LABORATORIES          | 547,245 | 111.00 | 60,744,195.00  |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | 23,814  | 252.08 | 6,003,033.12   |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 47,368  | 163.46 | 7,742,773.28   |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     | 161,736 | 46.14  | 7,462,499.04   |
| BECTON DICKINSON AND CO      | 88,994  | 246.78 | 21,961,939.32  |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       | 445,379 | 46.12  | 20,540,879.48  |
| CARDINAL HEALTH INC          | 82,871  | 75.73  | 6,275,820.83   |
| CENTENE CORP                 | 178,830 | 76.05  | 13,600,021.50  |
| CIGNA CORP                   | 95,429  | 313.59 | 29,925,580.11  |
| COOPER COS INC/THE           | 15,553  | 343.58 | 5,343,699.74   |
| CVS HEALTH CORP              | 410,518 | 85.75  | 35,201,918.50  |
| DAVITA INC                   | 16,659  | 77.48  | 1,290,739.32   |
| DENTSPLY SIRONA INC          | 64,432  | 36.59  | 2,357,566.88   |
| DEXCOM INC                   | 122,544 | 104.00 | 12,744,576.00  |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP    | 193,380 | 77.69  | 15,023,692.20  |
| ELEVANCE HEALTH INC          | 75,051  | 495.59 | 37,194,525.09  |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGY     | 117,163 | 68.71  | 8,050,269.73   |
| HCA HEALTHCARE INC           | 71,820  | 253.64 | 18,216,424.80  |
| HENRY SCHEIN INC             | 41,137  | 83.75  | 3,445,223.75   |
| HOLOGIC INC                  | 78,244  | 81.70  | 6,392,534.80   |
| HUMANA INC                   | 39,560  | 502.22 | 19,867,823.20  |
| IDEXX LABORATORIES INC       | 25,962  | 485.18 | 12,596,243.16  |
| INSULET CORP                 | 22,107  | 289.70 | 6,404,397.90   |



|                              |         |          |                |
|------------------------------|---------|----------|----------------|
| INTUITIVE SURGICAL INC       | 111,424 | 243.80   | 27,165,171.20  |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 29,015  | 253.70   | 7,361,105.50   |
| MASIMO CORP                  | 16,542  | 166.45   | 2,753,415.90   |
| MCKESSON CORP                | 45,017  | 376.05   | 16,928,642.85  |
| MEDTRONIC PLC                | 415,210 | 81.20    | 33,715,052.00  |
| MOLINA HEALTHCARE INC        | 17,600  | 297.22   | 5,231,072.00   |
| NOVOCURE LTD                 | 30,832  | 90.16    | 2,779,813.12   |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 37,107  | 144.91   | 5,377,175.37   |
| RESMED INC                   | 46,772  | 231.16   | 10,811,815.52  |
| STERIS PLC                   | 31,354  | 205.00   | 6,427,570.00   |
| STRYKER CORP                 | 106,169 | 252.95   | 26,855,448.55  |
| TELEFLEX INC                 | 15,114  | 240.36   | 3,632,801.04   |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 292,541 | 492.50   | 144,076,442.50 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 20,248  | 146.15   | 2,959,245.20   |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    | 44,426  | 170.17   | 7,559,972.42   |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 64,308  | 124.90   | 8,032,069.20   |
| ABBVIE INC                   | 552,744 | 147.79   | 81,690,035.76  |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 92,347  | 155.76   | 14,383,968.72  |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 36,864  | 229.02   | 8,442,593.28   |
| AMGEN INC                    | 167,205 | 256.54   | 42,894,770.70  |
| AVANTOR INC                  | 217,209 | 23.23    | 5,045,765.07   |
| BIO-RAD LABORATORIES-A       | 6,947   | 456.69   | 3,172,625.43   |
| BIO-TECHNE CORP              | 47,945  | 79.83    | 3,827,449.35   |
| BIOGEN INC                   | 45,518  | 292.34   | 13,306,732.12  |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 58,061  | 116.03   | 6,736,817.83   |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 667,568 | 73.17    | 48,845,950.56  |
| CATALENT INC                 | 48,721  | 50.16    | 2,443,845.36   |
| CHARLES RIVER LABORATORIES   | 15,602  | 240.92   | 3,758,833.84   |
| DANAHER CORP                 | 215,967 | 262.95   | 56,788,522.65  |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC     | 148,648 | 13.30    | 1,977,018.40   |
| ELI LILLY & CO               | 252,567 | 349.73   | 88,330,256.91  |
| EXACT SCIENCES CORP          | 56,656  | 64.25    | 3,640,148.00   |
| GILEAD SCIENCES INC          | 391,604 | 84.07    | 32,922,148.28  |
| HORIZON THERAPEUTICS PLC     | 69,187  | 113.00   | 7,818,131.00   |
| ILLUMINA INC                 | 48,052  | 211.04   | 10,140,894.08  |
| INCYTE CORP                  | 59,677  | 84.97    | 5,070,754.69   |
| IQVIA HOLDINGS INC           | 58,385  | 226.50   | 13,224,202.50  |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC     | 20,987  | 155.34   | 3,260,120.58   |
| JOHNSON & JOHNSON            | 822,125 | 169.51   | 139,358,408.75 |
| MERCK & CO. INC.             | 792,132 | 108.59   | 86,017,613.88  |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 7,022   | 1,531.57 | 10,754,684.54  |
| MODERNA INC                  | 103,959 | 193.07   | 20,071,364.13  |

|                              |           |        |                |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC   | 31,737    | 108.80 | 3,452,985.60   |
| PERKINELMER INC              | 38,316    | 135.08 | 5,175,725.28   |
| PFIZER INC                   | 1,755,039 | 45.07  | 79,099,607.73  |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 33,513    | 741.18 | 24,839,165.34  |
| REPLIGEN CORP                | 15,344    | 181.82 | 2,789,846.08   |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A     | 111,881   | 38.72  | 4,332,032.32   |
| SEAGEN INC                   | 42,905    | 138.01 | 5,921,319.05   |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   | 360,337   | 10.20  | 3,675,437.40   |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 122,459   | 575.32 | 70,453,111.88  |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 80,132    | 315.28 | 25,264,016.96  |
| VIATRIS INC                  | 379,530   | 11.64  | 4,417,729.20   |
| WATERS CORP                  | 18,156    | 334.36 | 6,070,640.16   |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 23,847    | 260.47 | 6,211,428.09   |
| ZOETIS INC                   | 146,326   | 165.51 | 24,218,416.26  |
| BANK OF AMERICA CORP         | 2,261,221 | 34.87  | 78,848,776.27  |
| CITIGROUP INC                | 605,548   | 51.90  | 31,427,941.20  |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 155,051   | 42.75  | 6,628,430.25   |
| FIFTH THIRD BANCORP          | 218,270   | 35.76  | 7,805,335.20   |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A   | 3,794     | 795.06 | 3,016,457.64   |
| FIRST HORIZON CORP           | 173,558   | 24.55  | 4,260,848.90   |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA       | 57,059    | 137.72 | 7,858,165.48   |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC    | 461,466   | 14.75  | 6,806,623.50   |
| JPMORGAN CHASE & CO          | 916,911   | 139.12 | 127,560,658.32 |
| KEYCORP                      | 279,576   | 18.33  | 5,124,628.08   |
| M & T BANK CORP              | 53,284    | 155.89 | 8,306,442.76   |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 128,187   | 160.18 | 20,532,993.66  |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 290,215   | 22.90  | 6,645,923.50   |
| SIGNATURE BANK               | 19,656    | 125.95 | 2,475,673.20   |
| SVB FINANCIAL GROUP          | 18,071    | 294.76 | 5,326,607.96   |
| TRUIST FINANCIAL CORP        | 414,705   | 48.78  | 20,229,309.90  |
| US BANCORP                   | 441,462   | 49.15  | 21,697,857.30  |
| WEBSTER FINANCIAL CORP       | 57,805    | 47.30  | 2,734,176.50   |
| WELLS FARGO & CO             | 1,185,751 | 45.34  | 53,761,950.34  |
| ALLY FINANCIAL INC           | 92,854    | 32.67  | 3,033,540.18   |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 199,341   | 156.77 | 31,250,688.57  |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 33,811    | 343.01 | 11,597,511.11  |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 147,838   | 22.26  | 3,290,873.88   |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 122,843   | 67.60  | 8,304,186.80   |
| ARES MANAGEMENT CORP - A     | 51,159    | 78.40  | 4,010,865.60   |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 242,312   | 49.99  | 12,113,176.88  |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 406,797   | 311.90 | 126,879,984.30 |
| BLACKROCK INC                | 47,158    | 751.25 | 35,427,447.50  |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| BLACKSTONE INC               | 219,544 | 88.86  | 19,508,679.84 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 120,337 | 116.09 | 13,969,922.33 |
| CARLYLE GROUP INC/THE        | 60,998  | 34.50  | 2,104,431.00  |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC      | 32,452  | 122.39 | 3,971,800.28  |
| CME GROUP INC                | 112,428 | 173.38 | 19,492,766.64 |
| COINBASE GLOBAL INC -CLASS A | 34,300  | 52.76  | 1,809,668.00  |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | 84,035  | 114.90 | 9,655,621.50  |
| EQUITABLE HOLDINGS INC       | 115,779 | 30.71  | 3,555,573.09  |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 12,356  | 413.84 | 5,113,407.04  |
| FRANKLIN RESOURCES INC       | 95,796  | 30.19  | 2,892,081.24  |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR        | 20,000  | 53.80  | 1,076,000.00  |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      | 106,737 | 349.63 | 37,318,457.31 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 174,637 | 106.49 | 18,597,094.13 |
| INVESCO LTD                  | 93,982  | 18.00  | 1,691,676.00  |
| KKR & CO INC                 | 175,223 | 53.57  | 9,386,696.11  |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC   | 24,619  | 231.94 | 5,710,130.86  |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC     | 11,374  | 363.28 | 4,131,946.72  |
| MOODY'S CORP                 | 51,695  | 315.73 | 16,321,662.35 |
| MORGAN STANLEY               | 402,576 | 95.64  | 38,502,368.64 |
| MSCI INC                     | 25,218  | 508.64 | 12,826,883.52 |
| NASDAQ INC                   | 108,285 | 58.30  | 6,313,015.50  |
| NORTHERN TRUST CORP          | 62,611  | 94.35  | 5,907,347.85  |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | 60,787  | 118.11 | 7,179,552.57  |
| S&P GLOBAL INC               | 106,507 | 366.38 | 39,022,034.66 |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 454,729 | 79.21  | 36,019,084.09 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | 39,270  | 63.04  | 2,475,580.80  |
| STATE STREET CORP            | 115,101 | 88.20  | 10,151,908.20 |
| SYNCHRONY FINANCIAL          | 154,684 | 36.88  | 5,704,745.92  |
| T ROWE PRICE GROUP INC       | 68,866  | 116.64 | 8,032,530.24  |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | 31,248  | 73.89  | 2,308,914.72  |
| AFLAC INC                    | 188,070 | 73.09  | 13,746,036.30 |
| ALLSTATE CORP                | 84,624  | 128.62 | 10,884,338.88 |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 23,305  | 138.83 | 3,235,433.15  |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 237,263 | 63.50  | 15,066,200.50 |
| AON PLC-CLASS A              | 65,955  | 322.92 | 21,298,188.60 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       | 112,743 | 64.80  | 7,305,746.40  |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      | 65,709  | 197.15 | 12,954,529.35 |
| ASSURANT INC                 | 18,269  | 130.68 | 2,387,392.92  |
| BROWN & BROWN INC            | 74,733  | 58.96  | 4,406,257.68  |
| CHUBB LTD                    | 130,563 | 229.77 | 29,999,460.51 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    | 47,190  | 105.17 | 4,962,972.30  |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A  | 7,461   | 249.12 | 1,858,684.32  |

|                              |         |          |               |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| EVEREST RE GROUP LTD         | 12,726  | 350.84   | 4,464,789.84  |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL  | 86,645  | 43.25    | 3,747,396.25  |
| GLOBE LIFE INC               | 30,200  | 120.74   | 3,646,348.00  |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP  | 99,553  | 77.09    | 7,674,540.77  |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 44,118  | 32.80    | 1,447,070.40  |
| LOEWS CORP                   | 65,826  | 60.59    | 3,988,397.34  |
| MARKEL CORP                  | 4,198   | 1,403.38 | 5,891,389.24  |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 155,896 | 173.28   | 27,013,658.88 |
| METLIFE INC                  | 211,249 | 71.56    | 15,116,978.44 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 76,063  | 90.69    | 6,898,153.47  |
| PROGRESSIVE CORP             | 182,981 | 135.47   | 24,788,436.07 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 117,748 | 101.53   | 11,954,954.44 |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 74,170  | 190.74   | 14,147,185.80 |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 35,060  | 253.57   | 8,890,164.20  |
| WR BERKLEY CORP              | 64,951  | 71.42    | 4,638,800.42  |
| CBRE GROUP INC - A           | 100,186 | 83.05    | 8,320,447.30  |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | 356,100 | 4.80     | 1,709,280.00  |
| ZILLOW GROUP INC - C         | 51,785  | 42.25    | 2,187,916.25  |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 197,847 | 273.16   | 54,043,886.52 |
| ADOBE INC                    | 146,371 | 358.17   | 52,425,701.07 |
| AFFIRM HOLDINGS INC          | 52,787  | 14.14    | 746,408.18    |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC      | 48,096  | 86.62    | 4,166,075.52  |
| ANSYS INC                    | 27,667  | 260.03   | 7,194,250.01  |
| ASPEN TECHNOLOGY INC         | 8,440   | 194.27   | 1,639,638.80  |
| AUTODESK INC                 | 67,944  | 202.50   | 13,758,660.00 |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING    | 129,964 | 228.01   | 29,633,091.64 |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B  | 61,932  | 38.06    | 2,357,131.92  |
| BILL.COM HOLDINGS INC        | 28,947  | 106.71   | 3,088,934.37  |
| BLACK KNIGHT INC             | 45,674  | 60.52    | 2,764,190.48  |
| BLOCK INC                    | 166,869 | 80.77    | 13,478,009.13 |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 35,232  | 148.99   | 5,249,215.68  |
| CADENCE DESIGN SYS INC       | 85,654  | 182.48   | 15,630,141.92 |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC     | 39,980  | 71.30    | 2,850,574.00  |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    | 33,201  | 128.44   | 4,264,336.44  |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A     | 77,516  | 46.16    | 3,578,138.56  |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 162,316 | 64.14    | 10,410,948.24 |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 65,057  | 100.82   | 6,559,046.74  |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 14,727  | 135.58   | 1,996,686.66  |
| DATADOG INC - CLASS A        | 78,741  | 70.75    | 5,570,925.75  |
| DOCUSIGN INC                 | 61,926  | 57.33    | 3,550,217.58  |
| DROPBOX INC-CLASS A          | 81,861  | 22.97    | 1,880,347.17  |
| DYNATRACE INC                | 58,672  | 36.89    | 2,164,410.08  |

|                             |           |        |                |
|-----------------------------|-----------|--------|----------------|
| EPAM SYSTEMS INC            | 18,298    | 329.04 | 6,020,773.92   |
| FAIR ISAAC CORP             | 7,640     | 642.83 | 4,911,221.20   |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV | 190,030   | 74.22  | 14,104,026.60  |
| FISERV INC                  | 189,755   | 104.40 | 19,810,422.00  |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC   | 23,091    | 200.30 | 4,625,127.30   |
| FORTINET INC                | 209,581   | 51.76  | 10,847,912.56  |
| GARTNER INC                 | 25,127    | 328.60 | 8,256,732.20   |
| GEN DIGITAL INC             | 182,160   | 22.60  | 4,116,816.00   |
| GLOBAL PAYMENTS INC         | 86,971    | 111.68 | 9,712,921.28   |
| GODADDY INC - CLASS A       | 50,548    | 81.36  | 4,112,585.28   |
| HUBSPOT INC                 | 14,849    | 349.45 | 5,188,983.05   |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 282,461   | 140.76 | 39,759,210.36  |
| INTUIT INC                  | 83,794    | 401.90 | 33,676,808.60  |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 21,825    | 178.92 | 3,904,929.00   |
| MASTERCARD INC - A          | 269,766   | 382.39 | 103,155,820.74 |
| MICROSOFT CORP              | 2,215,502 | 240.61 | 533,071,936.22 |
| MONGODB INC                 | 20,794    | 195.14 | 4,057,741.16   |
| OKTA INC                    | 47,660    | 67.96  | 3,238,973.60   |
| ORACLE CORP                 | 500,077   | 89.64  | 44,826,902.28  |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A | 525,499   | 7.22   | 3,794,102.78   |
| PALO ALTO NETWORKS INC      | 93,513    | 151.78 | 14,193,403.14  |
| PAYCHEX INC                 | 101,457   | 115.62 | 11,730,458.34  |
| PAYCOM SOFTWARE INC         | 15,597    | 314.60 | 4,906,816.20   |
| PAYLOCITY HOLDING CORP      | 12,042    | 194.18 | 2,338,315.56   |
| PAYPAL HOLDINGS INC         | 343,509   | 79.10  | 27,171,561.90  |
| PTC INC                     | 36,419    | 134.09 | 4,883,423.71   |
| ROPER TECHNOLOGIES INC      | 33,128    | 444.23 | 14,716,451.44  |
| SALESFORCE INC              | 312,712   | 156.17 | 48,836,233.04  |
| SERVICENOW INC              | 63,190    | 448.77 | 28,357,776.30  |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A       | 69,734    | 144.44 | 10,072,378.96  |
| SPLUNK INC                  | 48,503    | 92.34  | 4,478,767.02   |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS  | 71,344    | 57.92  | 4,132,244.48   |
| SYNOPSYS INC                | 47,768    | 349.27 | 16,683,929.36  |
| TOAST INC-CLASS A           | 71,887    | 22.06  | 1,585,827.22   |
| TWILIO INC - A              | 50,201    | 56.56  | 2,839,368.56   |
| TYLER TECHNOLOGIES INC      | 13,376    | 318.15 | 4,255,574.40   |
| UNITY SOFTWARE INC          | 72,232    | 34.73  | 2,508,617.36   |
| VERISIGN INC                | 30,362    | 214.95 | 6,526,311.90   |
| VISA INC-CLASS A SHARES     | 511,158   | 224.90 | 114,959,434.20 |
| VMWARE INC-CLASS A          | 66,052    | 125.04 | 8,259,142.08   |
| WESTERN UNION CO            | 135,549   | 14.18  | 1,922,084.82   |
| WIX.COM LTD                 | 16,678    | 85.48  | 1,425,635.44   |

|                              |           |        |                |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|
| WORKDAY INC-CLASS A          | 63,683    | 174.44 | 11,108,862.52  |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A  | 69,126    | 68.89  | 4,762,090.14   |
| ZSCALER INC                  | 28,648    | 119.91 | 3,435,181.68   |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 186,146   | 79.36  | 14,772,546.56  |
| APPLE INC                    | 5,025,400 | 141.86 | 712,903,244.00 |
| ARISTA NETWORKS INC          | 77,216    | 121.54 | 9,384,832.64   |
| ARROW ELECTRONICS INC        | 18,289    | 116.50 | 2,130,668.50   |
| CDW CORP/DE                  | 41,579    | 192.12 | 7,988,157.48   |
| CISCO SYSTEMS INC            | 1,294,565 | 47.98  | 62,113,228.70  |
| COGNEX CORP                  | 56,700    | 53.14  | 3,013,038.00   |
| CORNING INC                  | 254,100   | 35.56  | 9,035,796.00   |
| DELL TECHNOLOGIES -C         | 82,035    | 40.52  | 3,324,058.20   |
| F5 INC                       | 17,424    | 145.49 | 2,535,017.76   |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE   | 396,034   | 16.13  | 6,388,028.42   |
| HP INC                       | 324,391   | 28.69  | 9,306,777.79   |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 105,432   | 31.98  | 3,371,715.36   |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN     | 56,675    | 180.85 | 10,249,673.75  |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 52,060    | 258.57 | 13,461,154.20  |
| NETAPP INC                   | 65,481    | 66.37  | 4,345,973.97   |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS  | 62,439    | 62.25  | 3,886,827.75   |
| TE CONNECTIVITY LTD          | 100,466   | 123.57 | 12,414,583.62  |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC    | 15,065    | 429.50 | 6,470,417.50   |
| TRIMBLE INC                  | 81,451    | 56.57  | 4,607,683.07   |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 92,989    | 41.31  | 3,841,375.59   |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 16,368    | 310.57 | 5,083,409.76   |
| AT&T INC                     | 2,227,379 | 20.42  | 45,483,079.18  |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C        | 82,999    | 22.15  | 1,838,427.85   |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A         | 55,653    | 21.47  | 1,194,869.91   |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC       | 280,122   | 5.30   | 1,484,646.60   |
| T-MOBILE US INC              | 195,618   | 148.07 | 28,965,157.26  |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 1,312,795 | 40.33  | 52,945,022.35  |
| AES CORP                     | 215,104   | 27.01  | 5,809,959.04   |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 78,245    | 54.41  | 4,257,310.45   |
| AMEREN CORPORATION           | 78,384    | 86.89  | 6,810,785.76   |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 160,516   | 92.35  | 14,823,652.60  |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 57,068    | 155.51 | 8,874,644.68   |
| ATMOS ENERGY CORP            | 44,651    | 115.14 | 5,141,116.14   |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 197,928   | 30.04  | 5,945,757.12   |
| CMS ENERGY CORP              | 92,467    | 62.15  | 5,746,824.05   |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 112,923   | 94.45  | 10,665,577.35  |
| CONSTELLATION ENERGY         | 102,382   | 83.40  | 8,538,658.80   |
| DOMINION ENERGY INC          | 260,834   | 62.32  | 16,255,174.88  |

|                              |           |        |                |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|
| DTE ENERGY COMPANY           | 58,893    | 113.41 | 6,679,055.13   |
| DUKE ENERGY CORP             | 240,759   | 101.42 | 24,417,777.78  |
| EDISON INTERNATIONAL         | 117,509   | 67.53  | 7,935,382.77   |
| ENTERGY CORP                 | 61,506    | 107.50 | 6,611,895.00   |
| ESSENTIAL UTILITIES INC      | 74,924    | 46.92  | 3,515,434.08   |
| EVERGY INC                   | 71,920    | 61.93  | 4,454,005.60   |
| EVERSOURCE ENERGY            | 108,330   | 79.71  | 8,634,984.30   |
| EXELON CORP                  | 309,562   | 41.42  | 12,822,058.04  |
| FIRSTENERGY CORP             | 165,348   | 41.00  | 6,779,268.00   |
| NEXTERA ENERGY INC           | 614,250   | 76.59  | 47,045,407.50  |
| NISOURCE INC                 | 122,940   | 27.58  | 3,390,685.20   |
| NRG ENERGY INC               | 77,774    | 33.15  | 2,578,208.10   |
| P G & E CORP                 | 474,569   | 16.00  | 7,593,104.00   |
| PPL CORP                     | 225,781   | 29.50  | 6,660,539.50   |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 155,984   | 60.85  | 9,491,626.40   |
| SEMPRA ENERGY                | 98,168    | 158.98 | 15,606,748.64  |
| SOUTHERN CO/THE              | 340,384   | 67.26  | 22,894,227.84  |
| UGI CORP                     | 62,839    | 39.77  | 2,499,107.03   |
| VISTRA CORP                  | 119,689   | 22.57  | 2,701,380.73   |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 98,739    | 92.74  | 9,157,054.86   |
| XCEL ENERGY INC              | 171,591   | 68.56  | 11,764,278.96  |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 504,432   | 74.91  | 37,787,001.12  |
| ANALOG DEVICES INC           | 160,268   | 168.45 | 26,997,144.60  |
| APPLIED MATERIALS INC        | 268,938   | 113.95 | 30,645,485.10  |
| BROADCOM INC                 | 126,199   | 585.68 | 73,912,230.32  |
| ENPHASE ENERGY INC           | 43,002    | 210.32 | 9,044,180.64   |
| ENTEGRIS INC                 | 47,458    | 79.36  | 3,766,266.88   |
| FIRST SOLAR INC              | 30,588    | 168.26 | 5,146,736.88   |
| INTEL CORP                   | 1,283,676 | 29.70  | 38,125,177.20  |
| KLA CORP                     | 44,297    | 422.62 | 18,720,798.14  |
| LAM RESEARCH CORP            | 42,834    | 488.40 | 20,920,125.60  |
| MARVELL TECHNOLOGY INC       | 265,687   | 42.74  | 11,355,462.38  |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC     | 172,489   | 76.13  | 13,131,587.57  |
| MICRON TECHNOLOGY INC        | 344,595   | 61.54  | 21,206,376.30  |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 14,391    | 424.69 | 6,111,713.79   |
| NVIDIA CORP                  | 778,463   | 193.23 | 150,422,405.49 |
| NXP SEMICONDUCTORS NV        | 81,883    | 174.10 | 14,255,830.30  |
| ON SEMICONDUCTOR             | 137,273   | 71.81  | 9,857,574.13   |
| QORVO INC                    | 33,116    | 110.11 | 3,646,402.76   |
| QUALCOMM INC                 | 351,153   | 131.17 | 46,060,739.01  |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC       | 51,093    | 109.42 | 5,590,596.06   |
| SOLAREdge TECHNOLOGIES INC   | 17,872    | 300.52 | 5,370,893.44   |

|       |                              |             |        |                                          |  |
|-------|------------------------------|-------------|--------|------------------------------------------|--|
|       | TERADYNE INC                 | 48,350      | 103.44 | 5,001,324.00                             |  |
|       | TEXAS INSTRUMENTS INC        | 285,503     | 175.04 | 49,974,445.12                            |  |
|       | WOLFSPEED INC                | 36,225      | 81.96  | 2,969,001.00                             |  |
|       | アメリカドル 小計                    | 106,642,052 |        | 10,848,768,737.37<br>(1,402,420,334,679) |  |
| カナダドル | ARC RESOURCES LTD            | 192,700     | 16.11  | 3,104,397.00                             |  |
|       | CAMECO CORP                  | 142,600     | 36.56  | 5,213,456.00                             |  |
|       | CANADIAN NATURAL RESOURCES   | 350,700     | 79.77  | 27,975,339.00                            |  |
|       | CENOVUS ENERGY INC           | 422,100     | 25.62  | 10,814,202.00                            |  |
|       | ENBRIDGE INC                 | 630,100     | 54.18  | 34,138,818.00                            |  |
|       | IMPERIAL OIL LTD             | 65,500      | 69.78  | 4,570,590.00                             |  |
|       | KEYERA CORP                  | 76,700      | 30.65  | 2,350,855.00                             |  |
|       | PARKLAND CORP                | 57,100      | 31.23  | 1,783,233.00                             |  |
|       | PEMBINA PIPELINE CORP        | 177,532     | 47.40  | 8,415,016.80                             |  |
|       | SUNCOR ENERGY INC            | 430,700     | 44.35  | 19,101,545.00                            |  |
|       | TC ENERGY CORP               | 316,300     | 57.32  | 18,130,316.00                            |  |
|       | TOURMALINE OIL CORP          | 95,200      | 62.74  | 5,972,848.00                             |  |
|       | AGNICO EAGLE MINES LTD       | 145,040     | 77.52  | 11,243,500.80                            |  |
|       | BARRICK GOLD CORP            | 554,700     | 26.48  | 14,688,456.00                            |  |
|       | CCL INDUSTRIES INC - CL B    | 42,500      | 61.52  | 2,614,600.00                             |  |
|       | FIRST QUANTUM MINERALS LTD   | 175,900     | 30.85  | 5,426,515.00                             |  |
|       | FRANCO-NEVADA CORP           | 58,700      | 201.98 | 11,856,226.00                            |  |
|       | IVANHOE MINES LTD-CL A       | 193,100     | 12.40  | 2,394,440.00                             |  |
|       | KINROSS GOLD CORP            | 392,200     | 6.52   | 2,557,144.00                             |  |
|       | LUNDIN MINING CORP           | 222,100     | 9.57   | 2,125,497.00                             |  |
|       | NUTRIEN LTD                  | 169,659     | 106.09 | 17,999,123.31                            |  |
|       | PAN AMERICAN SILVER CORP     | 75,100      | 25.67  | 1,927,817.00                             |  |
|       | TECK RESOURCES LTD-CLS B     | 155,300     | 55.31  | 8,589,643.00                             |  |
|       | WEST FRASER TIMBER CO LTD    | 18,200      | 107.02 | 1,947,764.00                             |  |
|       | WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 141,300     | 62.21  | 8,790,273.00                             |  |
|       | CAE INC                      | 97,800      | 29.39  | 2,874,342.00                             |  |
|       | TOROMONT INDUSTRIES LTD      | 28,300      | 105.70 | 2,991,310.00                             |  |
|       | WSP GLOBAL INC               | 40,300      | 169.62 | 6,835,686.00                             |  |
|       | GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT | 51,900      | 42.23  | 2,191,737.00                             |  |
|       | RITCHIE BROS AUCTIONEERS     | 32,700      | 77.87  | 2,546,349.00                             |  |
|       | THOMSON REUTERS CORP         | 52,132      | 157.68 | 8,220,173.76                             |  |
|       | AIR CANADA                   | 62,200      | 22.42  | 1,394,524.00                             |  |
|       | CANADIAN NATL RAILWAY CO     | 183,700     | 158.17 | 29,055,829.00                            |  |
|       | CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 290,800     | 102.96 | 29,940,768.00                            |  |
|       | TFI INTERNATIONAL INC        | 22,900      | 143.60 | 3,288,440.00                             |  |
|       | MAGNA INTERNATIONAL INC      | 88,900      | 81.83  | 7,274,687.00                             |  |
|       | BRP INC/CA- SUB VOTING       | 9,100       | 107.04 | 974,064.00                               |  |



|                              |         |          |               |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        | 57,100  | 40.70    | 2,323,970.00  |
| RESTAURANT BRANDS INTERN     | 93,010  | 90.84    | 8,449,028.40  |
| QUEBECOR INC -CL B           | 39,300  | 32.36    | 1,271,748.00  |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B    | 146,400 | 39.82    | 5,829,648.00  |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A   | 15,700  | 159.11   | 2,498,027.00  |
| DOLLARAMA INC                | 86,700  | 84.26    | 7,305,342.00  |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 255,500 | 62.26    | 15,907,430.00 |
| EMPIRE CO LTD 'A'            | 55,300  | 37.20    | 2,057,160.00  |
| LOBLAW COMPANIES LTD         | 50,700  | 120.32   | 6,100,224.00  |
| METRO INC/CN                 | 74,600  | 74.19    | 5,534,574.00  |
| WESTON (GEORGE) LTD          | 21,811  | 176.55   | 3,850,732.05  |
| SAPUTO INC                   | 76,200  | 35.13    | 2,676,906.00  |
| BANK OF MONTREAL             | 209,800 | 133.48   | 28,004,104.00 |
| BANK OF NOVA SCOTIA          | 374,100 | 70.11    | 26,228,151.00 |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  | 284,300 | 58.39    | 16,600,277.00 |
| NATIONAL BANK OF CANADA      | 104,800 | 98.66    | 10,339,568.00 |
| ROYAL BANK OF CANADA         | 435,100 | 133.49   | 58,081,499.00 |
| TORONTO-DOMINION BANK        | 568,500 | 90.11    | 51,227,535.00 |
| BROOKFIELD ASSET MGMT-A      | 113,787 | 42.30    | 4,813,190.10  |
| BROOKFIELD CORP              | 439,550 | 49.39    | 21,709,374.50 |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR | 115,800 | 19.00    | 2,200,200.00  |
| IGM FINANCIAL INC            | 20,700  | 41.20    | 852,840.00    |
| ONEX CORPORATION             | 24,300  | 68.41    | 1,662,363.00  |
| TMX GROUP LTD                | 16,000  | 135.18   | 2,162,880.00  |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD  | 6,900   | 854.36   | 5,895,084.00  |
| GREAT-WEST LIFECO INC        | 86,000  | 34.72    | 2,985,920.00  |
| IA FINANCIAL CORP INC        | 34,100  | 81.76    | 2,788,016.00  |
| INTACT FINANCIAL CORP        | 55,900  | 200.58   | 11,212,422.00 |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      | 594,600 | 26.03    | 15,477,438.00 |
| POWER CORP OF CANADA         | 168,700 | 35.76    | 6,032,712.00  |
| SUN LIFE FINANCIAL INC       | 184,100 | 65.61    | 12,078,801.00 |
| FIRSTSERVICE CORP            | 13,900  | 191.00   | 2,654,900.00  |
| CGI INC                      | 65,300  | 114.18   | 7,455,954.00  |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC   | 6,300   | 2,320.59 | 14,619,717.00 |
| DESCARTES SYSTEMS GRP/THE    | 24,900  | 96.24    | 2,396,376.00  |
| NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG   | 17,800  | 44.60    | 793,880.00    |
| OPEN TEXT CORP               | 91,800  | 44.20    | 4,057,560.00  |
| SHOPIFY INC - CLASS A        | 371,900 | 63.34    | 23,556,146.00 |
| BCE INC                      | 22,600  | 62.20    | 1,405,720.00  |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B  | 112,600 | 65.90    | 7,420,340.00  |
| TELUS CORP                   | 145,100 | 28.48    | 4,132,448.00  |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES  | 193,900 | 9.78     | 1,896,342.00  |

|               |                              |            |        |                                    |  |
|---------------|------------------------------|------------|--------|------------------------------------|--|
|               | ALTAGAS LTD                  | 94,600     | 24.65  | 2,331,890.00                       |  |
|               | BROOKFIELD RENEWABLE COR-A   | 39,350     | 41.66  | 1,639,321.00                       |  |
|               | CANADIAN UTILITIES LTD-A     | 38,000     | 37.67  | 1,431,460.00                       |  |
|               | EMERA INC                    | 89,100     | 54.31  | 4,839,021.00                       |  |
|               | FORTIS INC                   | 152,100    | 55.47  | 8,436,987.00                       |  |
|               | HYDRO ONE LTD                | 95,400     | 37.35  | 3,563,190.00                       |  |
|               | NORTHLAND POWER INC          | 79,600     | 36.45  | 2,901,420.00                       |  |
|               | カナダドル 小計                     | 12,725,371 |        | 771,009,360.72<br>(74,410,113,403) |  |
| オーストラリア<br>ドル | AMPOL LTD                    | 82,331     | 30.61  | 2,520,151.91                       |  |
|               | SANTOS LTD                   | 979,535    | 7.24   | 7,091,833.40                       |  |
|               | WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 64,847     | 28.14  | 1,824,794.58                       |  |
|               | WOODSIDE ENERGY GROUP LTD    | 594,778    | 37.31  | 22,191,167.18                      |  |
|               | BHP GROUP LTD                | 1,585,506  | 49.24  | 78,070,315.44                      |  |
|               | BLUESCOPE STEEL LTD          | 157,082    | 18.90  | 2,968,849.80                       |  |
|               | FORTESCUE METALS GROUP LTD   | 534,912    | 22.48  | 12,024,821.76                      |  |
|               | IGO LTD                      | 196,762    | 15.89  | 3,126,548.18                       |  |
|               | JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI  | 129,210    | 31.44  | 4,062,362.40                       |  |
|               | MINERAL RESOURCES LTD        | 53,520     | 94.20  | 5,041,584.00                       |  |
|               | NEWCREST MINING LTD          | 261,737    | 22.95  | 6,006,864.15                       |  |
|               | NORTHERN STAR RESOURCES LTD  | 369,774    | 12.70  | 4,696,129.80                       |  |
|               | ORICA LTD                    | 158,310    | 14.95  | 2,366,734.50                       |  |
|               | PILBARA MINERALS LTD         | 735,369    | 5.11   | 3,757,735.59                       |  |
|               | RIO TINTO LTD                | 117,797    | 126.50 | 14,901,320.50                      |  |
|               | SOUTH32 LTD                  | 1,389,438  | 4.76   | 6,613,724.88                       |  |
|               | REECE LTD                    | 53,600     | 15.70  | 841,520.00                         |  |
|               | BRAMBLES LTD                 | 460,976    | 11.72  | 5,402,638.72                       |  |
|               | AURIZON HOLDINGS LTD         | 607,049    | 3.70   | 2,246,081.30                       |  |
|               | QANTAS AIRWAYS LTD           | 240,658    | 6.47   | 1,557,057.26                       |  |
|               | TRANSURBAN GROUP             | 963,395    | 13.71  | 13,208,145.45                      |  |
|               | ARISTOCRAT LEISURE LTD       | 180,742    | 34.20  | 6,181,376.40                       |  |
|               | IDP EDUCATION LTD            | 66,233     | 30.53  | 2,022,093.49                       |  |
|               | LOTTERY CORP LTD/THE         | 673,112    | 4.77   | 3,210,744.24                       |  |
|               | REA GROUP LTD                | 16,523     | 122.88 | 2,030,346.24                       |  |
|               | SEEK LTD                     | 111,070    | 23.67  | 2,629,026.90                       |  |
|               | WESFARMERS LTD               | 358,795    | 49.34  | 17,702,945.30                      |  |
|               | COLES GROUP LTD              | 423,676    | 17.30  | 7,329,594.80                       |  |
|               | ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI | 449,953    | 6.47   | 2,911,195.91                       |  |
|               | WOOLWORTHS GROUP LTD         | 380,600    | 34.74  | 13,222,044.00                      |  |
|               | TREASURY WINE ESTATES LTD    | 206,438    | 14.09  | 2,908,711.42                       |  |
|               | COCHLEAR LTD                 | 20,154     | 206.02 | 4,152,127.08                       |  |
|               | RAMSAY HEALTH CARE LTD       | 55,070     | 67.30  | 3,706,211.00                       |  |

|         |                              |            |        |                                    |  |
|---------|------------------------------|------------|--------|------------------------------------|--|
|         | SONIC HEALTHCARE LTD         | 142,034    | 31.70  | 4,502,477.80                       |  |
|         | CSL LTD                      | 150,594    | 296.12 | 44,593,895.28                      |  |
|         | ANZ GROUP HOLDINGS LTD       | 938,863    | 24.60  | 23,096,029.80                      |  |
|         | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 532,550    | 108.83 | 57,957,416.50                      |  |
|         | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD  | 993,015    | 31.48  | 31,260,112.20                      |  |
|         | WESTPAC BANKING CORP         | 1,096,495  | 23.67  | 25,954,036.65                      |  |
|         | ASX LTD                      | 59,402     | 68.57  | 4,073,195.14                       |  |
|         | MACQUARIE GROUP LTD          | 115,292    | 185.13 | 21,344,007.96                      |  |
|         | INSURANCE AUSTRALIA GROUP    | 762,528    | 5.04   | 3,843,141.12                       |  |
|         | MEDIBANK PRIVATE LTD         | 936,375    | 2.90   | 2,715,487.50                       |  |
|         | QBE INSURANCE GROUP LTD      | 445,102    | 13.73  | 6,111,250.46                       |  |
|         | SUNCORP GROUP LTD            | 404,738    | 12.71  | 5,144,219.98                       |  |
|         | LENDLEASE GROUP              | 244,789    | 8.42   | 2,061,123.38                       |  |
|         | COMPUTERSHARE LTD            | 169,145    | 23.82  | 4,029,033.90                       |  |
|         | WISETECH GLOBAL LTD          | 43,885     | 56.10  | 2,461,948.50                       |  |
|         | XERO LTD                     | 42,700     | 74.17  | 3,167,059.00                       |  |
|         | TELSTRA GROUP LTD            | 1,175,261  | 4.08   | 4,795,064.88                       |  |
|         | APA GROUP                    | 397,094    | 10.78  | 4,280,673.32                       |  |
|         | ORIGIN ENERGY LTD            | 540,177    | 7.32   | 3,954,095.64                       |  |
|         | オーストラリアドル 小計                 | 21,868,991 |        | 523,871,066.59<br>(48,128,034,887) |  |
| イギリスポンド | BP PLC                       | 5,890,625  | 4.74   | 27,962,796.87                      |  |
|         | SHELL PLC                    | 2,272,097  | 23.32  | 52,985,302.04                      |  |
|         | ANGLO AMERICAN PLC           | 397,883    | 35.96  | 14,309,862.09                      |  |
|         | ANTOFAGASTA PLC              | 124,065    | 17.86  | 2,215,800.90                       |  |
|         | CRODA INTERNATIONAL PLC      | 45,330     | 68.32  | 3,096,945.60                       |  |
|         | GLENCORE PLC                 | 3,056,730  | 5.58   | 17,071,837.05                      |  |
|         | JOHNSON MATTHEY PLC          | 58,854     | 21.38  | 1,258,298.52                       |  |
|         | MONDI PLC                    | 141,279    | 15.08  | 2,130,487.32                       |  |
|         | RIO TINTO PLC                | 352,284    | 63.36  | 22,320,714.24                      |  |
|         | ASHTAD GROUP PLC             | 135,004    | 50.52  | 6,820,402.08                       |  |
|         | BAE SYSTEMS PLC              | 1,000,726  | 8.45   | 8,456,134.70                       |  |
|         | BUNZL PLC                    | 102,308    | 29.23  | 2,990,462.84                       |  |
|         | DCC PLC                      | 30,399     | 45.33  | 1,377,986.67                       |  |
|         | MELROSE INDUSTRIES PLC       | 1,211,674  | 1.42   | 1,721,182.91                       |  |
|         | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC     | 2,661,015  | 1.11   | 2,972,885.95                       |  |
|         | SMITHS GROUP PLC             | 113,243    | 17.38  | 1,968,729.55                       |  |
|         | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 22,203     | 113.10 | 2,511,159.30                       |  |
|         | EXPERIAN PLC                 | 292,420    | 28.52  | 8,339,818.40                       |  |
|         | INTERTEK GROUP PLC           | 47,531     | 42.58  | 2,023,869.98                       |  |
|         | RELX PLC                     | 601,028    | 23.53  | 14,142,188.84                      |  |
|         | RENTOKIL INITIAL PLC         | 814,870    | 5.03   | 4,098,796.10                       |  |

|                              |            |        |               |
|------------------------------|------------|--------|---------------|
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     | 290,184    | 4.57   | 1,327,301.61  |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE  | 32,323     | 41.75  | 1,349,485.25  |
| BURBERRY GROUP PLC           | 126,278    | 23.78  | 3,002,890.84  |
| PERSIMMON PLC                | 103,740    | 14.05  | 1,458,065.70  |
| TAYLOR WIMPEY PLC            | 1,180,533  | 1.16   | 1,369,418.28  |
| COMPASS GROUP PLC            | 552,832    | 19.11  | 10,567,383.68 |
| ENTAIN PLC                   | 169,917    | 15.31  | 2,602,278.85  |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 57,197     | 56.30  | 3,220,191.10  |
| PEARSON PLC                  | 194,698    | 9.25   | 1,802,124.68  |
| WHITBREAD PLC                | 65,187     | 30.68  | 1,999,937.16  |
| AUTO TRADER GROUP PLC        | 265,668    | 5.88   | 1,563,721.84  |
| INFORMA PLC                  | 468,909    | 6.62   | 3,105,115.39  |
| WPP PLC                      | 321,777    | 9.29   | 2,991,238.99  |
| JD SPORTS FASHION PLC        | 728,558    | 1.60   | 1,170,428.42  |
| KINGFISHER PLC               | 567,509    | 2.63   | 1,492,548.67  |
| NEXT PLC                     | 41,419     | 64.70  | 2,679,809.30  |
| OCADO GROUP PLC              | 164,438    | 6.97   | 1,146,132.86  |
| SAINSBURY (J) PLC            | 620,861    | 2.39   | 1,483,857.79  |
| TESCO PLC                    | 2,341,521  | 2.44   | 5,727,360.36  |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 119,280    | 18.35  | 2,188,788.00  |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 669,161    | 30.62  | 20,489,709.82 |
| COCA-COLA HBC AG-DI          | 61,536     | 19.28  | 1,186,414.08  |
| DIAGEO PLC                   | 712,358    | 36.75  | 26,179,156.50 |
| IMPERIAL BRANDS PLC          | 279,066    | 20.26  | 5,653,877.16  |
| HALEON PLC                   | 1,597,387  | 3.14   | 5,016,593.87  |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 224,553    | 56.64  | 12,718,681.92 |
| UNILEVER PLC                 | 797,242    | 40.60  | 32,372,011.41 |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 282,738    | 11.32  | 3,200,594.16  |
| ASTRAZENECA PLC              | 484,630    | 108.10 | 52,388,503.00 |
| GSK PLC                      | 1,273,814  | 14.03  | 17,879,253.30 |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC    | 54,192     | 16.38  | 887,935.92    |
| BARCLAYS PLC                 | 5,102,640  | 1.81   | 9,272,517.40  |
| HSBC HOLDINGS PLC            | 6,249,780  | 5.98   | 37,404,933.30 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 21,381,710 | 0.50   | 10,893,981.24 |
| NATWEST GROUP PLC            | 1,665,358  | 3.02   | 5,029,381.16  |
| STANDARD CHARTERED PLC       | 758,385    | 7.02   | 5,323,862.70  |
| 3I GROUP PLC                 | 319,724    | 14.60  | 4,667,970.40  |
| ABRDN PLC                    | 590,816    | 2.05   | 1,211,763.61  |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC      | 123,322    | 8.53   | 1,052,923.23  |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  | 100,521    | 72.96  | 7,334,012.16  |
| M&G PLC                      | 725,660    | 2.06   | 1,498,487.90  |
| SCHRODERS PLC                | 246,806    | 4.78   | 1,180,719.90  |

|        |                              |            |            |                                    |  |
|--------|------------------------------|------------|------------|------------------------------------|--|
|        | ST JAMES'S PLACE PLC         | 165,599    | 11.99      | 1,986,360.00                       |  |
|        | ADMIRAL GROUP PLC            | 63,019     | 21.39      | 1,347,976.41                       |  |
|        | AVIVA PLC                    | 840,084    | 4.55       | 3,828,262.78                       |  |
|        | LEGAL & GENERAL GROUP PLC    | 1,879,875  | 2.58       | 4,865,116.50                       |  |
|        | PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC   | 222,425    | 6.35       | 1,413,288.45                       |  |
|        | PRUDENTIAL PLC               | 863,225    | 13.34      | 11,515,421.50                      |  |
|        | SAGE GROUP PLC/THE           | 304,183    | 7.59       | 2,309,357.33                       |  |
|        | HALMA PLC                    | 121,077    | 20.93      | 2,534,141.61                       |  |
|        | BT GROUP PLC                 | 2,143,878  | 1.29       | 2,766,674.55                       |  |
|        | VODAFONE GROUP PLC           | 8,474,128  | 0.92       | 7,824,162.38                       |  |
|        | NATIONAL GRID PLC            | 1,148,865  | 10.36      | 11,907,985.72                      |  |
|        | SEVERN TRENT PLC             | 83,766     | 28.33      | 2,373,090.78                       |  |
|        | SSE PLC                      | 329,177    | 17.41      | 5,732,617.45                       |  |
|        | UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 204,910    | 10.78      | 2,208,929.80                       |  |
|        | イギリスポンド 小計                   | 88,330,007 |            | 578,480,410.12<br>(92,788,257,783) |  |
| スイスフラン | CLARIANT AG-REG              | 60,430     | 15.64      | 945,125.20                         |  |
|        | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    | 2,396      | 670.50     | 1,606,518.00                       |  |
|        | GIVAUDAN-REG                 | 2,911      | 2,933.00   | 8,537,963.00                       |  |
|        | HOLCIM LTD                   | 173,536    | 53.10      | 9,214,761.60                       |  |
|        | SIG GROUP AG                 | 103,650    | 22.44      | 2,325,906.00                       |  |
|        | SIKA AG-REG                  | 46,065     | 257.60     | 11,866,344.00                      |  |
|        | ABB LTD-REG                  | 488,644    | 31.41      | 15,348,308.04                      |  |
|        | GEBERIT AG-REG               | 11,028     | 505.40     | 5,573,551.20                       |  |
|        | SCHINDLER HOLDING AG-REG     | 7,216      | 185.40     | 1,337,846.40                       |  |
|        | SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 12,662     | 196.30     | 2,485,550.60                       |  |
|        | VAT GROUP AG                 | 8,759      | 288.20     | 2,524,343.80                       |  |
|        | ADECCO GROUP AG-REG          | 43,353     | 33.64      | 1,458,394.92                       |  |
|        | SGS SA-REG                   | 2,020      | 2,318.00   | 4,682,360.00                       |  |
|        | KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG   | 17,625     | 217.60     | 3,835,200.00                       |  |
|        | CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 163,003    | 139.00     | 22,657,417.00                      |  |
|        | SWATCH GROUP AG/THE-BR       | 9,553      | 322.20     | 3,077,976.60                       |  |
|        | SWATCH GROUP AG/THE-REG      | 11,657     | 58.80      | 685,431.60                         |  |
|        | BARRY CALLEBAUT AG-REG       | 1,062      | 1,904.00   | 2,022,048.00                       |  |
|        | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   | 350        | 10,080.00  | 3,528,000.00                       |  |
|        | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG  | 33         | 101,300.00 | 3,342,900.00                       |  |
|        | NESTLE SA-REG                | 859,270    | 112.70     | 96,839,729.00                      |  |
|        | ALCON INC                    | 158,200    | 67.92      | 10,744,944.00                      |  |
|        | SONOVA HOLDING AG-REG        | 17,404     | 227.20     | 3,954,188.80                       |  |
|        | STRAUMANN HOLDING AG-REG     | 33,827     | 119.90     | 4,055,857.30                       |  |
|        | BACHEM HOLDING AG            | 12,632     | 81.80      | 1,033,297.60                       |  |
|        | LONZA GROUP AG-REG           | 23,486     | 522.00     | 12,259,692.00                      |  |

|      |                              |           |        |                                    |  |
|------|------------------------------|-----------|--------|------------------------------------|--|
|      | NOVARTIS AG-REG              | 675,789   | 85.30  | 57,644,801.70                      |  |
|      | ROCHE HOLDING AG-BR          | 8,133     | 342.80 | 2,787,992.40                       |  |
|      | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 219,746   | 293.60 | 64,517,425.60                      |  |
|      | BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | 9,251     | 88.50  | 818,713.50                         |  |
|      | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   | 1,077,527 | 3.09   | 3,333,868.53                       |  |
|      | JULIUS BAER GROUP LTD        | 66,539    | 58.30  | 3,879,223.70                       |  |
|      | PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 7,088     | 865.00 | 6,131,120.00                       |  |
|      | UBS GROUP AG-REG             | 1,044,390 | 19.52  | 20,386,492.80                      |  |
|      | BALOISE HOLDING AG - REG     | 13,536    | 151.10 | 2,045,289.60                       |  |
|      | SWISS LIFE HOLDING AG-REG    | 9,590     | 548.60 | 5,261,074.00                       |  |
|      | SWISS RE AG                  | 93,903    | 95.64  | 8,980,882.92                       |  |
|      | ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 46,870    | 453.90 | 21,274,293.00                      |  |
|      | SWISS PRIME SITE-REG         | 22,533    | 83.35  | 1,878,125.55                       |  |
|      | TEMENOS AG - REG             | 22,921    | 62.26  | 1,427,061.46                       |  |
|      | LOGITECH INTERNATIONAL-REG   | 55,125    | 52.60  | 2,899,575.00                       |  |
|      | SWISSCOM AG-REG              | 8,185     | 539.00 | 4,411,715.00                       |  |
|      | BKW AG                       | 6,450     | 132.70 | 855,915.00                         |  |
|      | スイスフラン 小計                    | 5,658,348 |        | 444,477,224.42<br>(62,622,396,148) |  |
| 香港ドル | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    | 805,868   | 49.70  | 40,051,639.60                      |  |
|      | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 418,500   | 96.25  | 40,280,625.00                      |  |
|      | XINYI GLASS HOLDINGS LTD     | 656,000   | 16.90  | 11,086,400.00                      |  |
|      | MTR CORP                     | 448,500   | 42.45  | 19,038,825.00                      |  |
|      | SITC INTERNATIONAL HOLDINGS  | 352,000   | 16.48  | 5,800,960.00                       |  |
|      | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 691,000   | 54.90  | 37,935,900.00                      |  |
|      | SANDS CHINA LTD              | 775,600   | 30.00  | 23,268,000.00                      |  |
|      | BUDWEISER BREWING CO APAC LT | 562,000   | 25.00  | 14,050,000.00                      |  |
|      | WH GROUP LTD                 | 2,846,000 | 4.76   | 13,546,960.00                      |  |
|      | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD   | 1,166,000 | 27.20  | 31,715,200.00                      |  |
|      | HANG SENG BANK LTD           | 249,300   | 128.20 | 31,960,260.00                      |  |
|      | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR  | 375,600   | 368.40 | 138,371,040.00                     |  |
|      | AIA GROUP LTD                | 3,724,200 | 87.60  | 326,239,920.00                     |  |
|      | CK ASSET HOLDINGS LTD        | 652,868   | 49.75  | 32,480,183.00                      |  |
|      | ESR GROUP LTD                | 632,800   | 17.54  | 11,099,312.00                      |  |
|      | HANG LUNG PROPERTIES LTD     | 724,000   | 15.00  | 10,860,000.00                      |  |
|      | HENDERSON LAND DEVELOPMENT   | 415,641   | 29.65  | 12,323,755.65                      |  |
|      | NEW WORLD DEVELOPMENT        | 552,250   | 23.65  | 13,060,712.50                      |  |
|      | SINO LAND CO                 | 913,400   | 10.38  | 9,481,092.00                       |  |
|      | SUN HUNG KAI PROPERTIES      | 441,500   | 111.60 | 49,271,400.00                      |  |
|      | SWIRE PACIFIC LTD - CL A     | 145,000   | 72.20  | 10,469,000.00                      |  |
|      | SWIRE PROPERTIES LTD         | 305,600   | 22.25  | 6,799,600.00                       |  |
|      | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 534,000   | 46.40  | 24,777,600.00                      |  |

|            |                              |            |        |                                      |  |
|------------|------------------------------|------------|--------|--------------------------------------|--|
|            | HKT TRUST AND HKT LTD-SS     | 1,165,000  | 10.10  | 11,766,500.00                        |  |
|            | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 160,500    | 44.00  | 7,062,000.00                         |  |
|            | CLP HOLDINGS LTD             | 481,000    | 58.00  | 27,898,000.00                        |  |
|            | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS  | 982,500    | 5.30   | 5,207,250.00                         |  |
|            | HONG KONG & CHINA GAS        | 3,603,348  | 7.68   | 27,673,712.64                        |  |
|            | POWER ASSETS HOLDINGS LTD    | 421,500    | 43.95  | 18,524,925.00                        |  |
|            | 香港ドル 小計                      | 25,201,475 |        | 1,012,100,772.39<br>(16,709,783,752) |  |
| シンガポールドル   | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 30,200     | 28.95  | 874,290.00                           |  |
|            | KEPPEL CORP LTD              | 477,500    | 7.47   | 3,566,925.00                         |  |
|            | SINGAPORE TECH ENGINEERING   | 529,600    | 3.61   | 1,911,856.00                         |  |
|            | SINGAPORE AIRLINES LTD       | 378,640    | 5.98   | 2,264,267.20                         |  |
|            | GENTING SINGAPORE LTD        | 1,914,500  | 1.01   | 1,933,645.00                         |  |
|            | WILMAR INTERNATIONAL LTD     | 670,600    | 4.11   | 2,756,166.00                         |  |
|            | DBS GROUP HOLDINGS LTD       | 565,900    | 35.51  | 20,095,109.00                        |  |
|            | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 1,080,900  | 12.85  | 13,889,565.00                        |  |
|            | UNITED OVERSEAS BANK LTD     | 368,300    | 29.91  | 11,015,853.00                        |  |
|            | SINGAPORE EXCHANGE LTD       | 236,500    | 9.26   | 2,189,990.00                         |  |
|            | CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI | 802,000    | 4.00   | 3,208,000.00                         |  |
|            | CITY DEVELOPMENTS LTD        | 118,100    | 8.10   | 956,610.00                           |  |
|            | UOL GROUP LTD                | 194,000    | 6.93   | 1,344,420.00                         |  |
|            | VENTURE CORP LTD             | 76,900     | 18.48  | 1,421,112.00                         |  |
|            | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 2,616,560  | 2.49   | 6,515,234.40                         |  |
|            | シンガポールドル 小計                  | 10,060,200 |        | 73,943,042.60<br>(7,281,171,404)     |  |
| ニュージーランドドル | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    | 357,185    | 8.40   | 3,000,354.00                         |  |
|            | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 175,116    | 25.25  | 4,421,679.00                         |  |
|            | SPARK NEW ZEALAND LTD        | 630,447    | 5.22   | 3,290,933.34                         |  |
|            | MERCURY NZ LTD               | 216,705    | 5.93   | 1,285,060.65                         |  |
|            | MERIDIAN ENERGY LTD          | 445,023    | 5.35   | 2,380,873.05                         |  |
|            | ニュージーランドドル 小計                | 1,824,476  |        | 14,378,900.04<br>(1,204,664,245)     |  |
| スウェーデンクローネ | BOLIDEN AB                   | 89,974     | 466.40 | 41,963,873.60                        |  |
|            | HOLMEN AB-B SHARES           | 33,017     | 429.10 | 14,167,594.70                        |  |
|            | SVENSKA CELLULOSE AB SCA-B   | 189,562    | 145.00 | 27,486,490.00                        |  |
|            | ALFA LAVAL AB                | 92,471     | 323.60 | 29,923,615.60                        |  |
|            | ASSA ABLOY AB-B              | 314,779    | 243.60 | 76,680,164.40                        |  |
|            | ATLAS COPCO AB-A SHS         | 845,763    | 132.42 | 111,995,936.46                       |  |
|            | ATLAS COPCO AB-B SHS         | 483,052    | 118.12 | 57,058,102.24                        |  |
|            | EPIROC AB-A                  | 209,247    | 213.50 | 44,674,234.50                        |  |
|            | EPIROC AB-B                  | 107,310    | 182.35 | 19,567,978.50                        |  |
|            | HUSQVARNA AB-B SHS           | 159,232    | 79.32  | 12,630,282.24                        |  |

|               |                              |            |          |                                      |  |
|---------------|------------------------------|------------|----------|--------------------------------------|--|
|               | INDUTRADE AB                 | 83,800     | 233.10   | 19,533,780.00                        |  |
|               | INVESTMENT AB LATOUR-B SHS   | 58,459     | 216.70   | 12,668,065.30                        |  |
|               | LIFCO AB-B SHS               | 71,700     | 188.90   | 13,544,130.00                        |  |
|               | NIBE INDUSTRIER AB-B SHS     | 495,296    | 112.65   | 55,795,094.40                        |  |
|               | SANDVIK AB                   | 327,600    | 216.40   | 70,892,640.00                        |  |
|               | SKANSKA AB-B SHS             | 104,733    | 184.40   | 19,312,765.20                        |  |
|               | SKF AB-B SHARES              | 113,171    | 183.25   | 20,738,585.75                        |  |
|               | VOLVO AB-A SHS               | 62,474     | 217.40   | 13,581,847.60                        |  |
|               | VOLVO AB-B SHS               | 472,668    | 206.25   | 97,487,775.00                        |  |
|               | SECURITAS AB-B SHS           | 156,813    | 96.46    | 15,126,181.98                        |  |
|               | VOLVO CAR AB-B               | 142,600    | 48.99    | 6,986,687.00                         |  |
|               | ELECTROLUX AB-B              | 84,165     | 150.86   | 12,697,131.90                        |  |
|               | EVOLUTION AB                 | 56,065     | 1,177.60 | 66,022,144.00                        |  |
|               | EMBRACER GROUP AB            | 170,300    | 44.73    | 7,618,370.50                         |  |
|               | HENNES & MAURITZ AB-B SHS    | 218,689    | 127.66   | 27,917,837.74                        |  |
|               | ESSITY AKTIEBOLAG-B          | 194,331    | 279.60   | 54,334,947.60                        |  |
|               | GETINGE AB-B SHS             | 64,924     | 231.20   | 15,010,428.80                        |  |
|               | SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB  | 60,727     | 228.80   | 13,894,337.60                        |  |
|               | NORDEA BANK ABP              | 1,053,594  | 119.62   | 126,030,914.28                       |  |
|               | SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 492,784    | 126.25   | 62,213,980.00                        |  |
|               | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 455,890    | 107.95   | 49,213,325.50                        |  |
|               | SWEDBANK AB - A SHARES       | 273,927    | 193.25   | 52,936,392.75                        |  |
|               | EQT AB                       | 87,471     | 232.10   | 20,302,019.10                        |  |
|               | INDUSTRIVARDEN AB-A SHS      | 33,271     | 277.50   | 9,232,702.50                         |  |
|               | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS      | 53,600     | 276.60   | 14,825,760.00                        |  |
|               | INVESTOR AB-A SHS            | 153,400    | 205.10   | 31,462,340.00                        |  |
|               | INVESTOR AB-B SHS            | 572,876    | 202.75   | 116,150,609.00                       |  |
|               | KINNEVIK AB - B              | 80,928     | 161.75   | 13,090,104.00                        |  |
|               | LUNDBERGS AB-B SHS           | 24,225     | 479.60   | 11,618,310.00                        |  |
|               | FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS  | 147,348    | 57.03    | 8,403,256.44                         |  |
|               | SAGAX AB-B                   | 64,700     | 265.80   | 17,197,260.00                        |  |
|               | ERICSSON LM-B SHS            | 878,419    | 59.14    | 51,949,699.66                        |  |
|               | HEXAGON AB-B SHS             | 628,643    | 114.00   | 71,665,302.00                        |  |
|               | TELE2 AB-B SHS               | 156,738    | 92.54    | 14,504,534.52                        |  |
|               | TELIA CO AB                  | 756,548    | 27.50    | 20,805,070.00                        |  |
|               | スウェーデンクローネ 小計                | 11,377,284 |          | 1,670,912,602.36<br>(21,170,462,671) |  |
| ノルウェーク<br>ローネ | AKER BP ASA                  | 103,871    | 290.80   | 30,205,686.80                        |  |
|               | EQUINOR ASA                  | 299,488    | 294.30   | 88,139,318.40                        |  |
|               | NORSK HYDRO ASA              | 434,804    | 81.22    | 35,314,780.88                        |  |
|               | YARA INTERNATIONAL ASA       | 49,574     | 440.20   | 21,822,474.80                        |  |
|               | KONGSBERG GRUPPEN ASA        | 32,500     | 398.00   | 12,935,000.00                        |  |



|           |                              |           |           |                                    |  |
|-----------|------------------------------|-----------|-----------|------------------------------------|--|
|           | ADEVINTA ASA                 | 106,857   | 87.80     | 9,382,044.60                       |  |
|           | MOWI ASA                     | 135,763   | 184.00    | 24,980,392.00                      |  |
|           | ORKLA ASA                    | 202,392   | 73.72     | 14,920,338.24                      |  |
|           | SALMAR ASA                   | 25,891    | 455.00    | 11,780,405.00                      |  |
|           | DNB BANK ASA                 | 287,728   | 186.00    | 53,517,408.00                      |  |
|           | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA    | 50,151    | 180.20    | 9,037,210.20                       |  |
|           | TELENOR ASA                  | 211,605   | 103.00    | 21,795,315.00                      |  |
|           | ノルウェークローネ 小計                 | 1,940,624 |           | 333,830,373.92<br>(4,359,824,683)  |  |
| デンマーククローネ | CHR HANSEN HOLDING A/S       | 33,357    | 500.00    | 16,678,500.00                      |  |
|           | NOVOZYMES A/S-B SHARES       | 62,014    | 350.70    | 21,748,309.80                      |  |
|           | ROCKWOOL A/S-B SHS           | 3,501     | 1,860.50  | 6,513,610.50                       |  |
|           | VESTAS WIND SYSTEMS A/S      | 321,595   | 196.68    | 63,251,304.60                      |  |
|           | AP MOLLER-MAERSK A/S-A       | 1,039     | 13,900.00 | 14,442,100.00                      |  |
|           | AP MOLLER-MAERSK A/S-B       | 1,524     | 14,215.00 | 21,663,660.00                      |  |
|           | DSV A/S                      | 57,928    | 1,101.50  | 63,807,692.00                      |  |
|           | PANDORA A/S                  | 26,106    | 563.00    | 14,697,678.00                      |  |
|           | CARLSBERG AS-B               | 31,440    | 976.20    | 30,691,728.00                      |  |
|           | COLOPLAST-B                  | 36,267    | 819.80    | 29,731,686.60                      |  |
|           | DEMANT A/S                   | 21,128    | 190.00    | 4,014,320.00                       |  |
|           | GENMAB A/S                   | 20,841    | 2,635.00  | 54,916,035.00                      |  |
|           | NOVO NORDISK A/S-B           | 517,205   | 948.00    | 490,310,340.00                     |  |
|           | DANSKE BANK A/S              | 221,483   | 138.75    | 30,730,766.25                      |  |
|           | TRYG A/S                     | 114,270   | 157.45    | 17,991,811.50                      |  |
|           | ORSTED A/S                   | 60,759    | 600.20    | 36,467,551.80                      |  |
|           | デンマーククローネ 小計                 | 1,530,457 |           | 917,657,094.05<br>(17,398,778,503) |  |
| イスラエルシェケル | ICL GROUP LTD                | 211,785   | 27.00     | 5,718,195.00                       |  |
|           | ELBIT SYSTEMS LTD            | 7,200     | 570.00    | 4,104,000.00                       |  |
|           | BANK HAPOLIM BM              | 386,829   | 31.74     | 12,277,952.46                      |  |
|           | BANK LEUMI LE-ISRAEL         | 443,979   | 30.60     | 13,585,757.40                      |  |
|           | ISRAEL DISCOUNT BANK-A       | 403,741   | 18.02     | 7,275,412.82                       |  |
|           | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD     | 48,267    | 117.20    | 5,656,892.40                       |  |
|           | AZRIELI GROUP LTD            | 14,806    | 227.10    | 3,362,442.60                       |  |
|           | NICE LTD                     | 19,783    | 703.90    | 13,925,253.70                      |  |
|           | BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO | 572,400   | 5.57      | 3,188,268.00                       |  |
|           | TOWER SEMICONDUCTOR LTD      | 35,700    | 144.40    | 5,155,080.00                       |  |
|           | イスラエルシェケル 小計                 | 2,144,490 |           | 74,249,254.38<br>(2,845,595,249)   |  |
| ユーロ       | ENI SPA                      | 781,185   | 14.07     | 10,995,960.06                      |  |
|           | GALP ENERGIA SGPS SA         | 151,355   | 12.62     | 1,910,100.10                       |  |
|           | NESTE OYJ                    | 134,607   | 45.44     | 6,116,542.08                       |  |

|                                  |         |        |               |
|----------------------------------|---------|--------|---------------|
| OMV AG                           | 44,483  | 44.40  | 1,975,045.20  |
| REPSOL SA                        | 426,893 | 15.03  | 6,418,336.25  |
| TENARIS SA                       | 134,483 | 16.07  | 2,161,141.81  |
| TOTALENERGIES SE                 | 777,988 | 58.39  | 45,426,719.32 |
| AIR LIQUIDE SA                   | 163,278 | 146.14 | 23,861,446.92 |
| AKZO NOBEL N.V.                  | 58,755  | 68.72  | 4,037,643.60  |
| ARCELORMITTAL                    | 157,243 | 28.69  | 4,511,301.67  |
| ARKEMA                           | 19,014  | 92.18  | 1,752,710.52  |
| BASF SE                          | 286,508 | 52.87  | 15,147,677.96 |
| COVESTRO AG                      | 56,071  | 42.15  | 2,363,392.65  |
| CRH PLC                          | 239,258 | 41.71  | 9,980,647.47  |
| EVONIK INDUSTRIES AG             | 76,974  | 20.20  | 1,554,874.80  |
| HEIDELBERGCEMENT AG              | 47,261  | 59.00  | 2,788,399.00  |
| KONINKLIJKE DSM NV               | 53,334  | 117.80 | 6,282,745.20  |
| OCI NV                           | 34,955  | 30.60  | 1,069,623.00  |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC          | 72,855  | 39.06  | 2,845,716.30  |
| SOLVAY SA                        | 24,153  | 104.20 | 2,516,742.60  |
| STORA ENSO OYJ-R SHS             | 184,408 | 13.85  | 2,554,050.80  |
| SYMRISE AG                       | 42,629  | 98.12  | 4,182,757.48  |
| UMICORE                          | 62,556  | 34.75  | 2,173,821.00  |
| UPM-KYMMENE OYJ                  | 160,063 | 33.52  | 5,365,311.76  |
| VOESTALPINE AG                   | 39,061  | 29.84  | 1,165,580.24  |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV      | 64,621  | 26.96  | 1,742,182.16  |
| ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCC-RTS | 64,621  | 0.46   | 29,951.83     |
| AIRBUS SE                        | 185,095 | 120.14 | 22,237,313.30 |
| ALSTOM                           | 96,250  | 26.45  | 2,545,812.50  |
| BOUYGUES SA                      | 69,916  | 30.05  | 2,100,975.80  |
| BRENTAG SE                       | 49,586  | 68.60  | 3,401,599.60  |
| CNH INDUSTRIAL NV                | 324,390 | 15.80  | 5,126,983.95  |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN        | 153,561 | 52.98  | 8,135,661.78  |
| DAIMLER TRUCK HOLDING AG         | 136,111 | 31.37  | 4,269,802.07  |
| DASSAULT AVIATION SA             | 6,763   | 156.30 | 1,057,056.90  |
| EIFFAGE                          | 24,432  | 97.88  | 2,391,404.16  |
| FERROVIAL SA                     | 157,922 | 27.06  | 4,273,369.32  |
| GEA GROUP AG                     | 42,462  | 40.95  | 1,738,818.90  |
| IMCD NV                          | 18,078  | 144.10 | 2,605,039.80  |
| KINGSPAN GROUP PLC               | 46,132  | 58.92  | 2,718,097.44  |
| KNORR-BREMSE AG                  | 25,881  | 61.26  | 1,585,470.06  |
| KONE OYJ-B                       | 105,985 | 50.76  | 5,379,798.60  |
| LEGRAND SA                       | 80,593  | 82.30  | 6,632,803.90  |
| MTU AERO ENGINES AG              | 16,223  | 225.00 | 3,650,175.00  |
| PRYSMIAN SPA                     | 81,681  | 37.28  | 3,045,067.68  |

|                              |         |          |               |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| RATIONAL AG                  | 1,276   | 633.50   | 808,346.00    |
| RHEINMETALL AG               | 12,710  | 220.90   | 2,807,639.00  |
| SAFRAN SA                    | 106,909 | 130.30   | 13,930,242.70 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE        | 169,526 | 145.90   | 24,733,843.40 |
| SIEMENS AG-REG               | 239,011 | 142.82   | 34,135,551.02 |
| SIEMENS ENERGY AG            | 137,504 | 18.78    | 2,582,325.12  |
| THALES SA                    | 33,295  | 121.20   | 4,035,354.00  |
| VINCI SA                     | 167,477 | 103.68   | 17,364,015.36 |
| WARTSILA OYJ ABP             | 161,062 | 8.69     | 1,400,595.15  |
| BUREAU VERITAS SA            | 94,880  | 26.20    | 2,485,856.00  |
| RANDSTAD NV                  | 34,242  | 58.54    | 2,004,526.68  |
| TELEPERFORMANCE              | 18,129  | 249.00   | 4,514,121.00  |
| WOLTERS KLUWER               | 82,203  | 97.98    | 8,054,249.94  |
| ADP                          | 10,260  | 146.30   | 1,501,038.00  |
| AENA SME SA                  | 24,220  | 141.30   | 3,422,286.00  |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       | 179,416 | 9.62     | 1,726,879.00  |
| DEUTSCHE POST AG-REG         | 310,641 | 39.54    | 12,282,745.14 |
| GETLINK SE                   | 132,190 | 15.87    | 2,097,855.30  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG  | 105,547 | 91.79    | 9,688,159.13  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 18,227  | 85.70    | 1,562,053.90  |
| CONTINENTAL AG               | 34,400  | 63.56    | 2,186,464.00  |
| DR ING HC F PORSCHE AG       | 34,570  | 104.10   | 3,598,737.00  |
| FERRARI NV                   | 39,489  | 224.60   | 8,869,229.40  |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG       | 251,461 | 67.60    | 16,998,763.60 |
| MICHELIN (CGDE)              | 215,236 | 28.87    | 6,213,863.32  |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF   | 45,820  | 53.86    | 2,467,865.20  |
| RENAULT SA                   | 57,337  | 37.26    | 2,136,663.30  |
| STELLANTIS NV                | 704,483 | 13.91    | 9,803,585.42  |
| VALEO                        | 72,083  | 18.95    | 1,365,972.85  |
| VOLKSWAGEN AG                | 8,950   | 158.20   | 1,415,890.00  |
| VOLKSWAGEN AG-PREF           | 59,893  | 124.10   | 7,432,721.30  |
| ADIDAS AG                    | 55,623  | 145.50   | 8,093,146.50  |
| HERMES INTERNATIONAL         | 9,913   | 1,658.00 | 16,435,754.00 |
| KERING                       | 23,404  | 534.20   | 12,502,416.80 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 86,553  | 792.30   | 68,575,941.90 |
| MONCLER SPA                  | 63,271  | 56.28    | 3,560,891.88  |
| PUMA SE                      | 32,556  | 61.22    | 1,993,078.32  |
| SEB SA                       | 9,694   | 90.55    | 877,791.70    |
| ACCOR SA                     | 57,043  | 29.46    | 1,680,486.78  |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI | 52,758  | 145.35   | 7,668,375.30  |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM   | 27,020  | 40.55    | 1,095,661.00  |
| SODEXO SA                    | 26,938  | 91.56    | 2,466,443.28  |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| BOLLORE SE                   | 271,925 | 5.25   | 1,428,965.87  |
| PUBLICIS GROUPE              | 70,257  | 63.50  | 4,461,319.50  |
| SCOUT24 SE                   | 27,257  | 52.28  | 1,424,995.96  |
| UBISOFT ENTERTAINMENT        | 20,939  | 19.02  | 398,259.78    |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP NV     | 228,537 | 23.20  | 5,302,058.40  |
| VIVENDI SE                   | 236,529 | 9.51   | 2,251,283.02  |
| D'IETEREN GROUP              | 8,226   | 170.90 | 1,405,823.40  |
| DELIVERY HERO SE             | 54,469  | 50.68  | 2,760,488.92  |
| INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL   | 338,760 | 27.73  | 9,393,814.80  |
| JUST EAT TAKEAWAY            | 57,881  | 22.39  | 1,295,955.59  |
| PROSUS NV                    | 258,955 | 76.10  | 19,706,475.50 |
| ZALANDO SE                   | 72,249  | 41.65  | 3,009,170.85  |
| CARREFOUR SA                 | 175,137 | 17.27  | 3,024,615.99  |
| HELLOFRESH SE                | 45,738  | 22.56  | 1,031,849.28  |
| JERONIMO MARTINS             | 95,613  | 20.06  | 1,917,996.78  |
| KESKO OYJ-B SHS              | 93,457  | 21.43  | 2,002,783.51  |
| KONINKLIJKE Ahold DELHAIZE N | 321,391 | 27.03  | 8,687,198.73  |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV   | 269,584 | 54.86  | 14,789,378.24 |
| DANONE                       | 203,761 | 49.80  | 10,147,297.80 |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV     | 156,074 | 9.95   | 1,552,936.30  |
| HEINEKEN HOLDING NV          | 30,217  | 74.80  | 2,260,231.60  |
| HEINEKEN NV                  | 80,548  | 91.32  | 7,355,643.36  |
| JDE PEET'S NV                | 24,300  | 27.84  | 676,512.00    |
| KERRY GROUP PLC-A            | 47,682  | 86.04  | 4,102,559.28  |
| PERNOD RICARD SA             | 64,425  | 193.15 | 12,443,688.75 |
| REMY COINTREAU               | 6,746   | 175.90 | 1,186,621.40  |
| BEIERSDORF AG                | 29,811  | 110.70 | 3,300,077.70  |
| HENKEL AG & CO KGAA          | 28,270  | 61.15  | 1,728,710.50  |
| HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF | 57,517  | 65.40  | 3,761,611.80  |
| L'OREAL                      | 75,549  | 381.25 | 28,803,056.25 |
| AMPLIFON SPA                 | 42,891  | 25.69  | 1,101,869.79  |
| BIOMERIEUX                   | 13,869  | 94.64  | 1,312,562.16  |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR   | 11,510  | 130.00 | 1,496,300.00  |
| DIASORIN SPA                 | 9,103   | 123.70 | 1,126,041.10  |
| ESSILORLUXOTTICA             | 90,599  | 171.25 | 15,515,078.75 |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG &  | 67,833  | 32.58  | 2,209,999.14  |
| FRESENIUS SE & CO KGAA       | 129,848 | 27.04  | 3,511,089.92  |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       | 285,870 | 15.44  | 4,416,119.76  |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG      | 83,492  | 48.63  | 4,060,215.96  |
| ARGENX SE                    | 16,640  | 349.50 | 5,815,680.00  |
| BAYER AG-REG                 | 307,118 | 55.48  | 17,038,906.64 |
| EUROFINS SCIENTIFIC          | 39,698  | 63.60  | 2,524,792.80  |

|                              |           |        |               |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| GRIFOLS SA                   | 82,564    | 12.36  | 1,020,903.86  |
| IPSEN                        | 13,860    | 99.00  | 1,372,140.00  |
| MERCK KGAA                   | 40,311    | 190.45 | 7,677,229.95  |
| ORION OYJ-CLASS B            | 34,824    | 48.57  | 1,691,401.68  |
| QIAGEN N.V.                  | 73,322    | 46.10  | 3,380,144.20  |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA  | 32,103    | 41.02  | 1,316,865.06  |
| SANOFI                       | 356,795   | 89.91  | 32,079,438.45 |
| SARTORIUS AG-VORZUG          | 7,294     | 407.50 | 2,972,305.00  |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH     | 8,551     | 305.20 | 2,609,765.20  |
| UCB SA                       | 38,461    | 75.54  | 2,905,343.94  |
| ABN AMRO BANK NV-CVA         | 133,234   | 14.79  | 1,970,530.86  |
| AIB GROUP PLC                | 297,214   | 3.78   | 1,125,252.20  |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 1,896,626 | 6.29   | 11,933,570.79 |
| BANCO SANTANDER SA           | 5,238,634 | 3.09   | 16,205,714.27 |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC    | 351,816   | 9.55   | 3,359,842.80  |
| BNP PARIBAS                  | 347,142   | 60.99  | 21,172,190.58 |
| CAIXABANK SA                 | 1,332,848 | 3.93   | 5,246,089.72  |
| COMMERZBANK AG               | 350,612   | 9.65   | 3,384,107.02  |
| CREDIT AGRICOLE SA           | 373,329   | 10.68  | 3,989,393.69  |
| ERSTE GROUP BANK AG          | 110,379   | 33.84  | 3,735,225.36  |
| FINECOBANK SPA               | 186,022   | 15.95  | 2,967,981.01  |
| ING GROEP NV                 | 1,170,060 | 12.82  | 15,004,849.44 |
| INTESA SANPAOLO              | 5,260,087 | 2.29   | 12,071,899.66 |
| KBC GROUP NV                 | 79,725    | 66.76  | 5,322,441.00  |
| MEDIOBANCA SPA               | 181,481   | 9.74   | 1,767,987.90  |
| SOCIETE GENERALE SA          | 258,996   | 24.98  | 6,471,015.06  |
| UNICREDIT SPA                | 601,152   | 15.31  | 9,203,637.12  |
| AMUNDI SA                    | 21,837    | 60.30  | 1,316,771.10  |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED  | 646,303   | 11.91  | 7,700,053.94  |
| DEUTSCHE BOERSE AG           | 60,276    | 162.50 | 9,794,850.00  |
| EURAZEO SE                   | 11,669    | 63.90  | 745,649.10    |
| EURONEXT NV                  | 28,504    | 74.02  | 2,109,866.08  |
| EXOR NV                      | 35,414    | 71.68  | 2,538,475.52  |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV  | 32,086    | 78.48  | 2,518,109.28  |
| SOFINA                       | 5,291     | 218.00 | 1,153,438.00  |
| WENDEL                       | 9,312     | 97.70  | 909,782.40    |
| AEGON NV                     | 589,592   | 5.01   | 2,957,393.47  |
| AGEAS                        | 51,936    | 44.64  | 2,318,423.04  |
| ALLIANZ SE-REG               | 127,593   | 221.70 | 28,287,368.10 |
| ASSICURAZIONI GENERALI       | 355,557   | 17.86  | 6,352,025.80  |
| AXA SA                       | 584,480   | 28.53  | 16,675,214.40 |
| HANNOVER RUECK SE            | 17,884    | 189.15 | 3,382,758.60  |

|                              |           |          |               |
|------------------------------|-----------|----------|---------------|
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG   | 43,785    | 334.10   | 14,628,568.50 |
| NN GROUP NV                  | 91,002    | 38.94    | 3,543,617.88  |
| POSTE ITALIANE SPA           | 144,825   | 9.63     | 1,395,823.35  |
| SAMPO OYJ-A SHS              | 153,542   | 48.12    | 7,388,441.04  |
| AROUNDTOWN SA                | 379,138   | 2.59     | 985,379.66    |
| LEG IMMOBILIEN SE            | 21,715    | 72.54    | 1,575,206.10  |
| VONOVIA SE                   | 216,231   | 26.50    | 5,730,121.50  |
| ADYEN NV                     | 6,905     | 1,310.20 | 9,046,931.00  |
| AMADEUS IT GROUP SA          | 138,455   | 58.52    | 8,102,386.60  |
| BECHTLE AG                   | 26,787    | 38.06    | 1,019,513.22  |
| CAPGEMINI SE                 | 51,162    | 171.85   | 8,792,189.70  |
| DASSAULT SYSTEMES SE         | 205,125   | 34.10    | 6,995,788.12  |
| EDENRED                      | 81,610    | 49.77    | 4,061,729.70  |
| NEMETSCHKE SE                | 20,683    | 47.30    | 978,305.90    |
| NEXI SPA                     | 160,933   | 8.00     | 1,287,464.00  |
| SAP SE                       | 326,568   | 105.94   | 34,596,613.92 |
| WORLDLINE SA                 | 76,356    | 40.14    | 3,064,929.84  |
| NOKIA OYJ                    | 1,704,229 | 4.21     | 7,179,064.66  |
| CELLNEX TELECOM SA           | 175,248   | 36.31    | 6,363,254.88  |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG      | 1,009,756 | 20.32    | 20,518,241.92 |
| ELISA OYJ                    | 43,016    | 51.66    | 2,222,206.56  |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL | 114,083   | 10.11    | 1,153,379.13  |
| KONINKLIJKE KPN NV           | 1,065,750 | 3.06     | 3,262,260.75  |
| ORANGE                       | 626,892   | 9.61     | 6,025,059.01  |
| TELECOM ITALIA SPA           | 3,630,827 | 0.25     | 931,307.12    |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 297,838   | 2.59     | 774,080.96    |
| TELEFONICA SA                | 1,669,173 | 3.48     | 5,812,060.38  |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 30,096    | 21.39    | 643,753.44    |
| ACCIONA SA                   | 8,326     | 186.40   | 1,551,966.40  |
| CORP ACCIONA ENERGIAS RENOV  | 19,200    | 37.48    | 719,616.00    |
| E.ON SE                      | 715,946   | 10.13    | 7,256,112.71  |
| EDF                          | 176,747   | 12.00    | 2,121,847.73  |
| EDP RENOVAVEIS SA            | 96,779    | 20.39    | 1,973,323.81  |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA  | 850,867   | 4.78     | 4,073,951.19  |
| ELIA GROUP SA/NV             | 10,658    | 134.60   | 1,434,566.80  |
| ENAGAS SA                    | 82,825    | 16.74    | 1,386,904.62  |
| ENDESA SA                    | 108,855   | 18.34    | 1,996,944.97  |
| ENEL SPA                     | 2,542,116 | 5.47     | 13,925,711.44 |
| ENGIE                        | 560,325   | 13.10    | 7,342,498.80  |
| FORTUM OYJ                   | 136,337   | 14.17    | 1,931,895.29  |
| IBERDROLA SA                 | 1,914,742 | 10.87    | 20,813,245.54 |
| NATURGY ENERGY GROUP SA      | 45,200    | 26.26    | 1,186,952.00  |

|                              |             |        |                                          |  |
|------------------------------|-------------|--------|------------------------------------------|--|
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 131,018     | 16.61  | 2,176,864.07                             |  |
| RWE AG                       | 203,358     | 42.75  | 8,693,554.50                             |  |
| SNAM SPA                     | 600,034     | 4.74   | 2,844,761.19                             |  |
| TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA | 409,767     | 7.36   | 3,018,343.72                             |  |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT         | 203,582     | 27.59  | 5,616,827.38                             |  |
| VERBUND AG                   | 22,697      | 77.95  | 1,769,231.15                             |  |
| ASM INTERNATIONAL NV         | 14,362      | 307.35 | 4,414,160.70                             |  |
| ASML HOLDING NV              | 126,914     | 617.10 | 78,318,629.40                            |  |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG     | 406,670     | 32.12  | 13,064,273.75                            |  |
| STMICROELECTRONICS NV        | 218,245     | 39.45  | 8,609,765.25                             |  |
| ユーロ 小計                       | 58,089,644  |        | 1,449,180,206.01<br>(204,464,835,265)    |  |
| 合 計                          | 347,393,419 |        | 1,955,804,252,672<br>(1,955,804,252,672) |  |

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

## (2)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 通貨         | 種 類  | 銘 柄                          | 口数      | 評価額           | 備考 |
|------------|------|------------------------------|---------|---------------|----|
| アメリカ<br>ドル | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 49,695  | 7,790,188.20  |    |
|            |      | AMERICAN HOMES 4 RENT- A     | 96,734  | 3,196,091.36  |    |
|            |      | AMERICAN TOWER CORP          | 145,565 | 31,829,242.90 |    |
|            |      | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 44,541  | 7,721,627.76  |    |
|            |      | BOSTON PROPERTIES INC        | 47,057  | 3,345,282.13  |    |
|            |      | CAMDEN PROPERTY TRUST        | 32,617  | 3,890,229.59  |    |
|            |      | CROWN CASTLE INC             | 135,416 | 19,698,965.52 |    |
|            |      | DIGITAL REALTY TRUST INC     | 88,070  | 9,440,223.30  |    |
|            |      | EQUINIX INC                  | 28,449  | 20,476,736.73 |    |
|            |      | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 57,122  | 3,883,724.78  |    |
|            |      | EQUITY RESIDENTIAL           | 115,240 | 7,161,013.60  |    |
|            |      | ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 20,085  | 4,351,214.40  |    |
|            |      | EXTRA SPACE STORAGE INC      | 42,486  | 6,446,400.78  |    |
|            |      | GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 77,391  | 4,057,610.13  |    |
|            |      | HEALTHCARE REALTY TRUST INC  | 114,571 | 2,418,593.81  |    |
|            |      | HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 171,442 | 4,642,649.36  |    |
|            |      | HOST HOTELS & RESORTS INC    | 217,220 | 3,964,265.00  |    |
|            |      | INVITATION HOMES INC         | 186,993 | 5,998,735.44  |    |
|            |      | IRON MOUNTAIN INC            | 93,347  | 4,904,451.38  |    |
|            |      | KIMCO REALTY CORP            | 187,223 | 4,135,756.07  |    |
|            |      | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 177,787 | 2,202,780.93  |    |

|             |      |                              |           |                                    |  |
|-------------|------|------------------------------|-----------|------------------------------------|--|
|             |      | MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 36,527    | 5,934,541.69                       |  |
|             |      | PROLOGIS INC                 | 288,523   | 36,264,455.87                      |  |
|             |      | PUBLIC STORAGE               | 49,436    | 14,449,648.44                      |  |
|             |      | REALTY INCOME CORP           | 193,841   | 13,047,437.71                      |  |
|             |      | REGENCY CENTERS CORP         | 47,157    | 3,109,532.58                       |  |
|             |      | SBA COMMUNICATIONS CORP      | 33,098    | 9,653,031.70                       |  |
|             |      | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 102,842   | 12,874,789.98                      |  |
|             |      | SUN COMMUNITIES INC          | 39,952    | 5,917,690.24                       |  |
|             |      | UDR INC                      | 100,713   | 4,088,947.80                       |  |
|             |      | VENTAS INC                   | 126,173   | 6,410,850.13                       |  |
|             |      | VICI PROPERTIES INC          | 294,244   | 9,924,850.12                       |  |
|             |      | WELLTOWER INC                | 141,740   | 10,468,916.40                      |  |
|             |      | WEYERHAEUSER CO              | 228,909   | 7,496,769.75                       |  |
|             |      | WP CAREY INC                 | 60,540    | 5,124,105.60                       |  |
| アメリカドル合計    |      |                              | 3,872,746 | 306,321,351.18<br>(39,598,161,067) |  |
| カナダドル       | 投資証券 | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 23,300    | 1,124,225.00                       |  |
|             |      | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 58,600    | 1,345,456.00                       |  |
| カナダドル合計     |      |                              | 81,900    | 2,469,681.00<br>(238,348,913)      |  |
| オーストラリアドル   | 投資証券 | DEXUS/AU                     | 314,109   | 2,525,436.36                       |  |
|             |      | GOODMAN GROUP                | 547,446   | 10,625,926.86                      |  |
|             |      | GPT GROUP                    | 656,296   | 3,012,398.64                       |  |
|             |      | MIRVAC GROUP                 | 1,162,900 | 2,639,783.00                       |  |
|             |      | SCENTRE GROUP                | 1,734,337 | 5,341,757.96                       |  |
|             |      | STOCKLAND                    | 680,065   | 2,645,452.85                       |  |
|             |      | VICINITY CENTRES             | 1,315,193 | 2,748,753.37                       |  |
| オーストラリアドル合計 |      |                              | 6,410,346 | 29,539,509.04<br>(2,713,794,695)   |  |
| イギリスポンド     | 投資証券 | BRITISH LAND CO PLC          | 317,051   | 1,382,659.41                       |  |
|             |      | LAND SECURITIES GROUP PLC    | 198,733   | 1,389,541.13                       |  |
|             |      | SEGRO PLC                    | 367,806   | 3,005,710.63                       |  |
| イギリスポンド合計   |      |                              | 883,590   | 5,777,911.17<br>(926,776,951)      |  |
| 香港ドル        | 投資証券 | LINK REIT                    | 659,600   | 41,917,580.00                      |  |
| 香港ドル合計      |      |                              | 659,600   | 41,917,580.00<br>(692,059,245)     |  |
| シンガポールドル    | 投資証券 | CAPITALAND ASCENDAS REIT     | 1,134,200 | 3,255,154.00                       |  |
|             |      | CAPITALAND INTEGRATED COMMER | 1,553,771 | 3,293,994.52                       |  |
|             |      | MAPLETREE LOGISTICS TRUST    | 1,029,700 | 1,740,193.00                       |  |
|             |      | MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST | 650,700   | 1,184,274.00                       |  |
|             |      |                              | 4,368,371 | 9,473,615.52                       |  |



|            |      |                           |         |                  |  |
|------------|------|---------------------------|---------|------------------|--|
| シンガポールドル合計 |      |                           |         | (932,866,920)    |  |
| ユーロ        | 投資証券 | COVIVIO                   | 13,302  | 835,365.60       |  |
|            |      | GECINA SA                 | 16,340  | 1,771,256.00     |  |
|            |      | KLEPIERRE                 | 71,486  | 1,640,603.70     |  |
|            |      | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 35,721  | 2,093,250.60     |  |
|            |      | WAREHOUSES DE PAUW SCA    | 50,808  | 1,452,092.64     |  |
| ユーロ合計      |      |                           | 187,657 | 7,792,568.54     |  |
|            |      |                           |         | (1,099,453,495)  |  |
| 合計         |      |                           |         | 46,201,461,286   |  |
|            |      |                           |         | (46,201,461,286) |  |

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

## 外貨建有価証券の内訳

| 種類         | 銘柄数       | 組入株式<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|------------|-----------|--------------|----------------|-------------------------|
| アメリカドル     | 株式 602銘柄  | 97.25%       | —              | 70.05%                  |
|            | 投資証券 35銘柄 | —            | 2.75%          | 1.98%                   |
| カナダドル      | 株式 86銘柄   | 99.68%       | —              | 3.72%                   |
|            | 投資証券 2銘柄  | —            | 0.32%          | 0.01%                   |
| オーストラリアドル  | 株式 52銘柄   | 94.66%       | —              | 2.40%                   |
|            | 投資証券 7銘柄  | —            | 5.34%          | 0.14%                   |
| イギリスポンド    | 株式 77銘柄   | 99.01%       | —              | 4.63%                   |
|            | 投資証券 3銘柄  | —            | 0.99%          | 0.05%                   |
| スイスフラン     | 株式 43銘柄   | 100.00%      | —              | 3.13%                   |
| 香港ドル       | 株式 29銘柄   | 96.02%       | —              | 0.83%                   |
|            | 投資証券 1銘柄  | —            | 3.98%          | 0.03%                   |
| シンガポールドル   | 株式 15銘柄   | 88.64%       | —              | 0.36%                   |
|            | 投資証券 4銘柄  | —            | 11.36%         | 0.05%                   |
| ニュージーランドドル | 株式 5銘柄    | 100.00%      | —              | 0.06%                   |
| スウェーデンクローネ | 株式 45銘柄   | 100.00%      | —              | 1.06%                   |
| ノルウェークローネ  | 株式 12銘柄   | 100.00%      | —              | 0.22%                   |
| デンマーククローネ  | 株式 16銘柄   | 100.00%      | —              | 0.87%                   |
| イスラエルシェケル  | 株式 10銘柄   | 100.00%      | —              | 0.14%                   |
| ユーロ        | 株式 223銘柄  | 99.47%       | —              | 10.21%                  |
|            | 投資証券 5銘柄  | —            | 0.53%          | 0.05%                   |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

## 新興国株式インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

| (単位：円)          |                 |
|-----------------|-----------------|
| [令和 5年 1月26日現在] |                 |
| <b>資産の部</b>     |                 |
| 流動資産            |                 |
| 預金              | 6,644,998,245   |
| コール・ローン         | 536,762,331     |
| 株式              | 380,653,382,197 |
| 投資証券            | 512,351,775     |
| 派生商品評価勘定        | 789,850,688     |
| 未収入金            | 425,799         |
| 未収配当金           | 186,125,923     |
| 差入委託証拠金         | 3,582,608,068   |
| 流動資産合計          | 392,906,505,026 |
| 資産合計            | 392,906,505,026 |
| <b>負債の部</b>     |                 |
| 流動負債            |                 |
| 派生商品評価勘定        | 335,542         |
| 未払金             | 93,574          |
| 未払解約金           | 459,190,413     |
| 未払利息            | 241             |
| 流動負債合計          | 459,619,770     |
| 負債合計            | 459,619,770     |
| <b>純資産の部</b>    |                 |
| 元本等             |                 |
| 元本              | 126,395,162,676 |
| 剰余金             |                 |
| 剰余金又は欠損金（△）     | 266,051,722,580 |
| 元本等合計           | 392,446,885,256 |
| 純資産合計           | 392,446,885,256 |
| 負債純資産合計         | 392,906,505,026 |

## 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 | <p>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。なお、ロシア株式（DR（預託証券）を含みます。以下、同じ。）の評価については、「重要な会計上の見積りに関する注記」に記載しております。</p> <p>新株予約権証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。</p> <p>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。</p> |
|--------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

1.ロシア株式（以下、「当該株式」）の時価の算定

（1）当期の財務諸表に計上した金額

当該株式の評価額0円（令和 4年 3月11日評価額1,506,109,929円（保有割合0.55%））

（2）会計上の見積りの内容について財務諸表利用者の理解に資するその他の情報

①当期の財務諸表に計上した金額の算出方法及び算出に用いた主要な仮定

令和 4年 2月24日以降、ロシアのウクライナ侵攻を受けた米欧の経済制裁やそれに対抗措置をロシアが設けたことにより、取引の規制、決済機構やS W I F Tからの除外による取引後の受渡が行えない状況となり、市場でのロシア関連資産の取引が成立しない状況となりました。このため、組入株式の時価については金融商品取引所等における最終相場で評価していますが、当該株式の取引停止等に伴い、取引停止日以降の最終相場の価格が入手できない状況となりました。当該株式のロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引についても、実現が困難な状況となっております。

時価の算定に関する会計基準に基づきますと、組入有価証券に係る時価は秩序ある取引が行われると想定した場合の出口価格である必要があり、上記状況を総合的に勘案した結果、当ファンドが組み入れている当該株式において、令和 4年 3月14日付けで評価額をゼロとすることとし、期末日時点においても当該取り扱いを継続しております。

なお、令和 4年 3月24日にモスクワ証券取引所は一部取引を再開しておりますが、ロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引について、実現が困難な状況に変わりありません。

②翌期の財務諸表への影響

今後、当該株式のロシア国外の投資家による取引の再開、市場の流動性の回復、最終相場価格の提供再開、ならびに当該株式に係る証券決済や為替取引の実現等の変化があれば、状況を総合的に判断の上、その評価額をゼロから回復させる可能性もあります。

（貸借対照表に関する注記）

|                               | [令和 5年 1月26日現在] |
|-------------------------------|-----------------|
| 1. 期首                         | 令和 4年 1月27日     |
| 期首元本額                         | 90,443,130,201円 |
| 期中追加設定元本額                     | 59,533,403,191円 |
| 期中一部解約元本額                     | 23,581,370,716円 |
| 元本の内訳※                        |                 |
| MAX I S 全世界株式（オール・カントリー）上場投信  | 793,818,432円    |
| eMAX I S 新興国株式インデックス          | 11,038,226,503円 |
| eMAX I S バランス（8資産均等型）         | 1,727,433,611円  |
| eMAX I S バランス（波乗り型）           | 268,814,614円    |
| 三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）   | 554,160,997円    |
| コアバランス                        | 68,568円         |
| eMAX I S S l i m バランス（8資産均等型） | 7,153,605,941円  |

|                                  | [令和 5年 1月26日現在]  |
|----------------------------------|------------------|
| eMAXIS Slim 新興国株式インデックス          | 32,505,312,685円  |
| つみたて新興国株式                        | 6,620,408,623円   |
| つみたて8資産均等バランス                    | 3,329,170,009円   |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s            | 771,500円         |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s            | 1,941,302円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s            | 5,730,598円       |
| eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）          | 7,867,126,406円   |
| eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）        | 687,812,106円     |
| eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）     | 30,920,051,737円  |
| 新興国株式インデックス・オープン（ラップ向け）          | 1,804,766,989円   |
| つみたて全世界株式                        | 33,849,799円      |
| ラップ向けインデックスf 新興国株式               | 745,397,836円     |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）        | 38,745,046円      |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）        | 378,133,700円     |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）        | 331,353,943円     |
| 三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド          | 15,298,714,671円  |
| 新興国株式インデックスオープン                  | 491,673,459円     |
| eMAXIS 全世界株式インデックス               | 893,724,224円     |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）       | 234,975,523円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）        | 39,939,426円      |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）       | 227,986,038円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）          | 213,618,942円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）         | 801,652,504円     |
| MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）  | 1,077,567,960円   |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）       | 16,838,301円      |
| MUKAM バランスファンド2019-12（適格機関投資家限定） | 61,805,863円      |
| MUKAM バランスファンド2020-07（適格機関投資家限定） | 60,731,444円      |
| MUKAM バランスファンド2020-10（適格機関投資家限定） | 60,437,882円      |
| MUKAM バランスファンド2021-03（適格機関投資家限定） | 54,376,109円      |
| MUKAM バランスファンド2021-06（適格機関投資家限定） | 54,419,385円      |
| 合計                               | 126,395,162,676円 |
| 2. 受益権の総数                        | 126,395,162,676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 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、新株予約権証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                        | [令和 5年 1月26日現在]                                                                                                                                                                                                                    |
|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                                                             |
| 2.時価の算定方法                 | <p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。                                                                                                                                                                    |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種類   | [令和 5年 1月26日現在]    |  |
|------|--------------------|--|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |  |
| 株式   | 15,058,324,675     |  |
| 投資証券 | 32,645,675         |  |
| 合計   | 15,090,970,350     |  |

（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 5年 1月26日現在]

| 区分   | 種類             | 契約額等（円）        |       | 時価（円）          | 評価損益（円）     |
|------|----------------|----------------|-------|----------------|-------------|
|      |                |                | うち1年超 |                |             |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 10,531,025,148 | —     | 11,320,875,836 | 789,850,688 |
| 合計   |                | 10,531,025,148 | —     | 11,320,875,836 | 789,850,688 |

## （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 5年 1月26日現在]

| 区分        | 種類                     | 契約額等（円）    |       | 時価（円）      | 評価損益（円）  |
|-----------|------------------------|------------|-------|------------|----------|
|           |                        |            | うち1年超 |            |          |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引<br>買建<br>アメリカドル | 88,207,876 | —     | 87,872,334 | △335,542 |
| 合計        |                        | 88,207,876 | —     | 87,872,334 | △335,542 |

## （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 5年 1月26日現在] |
|--------------|-----------------|
| 1口当たり純資産額    | 3.1049円         |
| (1万口当たり純資産額) | (31,049円)       |

## 附属明細表

### 第１ 有価証券明細表

#### (1) 株式

(単位：円)

| 通貨     | 銘柄                            | 株式数       | 評価額   |              | 備考 |
|--------|-------------------------------|-----------|-------|--------------|----|
|        |                               |           | 単価    | 金額           |    |
| アメリカドル | GAZPROM PJSC                  | 3,587,358 | —     | —            |    |
|        | INNER MONGOLIA YITAI COAL-B   | 535,200   | 1.49  | 800,124.00   |    |
|        | LUKOIL PJSC                   | 122,600   | —     | —            |    |
|        | NOVATEK PJSC                  | 282,700   | —     | —            |    |
|        | ROSNEFT OIL CO PJSC           | 384,962   | —     | —            |    |
|        | SURGUTNEFTEGAS PJSC           | 2,405,300 | —     | —            |    |
|        | SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE     | 2,315,000 | —     | —            |    |
|        | TATNEFT PJSC                  | 455,759   | —     | —            |    |
|        | ALROSA PJSC                   | 745,960   | —     | —            |    |
|        | CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR  | 130,323   | 8.50  | 1,107,745.50 |    |
|        | MMC NORILSK NICKEL PJSC       | 19,483    | —     | —            |    |
|        | NOVOLIPETSK STEEL PJSC        | 439,080   | —     | —            |    |
|        | PHOSAGRO PJSC-GDR REG S       | 53,979    | —     | —            |    |
|        | POLYUS PJSC                   | 10,871    | —     | —            |    |
|        | SEVERSTAL PJSC                | 62,882    | —     | —            |    |
|        | SOUTHERN COPPER CORP          | 33,330    | 75.33 | 2,510,748.90 |    |
|        | UNITED CO RUSAL INTERNATIONAL | 1,071,810 | —     | —            |    |

|      |                              |               |        |                                   |  |
|------|------------------------------|---------------|--------|-----------------------------------|--|
|      | ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR   | 179,106       | 28.93  | 5,181,536.58                      |  |
|      | NIO INC - ADR                | 577,235       | 11.63  | 6,713,243.05                      |  |
|      | H WORLD GROUP LTD-ADR        | 78,802        | 49.78  | 3,922,763.56                      |  |
|      | TAL EDUCATION GROUP- ADR     | 180,671       | 7.65   | 1,382,133.15                      |  |
|      | TRIP.COM GROUP LTD-ADR       | 229,189       | 39.73  | 9,105,678.97                      |  |
|      | YUM CHINA HOLDINGS INC       | 175,781       | 61.17  | 10,752,523.77                     |  |
|      | AUTOHOME INC-ADR             | 29,375        | 36.36  | 1,068,075.00                      |  |
|      | IQIYI INC-ADR                | 186,085       | 5.77   | 1,073,710.45                      |  |
|      | JOYY INC-ADR                 | 20,462        | 37.01  | 757,298.62                        |  |
|      | KANZHUN LTD - ADR            | 76,979        | 25.25  | 1,943,719.75                      |  |
|      | TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR | 314,160       | 8.59   | 2,698,634.40                      |  |
|      | VK CO LTD                    | 34,689        | —      | —                                 |  |
|      | WEIBO CORP-SPON ADR          | 33,274        | 21.95  | 730,364.30                        |  |
|      | YANDEX NV-A                  | 92,564        | —      | —                                 |  |
|      | OZON HOLDINGS PLC - ADR      | 20,405        | —      | —                                 |  |
|      | PINDUODUO INC-ADR            | 216,913       | 96.49  | 20,929,935.37                     |  |
|      | VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR   | 182,565       | 15.08  | 2,753,080.20                      |  |
|      | MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS    | 2             | —      | —                                 |  |
|      | MAGNIT PJSC                  | 23,556        | —      | —                                 |  |
|      | X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR | 34,286        | —      | —                                 |  |
|      | LEGEND BIOTECH CORP-ADR      | 20,300        | 53.25  | 1,080,975.00                      |  |
|      | ZAI LAB LTD-ADR              | 36,082        | 44.05  | 1,589,412.10                      |  |
|      | COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG | 1,570,713     | 1.70   | 2,670,212.10                      |  |
|      | CREDICORP LTD                | 32,224        | 138.95 | 4,477,524.80                      |  |
|      | SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR | 796,628       | —      | —                                 |  |
|      | TCS GROUP HOLDING-GDR REG S  | 38,258        | —      | —                                 |  |
|      | VTB BANK PJSC                | 1,305,990,000 | —      | —                                 |  |
|      | 360 DIGITECH INC             | 42,400        | 23.03  | 976,472.00                        |  |
|      | LUFAX HOLDING LTD-ADR        | 258,676       | 2.79   | 721,706.04                        |  |
|      | MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ | 425,170       | —      | —                                 |  |
|      | KE HOLDINGS INC-ADR          | 296,983       | 18.36  | 5,452,607.88                      |  |
|      | SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B | 402,594       | 0.83   | 334,153.02                        |  |
|      | SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B | 186,810       | 3.15   | 589,759.17                        |  |
|      | MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO | 172,850       | —      | —                                 |  |
|      | INTER RAO UES PJSC           | 12,239,000    | —      | —                                 |  |
|      | DAQO NEW ENERGY CORP-ADR     | 24,020        | 46.43  | 1,115,248.60                      |  |
|      | アメリカドル 小計                    | 1,337,875,404 |        | 92,439,386.28<br>(11,949,639,464) |  |
| 香港ドル | CHINA COAL ENERGY CO-H       | 819,000       | 6.61   | 5,413,590.00                      |  |
|      | CHINA OILFIELD SERVICES-H    | 824,000       | 9.25   | 7,622,000.00                      |  |
|      | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 10,986,000    | 4.18   | 45,921,480.00                     |  |
|      | CHINA SHENHUA ENERGY CO-H    | 1,465,500     | 25.10  | 36,784,050.00                     |  |



|                              |           |        |               |  |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|--|
| PETROCHINA CO LTD-H          | 8,463,000 | 4.02   | 34,021,260.00 |  |
| YANKUANG ENERGY GROUP CO-H   | 564,000   | 26.75  | 15,087,000.00 |  |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 1,352,000 | 4.08   | 5,516,160.00  |  |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H  | 628,000   | 30.25  | 18,997,000.00 |  |
| CHINA HONGQIAO GROUP LTD     | 861,000   | 8.95   | 7,705,950.00  |  |
| CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 2,036,000 | 7.23   | 14,720,280.00 |  |
| CHINA RESOURCES CEMENT       | 914,000   | 4.65   | 4,250,100.00  |  |
| CMOC GROUP LTD-H             | 1,620,000 | 4.18   | 6,771,600.00  |  |
| DONGYUE GROUP                | 534,000   | 9.54   | 5,094,360.00  |  |
| GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H | 91,120    | 68.95  | 6,282,724.00  |  |
| JIANGXI COPPER CO LTD-H      | 460,000   | 13.72  | 6,311,200.00  |  |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS  | 722,000   | 7.31   | 5,277,820.00  |  |
| SHANDONG GOLD MINING CO LT-H | 290,250   | 15.66  | 4,545,315.00  |  |
| ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H  | 660,000   | 9.26   | 6,111,600.00  |  |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H  | 2,256,000 | 13.02  | 29,373,120.00 |  |
| AVICHINA INDUSTRY & TECH-H   | 1,247,000 | 4.01   | 5,000,470.00  |  |
| BOC AVIATION LTD             | 70,400    | 67.05  | 4,720,320.00  |  |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H | 654,000   | 3.13   | 2,047,020.00  |  |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS | 775,500   | 16.90  | 13,105,950.00 |  |
| CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L | 309,000   | 9.09   | 2,808,810.00  |  |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H    | 1,586,000 | 4.38   | 6,946,680.00  |  |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT | 570,000   | 9.30   | 5,301,000.00  |  |
| CITIC LTD                    | 2,263,000 | 9.01   | 20,389,630.00 |  |
| CRRC CORP LTD - H            | 1,934,000 | 3.55   | 6,865,700.00  |  |
| FOSUN INTERNATIONAL LTD      | 1,324,500 | 7.55   | 9,999,975.00  |  |
| HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS  | 339,000   | 23.75  | 8,051,250.00  |  |
| SANY HEAVY EQUIPMENT INTL    | 500,000   | 8.18   | 4,090,000.00  |  |
| WEICHAI POWER CO LTD-H       | 756,800   | 11.86  | 8,975,648.00  |  |
| XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H  | 158,200   | 7.95   | 1,257,690.00  |  |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC  | 258,000   | 42.90  | 11,068,200.00 |  |
| CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT | 1,958,111 | 3.63   | 7,107,942.93  |  |
| AIR CHINA LTD-H              | 758,000   | 7.61   | 5,768,380.00  |  |
| BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H | 656,000   | 6.18   | 4,054,080.00  |  |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDING | 844,000   | 11.30  | 9,537,200.00  |  |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H | 618,000   | 5.60   | 3,460,800.00  |  |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H | 1,278,100 | 8.10   | 10,352,610.00 |  |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD     | 630,000   | 6.52   | 4,107,600.00  |  |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H     | 806,000   | 7.81   | 6,294,860.00  |  |
| ORIENT OVERSEAS INTL LTD     | 49,500    | 133.00 | 6,583,500.00  |  |
| SHENZHEN INTL HOLDINGS       | 816,000   | 8.20   | 6,691,200.00  |  |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H     | 606,000   | 6.77   | 4,102,620.00  |  |
| BYD CO LTD-H                 | 355,000   | 226.40 | 80,372,000.00 |  |

|                              |           |        |                  |  |
|------------------------------|-----------|--------|------------------|--|
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H  | 1,236,000 | 4.70   | 5,809,200.00     |  |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H | 251,200   | 37.50  | 9,420,000.00     |  |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 2,719,000 | 12.04  | 32,736,760.00    |  |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H   | 1,047,500 | 10.84  | 11,354,900.00    |  |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H | 888,945   | 5.65   | 5,022,539.25     |  |
| LI AUTO INC-CLASS A          | 473,544   | 85.15  | 40,322,271.60    |  |
| MINTH GROUP LTD              | 364,000   | 22.75  | 8,281,000.00     |  |
| XPENG INC - CLASS A SHARES   | 346,424   | 36.30  | 12,575,191.20    |  |
| YADEA GROUP HOLDINGS LTD     | 482,000   | 17.34  | 8,357,880.00     |  |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD     | 516,800   | 119.20 | 61,602,560.00    |  |
| BOSIDENG INTL HLDGS LTD      | 1,002,000 | 4.41   | 4,418,820.00     |  |
| HAIER SMART HOME CO LTD-H    | 1,014,600 | 30.05  | 30,488,730.00    |  |
| LI NING CO LTD               | 996,000   | 74.40  | 74,102,400.00    |  |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 384,600   | 101.80 | 39,152,280.00    |  |
| XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS  | 549,000   | 10.54  | 5,786,460.00     |  |
| HAICHANG OCEAN PARK HOLDINGS | 1,300,000 | 1.93   | 2,509,000.00     |  |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI | 590,000   | 22.60  | 13,334,000.00    |  |
| JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD | 314,000   | 22.15  | 6,955,100.00     |  |
| KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING  | 170,000   | 73.70  | 12,529,000.00    |  |
| NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC | 610,880   | 37.40  | 22,846,912.00    |  |
| TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT | 498,800   | 19.70  | 9,826,360.00     |  |
| BAIDU INC-CLASS A            | 952,974   | 131.20 | 125,030,188.80   |  |
| BILIBILI INC-CLASS Z         | 79,435    | 201.20 | 15,982,322.00    |  |
| CHINA LITERATURE LTD         | 220,600   | 40.00  | 8,824,000.00     |  |
| CHINA RUYI HOLDINGS LTD      | 1,816,000 | 2.29   | 4,158,640.00     |  |
| KINGSOFT CORP LTD            | 403,600   | 28.90  | 11,664,040.00    |  |
| KUAISHOU TECHNOLOGY          | 740,500   | 70.10  | 51,909,050.00    |  |
| NETEASE INC                  | 851,095   | 141.00 | 120,004,395.00   |  |
| TENCENT HOLDINGS LTD         | 2,672,200 | 391.80 | 1,046,967,960.00 |  |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD    | 6,354,600 | 116.30 | 739,039,980.00   |  |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION T | 2,266,000 | 7.37   | 16,700,420.00    |  |
| CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS  | 234,000   | 19.84  | 4,642,560.00     |  |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H | 31,400    | 254.00 | 7,975,600.00     |  |
| CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU | 874,600   | 17.06  | 14,920,676.00    |  |
| JD HEALTH INTERNATIONAL INC  | 462,050   | 68.50  | 31,650,425.00    |  |
| JD.COM INC - CL A            | 926,683   | 238.80 | 221,291,900.40   |  |
| MEITUAN-CLASS B              | 2,158,320 | 168.10 | 362,813,592.00   |  |
| PING AN HEALTHCARE AND TECHN | 187,100   | 22.35  | 4,181,685.00     |  |
| POP MART INTERNATIONAL GROUP | 231,000   | 26.40  | 6,098,400.00     |  |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD | 970,000   | 7.73   | 7,498,100.00     |  |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS    | 231,000   | 45.45  | 10,498,950.00    |  |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B | 47,100    | 139.99 | 6,593,529.00     |  |

|                              |            |        |                |  |
|------------------------------|------------|--------|----------------|--|
| CHINA FEIHE LTD              | 1,508,000  | 7.94   | 11,973,520.00  |  |
| CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS | 372,000    | —      | —              |  |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO       | 1,359,000  | 37.50  | 50,962,500.00  |  |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDING | 696,000    | 61.70  | 42,943,200.00  |  |
| DALI FOODS GROUP CO LTD      | 927,500    | 3.66   | 3,394,650.00   |  |
| NONGFU SPRING CO LTD-H       | 800,000    | 42.95  | 34,360,000.00  |  |
| SMOORE INTERNATIONAL HOLDING | 797,000    | 12.12  | 9,659,640.00   |  |
| TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO | 738,000    | 13.02  | 9,608,760.00   |  |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-H    | 270,000    | 77.95  | 21,046,500.00  |  |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS | 561,000    | 7.64   | 4,286,040.00   |  |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 2,514,000  | 5.43   | 13,651,020.00  |  |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING  | 292,000    | 28.90  | 8,438,800.00   |  |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD     | 243,500    | 39.70  | 9,666,950.00   |  |
| VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS | 101,000    | 23.75  | 2,398,750.00   |  |
| HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C | 133,600    | 62.90  | 8,403,440.00   |  |
| MICROPORT SCIENTIFIC CORP    | 298,400    | 25.55  | 7,624,120.00   |  |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H | 1,072,000  | 13.98  | 14,986,560.00  |  |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H   | 265,300    | 14.16  | 3,756,648.00   |  |
| SINOPHARM GROUP CO-H         | 492,400    | 19.32  | 9,513,168.00   |  |
| 3SBIO INC                    | 630,500    | 8.86   | 5,586,230.00   |  |
| BEIGENE LTD                  | 278,423    | 166.30 | 46,301,744.90  |  |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING | 499,000    | 13.92  | 6,946,080.00   |  |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC | 847,500    | 6.00   | 5,085,000.00   |  |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE ME | 924,000    | 3.89   | 3,594,360.00   |  |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT | 4,053,840  | 9.35   | 37,903,404.00  |  |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP       | 494,000    | 27.70  | 13,683,800.00  |  |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H | 81,100     | 109.10 | 8,848,010.00   |  |
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP  | 506,000    | 16.80  | 8,500,800.00   |  |
| INNOVENT BIOLOGICS INC       | 506,500    | 43.10  | 21,830,150.00  |  |
| PHARMARON BEIJING CO LTD-H   | 104,400    | 68.00  | 7,099,200.00   |  |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H | 171,500    | 27.00  | 4,630,500.00   |  |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL       | 5,020,500  | 4.84   | 24,299,220.00  |  |
| WUXI APPTTEC CO LTD-H        | 99,540     | 107.20 | 10,670,688.00  |  |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC    | 1,560,000  | 71.35  | 111,306,000.00 |  |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 11,900,000 | 2.84   | 33,796,000.00  |  |
| BANK OF CHINA LTD-H          | 34,128,000 | 2.99   | 102,042,720.00 |  |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H  | 3,581,900  | 4.87   | 17,443,853.00  |  |
| CHINA CITIC BANK CORP LTD-H  | 3,423,000  | 3.80   | 13,007,400.00  |  |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H    | 41,128,550 | 5.13   | 210,989,461.50 |  |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 1,189,000  | 2.52   | 2,996,280.00   |  |
| CHINA MERCHANTS BANK-H       | 1,691,550  | 50.65  | 85,677,007.50  |  |
| CHINA MINSHENG BANKING COR-H | 2,103,320  | 2.93   | 6,162,727.60   |  |

|                              |            |        |                |  |
|------------------------------|------------|--------|----------------|--|
| IND & COMM BK OF CHINA-H     | 24,524,350 | 4.22   | 103,492,757.00 |  |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H | 3,238,000  | 5.44   | 17,614,720.00  |  |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H | 5,572,000  | 1.18   | 6,574,960.00   |  |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-H | 1,621,500  | 4.37   | 7,085,955.00   |  |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H | 634,000    | 17.72  | 11,234,480.00  |  |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H    | 907,000    | 18.50  | 16,779,500.00  |  |
| FAR EAST HORIZON LTD         | 513,000    | 7.28   | 3,734,640.00   |  |
| GF SECURITIES CO LTD-H       | 442,400    | 13.20  | 5,839,680.00   |  |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H  | 1,798,800  | 5.57   | 10,019,316.00  |  |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H   | 754,800    | 10.20  | 7,698,960.00   |  |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H    | 3,092,000  | 15.02  | 46,441,840.00  |  |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 1,165,600  | 21.65  | 25,235,240.00  |  |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLD | 486,800    | 11.52  | 5,607,936.00   |  |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H | 532,400    | 22.15  | 11,792,660.00  |  |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H | 3,392,000  | 2.69   | 9,124,480.00   |  |
| PICC PROPERTY & CASUALTY-H   | 2,710,000  | 7.60   | 20,596,000.00  |  |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 2,713,000  | 62.15  | 168,612,950.00 |  |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H | 306,800    | 27.50  | 8,437,000.00   |  |
| C&D INTERNATIONAL INVESTMENT | 299,000    | 24.90  | 7,445,100.00   |  |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP  | 2,660,000  | 1.85   | 4,921,000.00   |  |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 1,525,000  | 21.75  | 33,168,750.00  |  |
| CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD | 390,000    | 10.38  | 4,048,200.00   |  |
| CHINA RESOURCES LAND LTD     | 1,378,000  | 39.75  | 54,775,500.00  |  |
| CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY | 291,600    | 44.50  | 12,976,200.00  |  |
| CHINA VANKE CO LTD-H         | 822,551    | 16.48  | 13,555,640.48  |  |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO   | 5,470,232  | 2.88   | 15,754,268.16  |  |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD | 952,000    | 21.05  | 20,039,600.00  |  |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS     | 299,000    | 12.36  | 3,695,640.00   |  |
| GREENTOWN SERVICE GROUP CO L | 480,000    | 5.80   | 2,784,000.00   |  |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD   | 877,500    | 25.00  | 21,937,500.00  |  |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD       | 768,000    | 11.32  | 8,693,760.00   |  |
| CHINASOFT INTERNATIONAL LTD  | 1,144,000  | 6.98   | 7,985,120.00   |  |
| GDS HOLDINGS LTD-CL A        | 351,476    | 22.05  | 7,750,045.80   |  |
| KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR  | 1,098,000  | 17.66  | 19,390,680.00  |  |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H   | 548,000    | 16.88  | 9,250,240.00   |  |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN | 250,500    | 21.55  | 5,398,275.00   |  |
| BYD ELECTRONIC INTL CO LTD   | 251,000    | 26.95  | 6,764,450.00   |  |
| KINGBOARD HOLDINGS LTD       | 242,000    | 30.95  | 7,489,900.00   |  |
| KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD | 232,500    | 9.43   | 2,192,475.00   |  |
| LENOVO GROUP LTD             | 2,880,000  | 6.21   | 17,884,800.00  |  |
| SUNNY OPTICAL TECH           | 291,400    | 106.90 | 31,150,660.00  |  |
| XIAOMI CORP-CLASS B          | 6,441,000  | 11.86  | 76,390,260.00  |  |

|                |                              |             |        |                                      |  |
|----------------|------------------------------|-------------|--------|--------------------------------------|--|
|                | ZTE CORP-H                   | 501,131     | 19.74  | 9,892,325.94                         |  |
|                | CHINA TOWER CORP LTD-H       | 17,376,000  | 0.91   | 15,812,160.00                        |  |
|                | BEIJING ENTERPRISES HLDGS    | 206,000     | 27.40  | 5,644,400.00                         |  |
|                | BEIJING ENTERPRISES WATER GR | 1,488,000   | 2.08   | 3,095,040.00                         |  |
|                | CGN POWER CO LTD-H           | 4,100,000   | 1.94   | 7,954,000.00                         |  |
|                | CHINA GAS HOLDINGS LTD       | 1,295,800   | 12.08  | 15,653,264.00                        |  |
|                | CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H | 1,353,000   | 11.22  | 15,180,660.00                        |  |
|                | CHINA POWER INTERNATIONAL    | 2,292,000   | 3.55   | 8,136,600.00                         |  |
|                | CHINA RESOURCES GAS GROUP LT | 364,000     | 33.45  | 12,175,800.00                        |  |
|                | CHINA RESOURCES POWER HOLDIN | 932,000     | 16.86  | 15,713,520.00                        |  |
|                | ENN ENERGY HOLDINGS LTD      | 338,600     | 124.10 | 42,020,260.00                        |  |
|                | GUANGDONG INVESTMENT LTD     | 1,434,000   | 8.96   | 12,848,640.00                        |  |
|                | HUANENG POWER INTL INC-H     | 1,700,000   | 3.77   | 6,409,000.00                         |  |
|                | KUNLUN ENERGY CO LTD         | 1,680,000   | 6.49   | 10,903,200.00                        |  |
|                | FLAT GLASS GROUP CO LTD-H    | 146,000     | 24.65  | 3,598,900.00                         |  |
|                | GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD  | 8,441,000   | 2.22   | 18,739,020.00                        |  |
|                | HANERGY THIN FILM POWER GROU | 960,000     | 3.91   | 3,753,600.00                         |  |
|                | HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD   | 251,000     | 31.15  | 7,818,650.00                         |  |
|                | SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H  | 153,000     | 32.45  | 4,964,850.00                         |  |
|                | XINYI SOLAR HOLDINGS LTD     | 2,008,000   | 10.34  | 20,762,720.00                        |  |
|                | 香港ドル 小計                      | 355,861,094 |        | 5,938,262,173.06<br>(98,040,708,477) |  |
| マレーシアリン<br>ギット | DIALOG GROUP BHD             | 2,239,880   | 2.73   | 6,114,872.40                         |  |
|                | PETRONAS DAGANGAN BHD        | 94,300      | 23.00  | 2,168,900.00                         |  |
|                | PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 1,214,900   | 8.50   | 10,326,650.00                        |  |
|                | PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN | 1,634,800   | 5.34   | 8,729,832.00                         |  |
|                | HAP SENG CONSOLIDATED        | 221,400     | 7.16   | 1,585,224.00                         |  |
|                | SIME DARBY BERHAD            | 1,129,200   | 2.34   | 2,642,328.00                         |  |
|                | MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD  | 349,900     | 7.16   | 2,505,284.00                         |  |
|                | MISC BHD                     | 522,300     | 7.20   | 3,760,560.00                         |  |
|                | GENTING BHD                  | 916,400     | 5.04   | 4,618,656.00                         |  |
|                | GENTING MALAYSIA BHD         | 1,221,400   | 2.87   | 3,505,418.00                         |  |
|                | MR DIY GROUP M BHD           | 978,000     | 1.98   | 1,936,440.00                         |  |
|                | IOI CORP BHD                 | 1,053,200   | 3.85   | 4,054,820.00                         |  |
|                | KUALA LUMPUR KEPONG BHD      | 189,000     | 21.28  | 4,021,920.00                         |  |
|                | NESTLE (MALAYSIA) BERHAD     | 30,900      | 135.20 | 4,177,680.00                         |  |
|                | PPB GROUP BERHAD             | 232,240     | 17.52  | 4,068,844.80                         |  |
|                | QL RESOURCES BHD             | 521,250     | 5.86   | 3,054,525.00                         |  |
|                | SIME DARBY PLANTATION BHD    | 710,000     | 4.34   | 3,081,400.00                         |  |
|                | HARTALEGA HOLDINGS BHD       | 620,500     | 1.65   | 1,023,825.00                         |  |
|                | IHH HEALTHCARE BHD           | 705,300     | 5.90   | 4,161,270.00                         |  |
|                | TOP GLOVE CORP BHD           | 1,607,000   | 0.87   | 1,398,090.00                         |  |

|       |                              |            |        |                                   |  |
|-------|------------------------------|------------|--------|-----------------------------------|--|
|       | AMMB HOLDINGS BHD            | 617,300    | 4.05   | 2,500,065.00                      |  |
|       | CIMB GROUP HOLDINGS BHD      | 3,108,200  | 5.78   | 17,965,396.00                     |  |
|       | HONG LEONG BANK BERHAD       | 231,800    | 20.76  | 4,812,168.00                      |  |
|       | HONG LEONG FINANCIAL GROUP   | 66,500     | 18.96  | 1,260,840.00                      |  |
|       | MALAYAN BANKING BHD          | 1,991,700  | 8.81   | 17,546,877.00                     |  |
|       | PUBLIC BANK BERHAD           | 6,011,400  | 4.29   | 25,788,906.00                     |  |
|       | RHB BANK BHD                 | 682,449    | 5.75   | 3,924,081.75                      |  |
|       | AXIATA GROUP BERHAD          | 1,195,000  | 3.04   | 3,632,800.00                      |  |
|       | DIGI.COM BHD                 | 1,398,100  | 4.18   | 5,844,058.00                      |  |
|       | MAXIS BHD                    | 875,400    | 3.96   | 3,466,584.00                      |  |
|       | TELEKOM MALAYSIA BHD         | 653,000    | 5.20   | 3,395,600.00                      |  |
|       | PETRONAS GAS BHD             | 413,000    | 17.08  | 7,054,040.00                      |  |
|       | TENAGA NASIONAL BHD          | 1,070,800  | 9.52   | 10,194,016.00                     |  |
|       | INARI AMERTRON BHD           | 1,618,200  | 2.67   | 4,320,594.00                      |  |
|       | マレーシアリングット 小計                | 36,124,719 |        | 188,642,564.95<br>(5,727,508,964) |  |
| タイバーツ | PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR   | 652,200    | 172.00 | 112,178,400.00                    |  |
|       | PTT PCL-NVDR                 | 3,990,100  | 33.50  | 133,668,350.00                    |  |
|       | THAI OIL PCL-NVDR            | 735,900    | 58.75  | 43,234,125.00                     |  |
|       | INDORAMA VENTURES PCL-NVDR   | 587,200    | 41.75  | 24,515,600.00                     |  |
|       | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 1,048,461  | 51.25  | 53,733,626.25                     |  |
|       | SCG PACKAGING PCL-NVDR       | 561,600    | 52.00  | 29,203,200.00                     |  |
|       | SIAM CEMENT PCL-NVDR         | 345,150    | 345.00 | 119,076,750.00                    |  |
|       | AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR | 1,702,000  | 75.00  | 127,650,000.00                    |  |
|       | BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR      | 3,539,400  | 10.00  | 35,394,000.00                     |  |
|       | BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR  | 2,999,900  | 8.70   | 26,099,130.00                     |  |
|       | ASSET WORLD CORP PCL-NVDR    | 2,111,500  | 6.20   | 13,091,300.00                     |  |
|       | MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | 1,449,100  | 33.75  | 48,907,125.00                     |  |
|       | CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR | 955,517    | 43.75  | 41,803,868.75                     |  |
|       | HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR | 1,999,001  | 14.40  | 28,785,614.40                     |  |
|       | PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR | 1,193,900  | 23.00  | 27,459,700.00                     |  |
|       | BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR  | 593,600    | 37.25  | 22,111,600.00                     |  |
|       | CP ALL PCL-NVDR              | 2,565,900  | 69.75  | 178,971,525.00                    |  |
|       | CARABAO GROUP PCL-NVDR       | 139,600    | 103.00 | 14,378,800.00                     |  |
|       | CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR  | 1,531,600  | 23.60  | 36,145,760.00                     |  |
|       | OSOTSPA PCL-NVDR             | 937,200    | 29.50  | 27,647,400.00                     |  |
|       | THAI UNION GROUP PCL-NVDR    | 1,210,200  | 16.10  | 19,484,220.00                     |  |
|       | BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR | 4,138,100  | 29.00  | 120,004,900.00                    |  |
|       | BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR | 263,500    | 207.00 | 54,544,500.00                     |  |
|       | KASIKORNBANK PCL-NVDR        | 277,200    | 143.50 | 39,778,200.00                     |  |
|       | KRUNG THAI BANK - NVDR       | 1,246,400  | 17.70  | 22,061,280.00                     |  |
|       | SCB X PCL-NVDR               | 370,400    | 106.50 | 39,447,600.00                     |  |

|           |                              |            |           |                   |                 |
|-----------|------------------------------|------------|-----------|-------------------|-----------------|
|           | JMT NETWORK SERVICES-NVDR    | 398,400    | 59.50     | 23,704,800.00     |                 |
|           | KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR      | 264,500    | 56.75     | 15,010,375.00     |                 |
|           | MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR   | 402,800    | 39.00     | 15,709,200.00     |                 |
|           | SRISAWAD CORP PCL-NVDR       | 213,200    | 53.25     | 11,352,900.00     |                 |
|           | CENTRAL PATTANA PCL-NVDR     | 809,100    | 70.00     | 56,637,000.00     |                 |
|           | LAND & HOUSES PUB - NVDR     | 2,908,400  | 9.75      | 28,356,900.00     |                 |
|           | DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR  | 139,500    | 894.00    | 124,713,000.00    |                 |
|           | ADVANCED INFO SERVICE-NVDR   | 551,100    | 201.00    | 110,771,100.00    |                 |
|           | INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR    | 513,100    | 73.75     | 37,841,125.00     |                 |
|           | TRUE CORP PCL-NVDR           | 3,793,576  | 4.90      | 18,588,522.40     |                 |
|           | B GRIMM POWER PCL-NVDR       | 611,700    | 42.25     | 25,844,325.00     |                 |
|           | ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR  | 90,600     | 176.50    | 15,990,900.00     |                 |
|           | ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR     | 751,800    | 88.00     | 66,158,400.00     |                 |
|           | GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR    | 372,600    | 74.50     | 27,758,700.00     |                 |
|           | GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR | 1,176,000  | 54.50     | 64,092,000.00     |                 |
|           | RATCH GROUP PCL-NVDR         | 494,800    | 43.75     | 21,647,500.00     |                 |
|           | タイバーツ 小計                     | 50,635,805 |           | 2,103,553,321.80  | (8,309,035,621) |
| フィリピンペソ   | ABOITIZ EQUITY VENTURES INC  | 641,380    | 58.50     | 37,520,730.00     |                 |
|           | AYALA CORPORATION            | 103,755    | 749.00    | 77,712,495.00     |                 |
|           | JG SUMMIT HOLDINGS INC       | 1,608,969  | 56.50     | 90,906,748.50     |                 |
|           | SM INVESTMENTS CORP          | 99,935     | 945.00    | 94,438,575.00     |                 |
|           | INTL CONTAINER TERM SVCS INC | 507,200    | 216.60    | 109,859,520.00    |                 |
|           | JOLLIBEE FOODS CORP          | 261,310    | 244.00    | 63,759,640.00     |                 |
|           | MONDE NISSIN CORP            | 2,742,200  | 14.30     | 39,213,460.00     |                 |
|           | UNIVERSAL ROBINA CORP        | 367,600    | 141.90    | 52,162,440.00     |                 |
|           | BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN | 771,031    | 109.20    | 84,196,585.20     |                 |
|           | BDO UNIBANK INC              | 973,776    | 122.00    | 118,800,672.00    |                 |
|           | METROPOLITAN BANK & TRUST    | 627,656    | 58.90     | 36,968,938.40     |                 |
|           | AYALA LAND INC               | 2,754,720  | 32.80     | 90,354,816.00     |                 |
|           | SM PRIME HOLDINGS INC        | 4,783,700  | 37.80     | 180,823,860.00    |                 |
|           | GLOBE TELECOM INC            | 9,035      | 2,150.00  | 19,425,250.00     |                 |
|           | PLDT INC                     | 35,425     | 1,547.00  | 54,802,475.00     |                 |
|           | ACEN CORP                    | 3,785,365  | 7.50      | 28,390,237.50     |                 |
|           | MANILA ELECTRIC COMPANY      | 113,060    | 288.00    | 32,561,280.00     |                 |
|           | フィリピンペソ 小計                   | 20,186,117 |           | 1,211,897,722.60  | (2,866,259,303) |
| インドネシアルピア | ADARO ENERGY INDONESIA TBK P | 6,965,600  | 3,130.00  | 21,802,328,000.00 |                 |
|           | UNITED TRACTORS TBK PT       | 690,800    | 26,050.00 | 17,995,340,000.00 |                 |
|           | ANEKA TAMBANG TBK            | 3,302,400  | 2,290.00  | 7,562,496,000.00  |                 |
|           | BARITO PACIFIC TBK PT        | 9,046,670  | 840.00    | 7,599,202,800.00  |                 |
|           | INDAH KIAT PULP & PAPER TBK  | 1,246,400  | 8,775.00  | 10,937,160,000.00 |                 |

|        |                               |             |           |                                       |  |
|--------|-------------------------------|-------------|-----------|---------------------------------------|--|
|        | MERDEKA COPPER GOLD TBK PT    | 6,416,400   | 4,780.00  | 30,670,392,000.00                     |  |
|        | SEMEN INDONESIA PERSERO TBK   | 1,836,700   | 7,050.00  | 12,948,735,000.00                     |  |
|        | VALE INDONESIA TBK            | 995,100     | 7,300.00  | 7,264,230,000.00                      |  |
|        | ASTRA INTERNATIONAL TBK PT    | 8,168,700   | 5,950.00  | 48,603,765,000.00                     |  |
|        | SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P  | 7,091,700   | 2,660.00  | 18,863,922,000.00                     |  |
|        | CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT | 3,067,700   | 5,875.00  | 18,022,737,500.00                     |  |
|        | INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T  | 1,010,700   | 10,425.00 | 10,536,547,500.00                     |  |
|        | INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P  | 1,457,100   | 6,800.00  | 9,908,280,000.00                      |  |
|        | UNILEVER INDONESIA TBK PT     | 3,086,500   | 4,850.00  | 14,969,525,000.00                     |  |
|        | KALBE FARMA TBK PT            | 7,286,400   | 2,050.00  | 14,937,120,000.00                     |  |
|        | BANK CENTRAL ASIA TBK PT      | 23,929,000  | 8,200.00  | 196,217,800,000.00                    |  |
|        | BANK JAGO TBK PT              | 1,805,200   | 3,450.00  | 6,227,940,000.00                      |  |
|        | BANK MANDIRI PERSERO TBK PT   | 8,355,300   | 9,700.00  | 81,046,410,000.00                     |  |
|        | BANK NEGARA INDONESIA PERSER  | 2,882,600   | 9,075.00  | 26,159,595,000.00                     |  |
|        | BANK RAKYAT INDONESIA PERSER  | 28,674,600  | 4,560.00  | 130,756,176,000.00                    |  |
|        | SARANA MENARA NUSANTARA PT    | 7,334,800   | 1,115.00  | 8,178,302,000.00                      |  |
|        | TELKOM INDONESIA PERSERO TBK  | 21,993,500  | 3,840.00  | 84,455,040,000.00                     |  |
|        | インドネシアルピア 小計                  | 156,643,870 |           | 785,663,043,800.00<br>(6,835,268,481) |  |
| メキシコペソ | CEMEX SAB-CPO                 | 7,080,668   | 9.57      | 67,761,992.76                         |  |
|        | GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B  | 1,369,970   | 83.54     | 114,447,293.80                        |  |
|        | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV  | 43,505      | 288.95    | 12,570,769.75                         |  |
|        | ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV  | 468,098     | 38.74     | 18,134,116.52                         |  |
|        | ALFA S.A.B. -A                | 1,094,600   | 13.59     | 14,875,614.00                         |  |
|        | GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1  | 145,000     | 96.43     | 13,982,350.00                         |  |
|        | GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B  | 158,400     | 343.94    | 54,480,096.00                         |  |
|        | GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B  | 88,800      | 542.53    | 48,176,664.00                         |  |
|        | PROMOTORA Y OPERADORA DE INF  | 118,725     | 182.67    | 21,687,495.75                         |  |
|        | GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO    | 1,036,800   | 22.19     | 23,006,592.00                         |  |
|        | WALMART DE MEXICO SAB DE CV   | 2,226,700   | 75.96     | 169,140,132.00                        |  |
|        | ARCA CONTINENTAL SAB DE CV    | 172,666     | 164.45    | 28,394,923.70                         |  |
|        | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV     | 270,100     | 141.22    | 38,143,522.00                         |  |
|        | FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD  | 852,700     | 162.18    | 138,290,886.00                        |  |
|        | GRUMA S.A.B. -B               | 89,175      | 274.29    | 24,459,810.75                         |  |
|        | GRUPO BIMBO SAB- SERIES A     | 566,500     | 95.53     | 54,117,745.00                         |  |
|        | KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A    | 546,900     | 35.75     | 19,551,675.00                         |  |
|        | BANCO DEL BAJIO SA            | 357,300     | 71.02     | 25,375,446.00                         |  |
|        | GRUPO FINANCIERO BANORTE-0    | 1,093,200   | 157.23    | 171,883,836.00                        |  |
|        | GRUPO FINANCIERO INBURSA-0    | 847,000     | 40.83     | 34,583,010.00                         |  |
|        | AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L  | 11,733,400  | 19.92     | 233,729,328.00                        |  |
|        | メキシコペソ 小計                     | 30,360,207  |           | 1,326,793,299.03<br>(9,123,959,479)   |  |



|         |                              |           |       |                |  |
|---------|------------------------------|-----------|-------|----------------|--|
| ブラジルリアル | COSAN SA                     | 470,400   | 16.82 | 7,912,128.00   |  |
|         | PETRO RIO SA                 | 270,600   | 41.92 | 11,343,552.00  |  |
|         | PETROBRAS - PETROLEO BRAS    | 1,568,600 | 30.42 | 47,716,812.00  |  |
|         | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | 2,098,700 | 26.94 | 56,538,978.00  |  |
|         | ULTRAPAR PARTICIPACOES SA    | 306,800   | 13.16 | 4,037,488.00   |  |
|         | BRASKEM SA-PREF A            | 68,300    | 22.65 | 1,546,995.00   |  |
|         | CIA SIDERURGICA NACIONAL SA  | 246,600   | 17.61 | 4,342,626.00   |  |
|         | GERDAU SA-PREF               | 558,000   | 32.28 | 18,012,240.00  |  |
|         | KLABIN SA - UNIT             | 321,800   | 19.42 | 6,249,356.00   |  |
|         | SUZANO SA                    | 302,022   | 46.77 | 14,125,568.94  |  |
|         | VALE SA                      | 1,648,829 | 96.20 | 158,617,349.80 |  |
|         | WEG SA                       | 719,088   | 38.72 | 27,843,087.36  |  |
|         | CCR SA                       | 527,800   | 11.94 | 6,301,932.00   |  |
|         | LOCALIZA RENT A CAR          | 329,713   | 59.19 | 19,515,712.47  |  |
|         | RUMO SA                      | 498,600   | 18.78 | 9,363,708.00   |  |
|         | LOJAS RENNER S.A.            | 410,922   | 21.73 | 8,929,335.06   |  |
|         | MAGAZINE LUIZA SA            | 1,065,200 | 4.35  | 4,633,620.00   |  |
|         | VIBRA ENERGIA SA             | 464,100   | 15.99 | 7,420,959.00   |  |
|         | ATACADAO SA                  | 343,900   | 16.28 | 5,598,692.00   |  |
|         | RAIA DROGASIL SA             | 420,200   | 24.91 | 10,467,182.00  |  |
|         | SENDAS DISTRIBUIDORA SA      | 370,700   | 21.11 | 7,825,477.00   |  |
|         | AMBEV SA                     | 2,091,400 | 13.71 | 28,673,094.00  |  |
|         | BRF SA                       | 201,700   | 8.14  | 1,641,838.00   |  |
|         | JBS SA                       | 318,500   | 22.07 | 7,029,295.00   |  |
|         | NATURA &CO HOLDING SA        | 315,100   | 13.18 | 4,153,018.00   |  |
|         | HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE | 1,929,371 | 4.58  | 8,836,519.18   |  |
|         | REDE D'OR SAO LUIZ SA        | 264,500   | 29.60 | 7,829,200.00   |  |
|         | HYPERA SA                    | 205,800   | 44.29 | 9,114,882.00   |  |
|         | BANCO BRADESCO S.A.          | 619,437   | 12.61 | 7,811,100.57   |  |
|         | BANCO BRADESCO SA-PREF       | 2,279,486 | 14.10 | 32,140,752.60  |  |
|         | BANCO DO BRASIL S.A.         | 424,800   | 40.65 | 17,268,120.00  |  |
|         | BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT  | 177,400   | 28.93 | 5,132,182.00   |  |
|         | ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | 2,127,430 | 25.62 | 54,504,756.60  |  |
|         | ITAUSA SA                    | 2,339,145 | 8.58  | 20,069,864.10  |  |
|         | B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO    | 2,597,625 | 13.11 | 34,054,863.75  |  |
|         | BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT    | 513,000   | 21.56 | 11,060,280.00  |  |
|         | BB SEGURIDADE PARTICIPACOES  | 277,100   | 37.18 | 10,302,578.00  |  |
|         | TOTVS SA                     | 187,100   | 29.99 | 5,611,129.00   |  |
|         | TELEFONICA BRASIL S.A.       | 203,375   | 40.03 | 8,141,101.25   |  |
|         | TIM SA                       | 382,377   | 11.44 | 4,374,392.88   |  |
|         | CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B | 103,700   | 44.22 | 4,585,614.00   |  |
|         | CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER | 505,700   | 42.68 | 21,583,276.00  |  |
|         |                              |           |       |                |  |

|            |                              |            |            |                                      |  |
|------------|------------------------------|------------|------------|--------------------------------------|--|
|            | CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF | 777,990    | 11.72      | 9,118,042.80                         |  |
|            | CIA SANEAMENTO BASICO DE SP  | 124,900    | 54.54      | 6,812,046.00                         |  |
|            | CPFL ENERGIA SA              | 104,700    | 33.77      | 3,535,719.00                         |  |
|            | ENERGISA SA-UNITS            | 86,100     | 42.56      | 3,664,416.00                         |  |
|            | ENGIE BRASIL ENERGIA SA      | 65,950     | 38.90      | 2,565,455.00                         |  |
|            | EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD  | 437,000    | 27.87      | 12,179,190.00                        |  |
| ブラジルリアル 小計 |                              | 32,671,560 |            | 780,135,524.36<br>(19,850,704,444)   |  |
| チリペソ       | EMPRESAS COPEC SA            | 179,570    | 6,058.40   | 1,087,906,888.00                     |  |
|            | EMPRESAS CMPC SA             | 544,129    | 1,400.10   | 761,835,012.00                       |  |
|            | SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B | 60,490     | 73,151.00  | 4,424,903,990.00                     |  |
|            | CIA SUD AMERICANA DE VAPORES | 6,502,900  | 69.06      | 449,090,274.00                       |  |
|            | FALABELLA SA                 | 290,088    | 1,923.30   | 557,926,250.00                       |  |
|            | CENCOSUD SA                  | 549,556    | 1,393.70   | 765,916,197.00                       |  |
|            | CIA CERVECERIAS UNIDAS SA    | 37,740     | 6,252.60   | 235,973,124.00                       |  |
|            | BANCO DE CHILE               | 20,282,094 | 85.88      | 1,741,826,232.00                     |  |
|            | BANCO DE CREDITO E INVERSION | 22,255     | 24,096.00  | 536,256,480.00                       |  |
|            | BANCO SANTANDER CHILE        | 34,054,503 | 31.59      | 1,075,781,749.00                     |  |
|            | ENEL AMERICAS SA             | 8,527,077  | 105.75     | 901,738,392.00                       |  |
|            | ENEL CHILE SA                | 12,211,839 | 36.93      | 450,983,214.00                       |  |
| チリペソ 小計    |                              | 83,262,241 |            | 12,990,137,802.00<br>(2,091,139,393) |  |
| 韓国ウォン      | HD HYUNDAI                   | 19,486     | 63,000.00  | 1,227,618,000.00                     |  |
|            | S-OIL CORP                   | 21,502     | 89,000.00  | 1,913,678,000.00                     |  |
|            | SK INNOVATION CO LTD         | 22,135     | 161,500.00 | 3,574,802,500.00                     |  |
|            | HANWHA SOLUTIONS CORP        | 44,037     | 45,250.00  | 1,992,674,250.00                     |  |
|            | HYUNDAI STEEL CO             | 40,550     | 34,350.00  | 1,392,892,500.00                     |  |
|            | KOREA ZINC CO LTD            | 4,147      | 564,000.00 | 2,338,908,000.00                     |  |
|            | KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD   | 8,081      | 147,900.00 | 1,195,179,900.00                     |  |
|            | LG CHEM LTD                  | 20,975     | 652,000.00 | 13,675,700,000.00                    |  |
|            | LG CHEM LTD-PREFERENCE       | 4,941      | 295,000.00 | 1,457,595,000.00                     |  |
|            | LOTTE CHEMICAL CORP          | 7,769      | 183,800.00 | 1,427,942,200.00                     |  |
|            | POSCO CHEMICAL CO LTD        | 10,834     | 182,800.00 | 1,980,455,200.00                     |  |
|            | POSCO HOLDINGS INC           | 33,427     | 303,000.00 | 10,128,381,000.00                    |  |
|            | SK IE TECHNOLOGY CO LTD      | 8,200      | 65,500.00  | 537,100,000.00                       |  |
|            | SKC CO LTD                   | 8,074      | 95,500.00  | 771,067,000.00                       |  |
|            | CJ CORP                      | 6,002      | 84,200.00  | 505,368,400.00                       |  |
|            | DOOSAN BOBCAT INC            | 16,789     | 34,650.00  | 581,738,850.00                       |  |
|            | DOOSAN ENERBILITY CO LTD     | 169,761    | 16,110.00  | 2,734,849,710.00                     |  |
|            | ECOPRO BM CO LTD             | 25,500     | 101,700.00 | 2,593,350,000.00                     |  |
|            | GS HOLDINGS                  | 28,574     | 44,950.00  | 1,284,401,300.00                     |  |
|            | HYUNDAI ENGINEERING & CONST  | 46,328     | 37,650.00  | 1,744,249,200.00                     |  |
|            | HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO  | 9,100      | 108,100.00 | 983,710,000.00                       |  |

|                              |         |            |                   |  |
|------------------------------|---------|------------|-------------------|--|
| HYUNDAI MIPO DOCKYARD        | 10,557  | 77,300.00  | 816,056,100.00    |  |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES   | 32,869  | 47,450.00  | 1,559,634,050.00  |  |
| KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR | 20,092  | 76,200.00  | 1,531,010,400.00  |  |
| LG CORP                      | 36,909  | 83,000.00  | 3,063,447,000.00  |  |
| LG ENERGY SOLUTION           | 15,692  | 484,000.00 | 7,594,928,000.00  |  |
| SAMSUNG C&T CORP             | 34,307  | 118,800.00 | 4,075,671,600.00  |  |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD   | 60,594  | 24,200.00  | 1,466,374,800.00  |  |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES     | 235,703 | 5,180.00   | 1,220,941,540.00  |  |
| SK INC                       | 14,596  | 194,700.00 | 2,841,841,200.00  |  |
| S-1 CORPORATION              | 3,622   | 60,000.00  | 217,320,000.00    |  |
| HMM CO LTD                   | 113,840 | 22,150.00  | 2,521,556,000.00  |  |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD        | 8,473   | 179,500.00 | 1,520,903,500.00  |  |
| KOREAN AIR LINES CO LTD      | 83,648  | 24,300.00  | 2,032,646,400.00  |  |
| PAN OCEAN CO LTD             | 86,872  | 5,900.00   | 512,544,800.00    |  |
| HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO | 27,855  | 33,050.00  | 920,607,750.00    |  |
| HANON SYSTEMS                | 106,991 | 9,180.00   | 982,177,380.00    |  |
| HYUNDAI MOBIS CO LTD         | 27,520  | 212,500.00 | 5,848,000,000.00  |  |
| HYUNDAI MOTOR CO             | 59,096  | 165,700.00 | 9,792,207,200.00  |  |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF | 14,465  | 80,200.00  | 1,160,093,000.00  |  |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF     | 7,269   | 79,900.00  | 580,793,100.00    |  |
| KIA CORP                     | 116,788 | 65,000.00  | 7,591,220,000.00  |  |
| COWAY CO LTD                 | 22,456  | 55,100.00  | 1,237,325,600.00  |  |
| F&F CO LTD / NEW             | 6,500   | 148,100.00 | 962,650,000.00    |  |
| LG ELECTRONICS INC           | 50,381  | 96,600.00  | 4,866,804,600.00  |  |
| KANGWON LAND INC             | 29,678  | 23,800.00  | 706,336,400.00    |  |
| CHEIL WORLDWIDE INC          | 30,006  | 21,850.00  | 655,631,100.00    |  |
| HYBE CO LTD                  | 8,133   | 186,400.00 | 1,515,991,200.00  |  |
| KAKAO CORP                   | 133,148 | 62,600.00  | 8,335,064,800.00  |  |
| KAKAO GAMES CORP             | 16,300  | 47,000.00  | 766,100,000.00    |  |
| KRAFTON INC                  | 13,066  | 174,000.00 | 2,273,484,000.00  |  |
| NAVER CORP                   | 56,512  | 202,000.00 | 11,415,424,000.00 |  |
| NCSOFT CORP                  | 6,797   | 467,500.00 | 3,177,597,500.00  |  |
| NETMARBLE CORP               | 6,554   | 58,000.00  | 380,132,000.00    |  |
| PEARL ABYSS CORP             | 8,795   | 45,450.00  | 399,732,750.00    |  |
| HOTEL SHILLA CO LTD          | 12,861  | 82,200.00  | 1,057,174,200.00  |  |
| LOTTE SHOPPING CO            | 5,734   | 96,300.00  | 552,184,200.00    |  |
| BGF RETAIL CO LTD            | 2,676   | 189,900.00 | 508,172,400.00    |  |
| E-MART INC                   | 11,844  | 106,100.00 | 1,256,648,400.00  |  |
| CJ CHEILJEDANG CORP          | 3,067   | 338,500.00 | 1,038,179,500.00  |  |
| KT&G CORP                    | 43,392  | 95,400.00  | 4,139,596,800.00  |  |
| ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA | 9,688   | 124,500.00 | 1,206,156,000.00  |  |
| AMOREPACIFIC CORP            | 11,679  | 145,600.00 | 1,700,462,400.00  |  |

|         |                              |           |            |                                        |  |
|---------|------------------------------|-----------|------------|----------------------------------------|--|
|         | LG H&H                       | 4,130     | 732,000.00 | 3,023,160,000.00                       |  |
|         | CELLTRION HEALTHCARE CO LTD  | 34,978    | 58,500.00  | 2,046,213,000.00                       |  |
|         | HLB INC                      | 49,202    | 31,150.00  | 1,532,642,300.00                       |  |
|         | SD BIOSENSOR INC             | 10,000    | 29,200.00  | 292,000,000.00                         |  |
|         | CELLTRION INC                | 44,853    | 164,500.00 | 7,378,318,500.00                       |  |
|         | CELLTRION PHARM INC          | 5,506     | 65,800.00  | 362,294,800.00                         |  |
|         | HANMI PHARM CO LTD           | 2,437     | 259,000.00 | 631,183,000.00                         |  |
|         | SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD     | 7,653     | 798,000.00 | 6,107,094,000.00                       |  |
|         | SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD | 17,376    | 74,400.00  | 1,292,774,400.00                       |  |
|         | SK BIOSCIENCE CO LTD         | 8,100     | 75,000.00  | 607,500,000.00                         |  |
|         | YUHAN CORP                   | 22,310    | 53,300.00  | 1,189,123,000.00                       |  |
|         | HANA FINANCIAL GROUP         | 126,465   | 52,400.00  | 6,626,766,000.00                       |  |
|         | INDUSTRIAL BANK OF KOREA     | 100,284   | 10,540.00  | 1,056,993,360.00                       |  |
|         | KAKAObANK CORP               | 64,800    | 28,150.00  | 1,824,120,000.00                       |  |
|         | KB FINANCIAL GROUP INC       | 164,525   | 58,500.00  | 9,624,712,500.00                       |  |
|         | SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD  | 204,018   | 44,050.00  | 8,986,992,900.00                       |  |
|         | WOORI FINANCIAL GROUP INC    | 233,224   | 12,890.00  | 3,006,257,360.00                       |  |
|         | KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO | 14,802    | 62,600.00  | 926,605,200.00                         |  |
|         | MERITZ SECURITIES CO LTD     | 108,063   | 6,800.00   | 734,828,400.00                         |  |
|         | MIRAE ASSET SECURITIES CO LT | 119,622   | 6,870.00   | 821,803,140.00                         |  |
|         | NH INVESTMENT & SECURITIES C | 60,045    | 9,400.00   | 564,423,000.00                         |  |
|         | SAMSUNG SECURITIES CO LTD    | 23,495    | 35,400.00  | 831,723,000.00                         |  |
|         | DB INSURANCE CO LTD          | 20,186    | 67,900.00  | 1,370,629,400.00                       |  |
|         | MERITZ FIRE & MARINE INSURAN | 12,500    | 54,300.00  | 678,750,000.00                         |  |
|         | SAMSUNG FIRE & MARINE INS    | 12,265    | 206,000.00 | 2,526,590,000.00                       |  |
|         | SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT | 39,812    | 71,300.00  | 2,838,595,600.00                       |  |
|         | SAMSUNG SDS CO LTD           | 14,353    | 127,200.00 | 1,825,701,600.00                       |  |
|         | ILJIN MATERIALS CO LTD       | 6,354     | 61,000.00  | 387,594,000.00                         |  |
|         | L&F CO LTD                   | 9,393     | 191,500.00 | 1,798,759,500.00                       |  |
|         | LG DISPLAY CO LTD            | 85,443    | 13,240.00  | 1,131,265,320.00                       |  |
|         | LG INNOTEK CO LTD            | 7,648     | 281,000.00 | 2,149,088,000.00                       |  |
|         | SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO | 25,952    | 150,800.00 | 3,913,561,600.00                       |  |
|         | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD   | 2,039,544 | 63,400.00  | 129,307,089,600.00                     |  |
|         | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF     | 353,242   | 56,800.00  | 20,064,145,600.00                      |  |
|         | SAMSUNG SDI CO LTD           | 24,143    | 649,000.00 | 15,668,807,000.00                      |  |
|         | LG UPLUS CORP                | 93,715    | 11,220.00  | 1,051,482,300.00                       |  |
|         | KOREA ELECTRIC POWER CORP    | 103,604   | 20,250.00  | 2,097,981,000.00                       |  |
|         | SK HYNIX INC                 | 235,432   | 91,400.00  | 21,518,484,800.00                      |  |
|         | SK SQUARE CO LTD             | 39,940    | 36,750.00  | 1,467,795,000.00                       |  |
|         | 韓国ウォン 小計                     | 6,712,651 |            | 429,306,330,860.00<br>(45,120,095,373) |  |
| ニュー台湾ドル | FORMOSA PETROCHEMICAL CORP   | 459,150   | 83.10      | 38,155,365.00                          |  |

|                              |           |          |                |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| ASIA CEMENT CORP             | 919,281   | 42.65    | 39,207,334.65  |
| CHINA STEEL CORP             | 5,014,947 | 31.20    | 156,466,346.40 |
| FORMOSA CHEMICALS & FIBRE    | 1,413,430 | 72.60    | 102,615,018.00 |
| FORMOSA PLASTICS CORP        | 1,764,600 | 88.60    | 156,343,560.00 |
| NAN YA PLASTICS CORP         | 2,126,557 | 75.00    | 159,491,775.00 |
| TAIWAN CEMENT                | 2,603,696 | 36.00    | 93,733,056.00  |
| AIRTAC INTERNATIONAL GROUP   | 56,000    | 999.00   | 55,944,000.00  |
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORP | 1,246,138 | 32.35    | 40,312,564.30  |
| VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY   | 26,000    | 1,525.00 | 39,650,000.00  |
| WALSIN LIHWA CORP            | 1,314,000 | 47.70    | 62,677,800.00  |
| CHINA AIRLINES LTD           | 1,131,000 | 18.95    | 21,432,450.00  |
| EVA AIRWAYS CORP             | 1,061,000 | 28.40    | 30,132,400.00  |
| EVERGREEN MARINE CORP LTD    | 418,353   | 152.50   | 63,798,832.50  |
| TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP  | 746,000   | 29.10    | 21,708,600.00  |
| WAN HAI LINES LTD            | 241,845   | 73.60    | 17,799,792.00  |
| YANG MING MARINE TRANSPORT   | 694,000   | 62.00    | 43,028,000.00  |
| CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD | 668,413   | 34.50    | 23,060,248.50  |
| ECLAT TEXTILE COMPANY LTD    | 80,728    | 491.50   | 39,677,812.00  |
| FENG TAY ENTERPRISE CO LTD   | 180,981   | 207.00   | 37,463,067.00  |
| GIANT MANUFACTURING          | 152,000   | 213.00   | 32,376,000.00  |
| NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD  | 78,000    | 321.00   | 25,038,000.00  |
| POU CHEN                     | 1,066,500 | 34.30    | 36,580,950.00  |
| HOTAI MOTOR COMPANY LTD      | 116,000   | 626.00   | 72,616,000.00  |
| MOMO.COM INC                 | 21,600    | 798.00   | 17,236,800.00  |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP   | 224,000   | 271.50   | 60,816,000.00  |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 2,076,624 | 67.90    | 141,002,769.60 |
| PHARMAESSENTIA CORP          | 80,000    | 476.50   | 38,120,000.00  |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK    | 1,796,671 | 17.60    | 31,621,409.60  |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT | 7,422,955 | 23.20    | 172,212,556.00 |
| E.SUN FINANCIAL HOLDING CO   | 5,456,236 | 24.15    | 131,768,099.40 |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO   | 4,719,164 | 26.75    | 126,237,637.00 |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C | 3,477,109 | 22.95    | 79,799,651.55  |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT | 4,953,047 | 32.00    | 158,497,504.00 |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS   | 4,876,888 | 17.75    | 86,564,762.00  |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDING    | 4,556,995 | 15.80    | 72,000,521.00  |
| TAIWAN BUSINESS BANK         | 2,977,000 | 13.45    | 40,040,650.00  |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL | 4,158,355 | 26.70    | 111,028,078.50 |
| THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA | 1,665,000 | 47.10    | 78,421,500.00  |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD     | 604,270   | 230.00   | 138,982,100.00 |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO  | 3,986,219 | 22.70    | 90,487,171.30  |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO  | 3,645,366 | 42.00    | 153,105,372.00 |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL  | 6,416,255 | 13.05    | 83,732,127.75  |

|                              |            |          |                  |
|------------------------------|------------|----------|------------------|
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO   | 3,136,959  | 59.80    | 187,590,148.20   |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING  | 5,808,852  | 8.97     | 52,105,402.44    |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD   | 961,268    | 43.90    | 42,199,665.20    |
| ACCTON TECHNOLOGY CORP       | 193,000    | 252.50   | 48,732,500.00    |
| ACER INC                     | 1,115,168  | 24.50    | 27,321,616.00    |
| ADVANTECH CO LTD             | 213,134    | 338.00   | 72,039,292.00    |
| ASUSTEK COMPUTER INC         | 297,774    | 268.00   | 79,803,432.00    |
| AUO CORP                     | 3,377,800  | 15.85    | 53,538,130.00    |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD    | 239,000    | 175.00   | 41,825,000.00    |
| COMPAL ELECTRONICS           | 2,006,775  | 22.85    | 45,854,808.75    |
| DELTA ELECTRONICS INC        | 812,220    | 286.00   | 232,294,920.00   |
| E INK HOLDINGS INC           | 383,000    | 176.00   | 67,408,000.00    |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY   | 5,349,272  | 98.10    | 524,763,583.20   |
| INNOLUX CORP                 | 3,960,381  | 11.45    | 45,346,362.45    |
| INVENTEC CORP                | 1,291,429  | 25.70    | 33,189,725.30    |
| LARGAN PRECISION CO LTD      | 39,820     | 2,075.00 | 82,626,500.00    |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP      | 1,029,160  | 65.70    | 67,615,812.00    |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO  | 345,000    | 127.50   | 43,987,500.00    |
| NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD | 82,000     | 234.50   | 19,229,000.00    |
| PEGATRON CORP                | 917,976    | 64.70    | 59,393,047.20    |
| QUANTA COMPUTER INC          | 1,114,150  | 75.00    | 83,561,250.00    |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP  | 483,193    | 60.20    | 29,088,218.60    |
| UNIMICRON TECHNOLOGY CORP    | 509,000    | 127.00   | 64,643,000.00    |
| WIWYNN CORP                  | 42,000     | 785.00   | 32,970,000.00    |
| WPG HOLDINGS LTD             | 658,168    | 47.50    | 31,262,980.00    |
| YAGEO CORPORATION            | 160,738    | 519.00   | 83,423,022.00    |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING | 270,000    | 107.00   | 28,890,000.00    |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD      | 1,652,000  | 114.00   | 188,328,000.00   |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD  | 580,000    | 66.70    | 38,686,000.00    |
| TAIWAN MOBILE CO LTD         | 682,400    | 95.20    | 64,964,480.00    |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT | 1,482,294  | 101.50   | 150,452,841.00   |
| EEMORY TECHNOLOGY INC        | 29,000     | 1,500.00 | 43,500,000.00    |
| GLOBALWAFERS CO LTD          | 81,000     | 493.00   | 39,933,000.00    |
| MEDIATEK INC                 | 659,236    | 693.00   | 456,850,548.00   |
| NANYA TECHNOLOGY CORP        | 432,000    | 57.70    | 24,926,400.00    |
| NOVATEK MICROELECTRONICS COR | 257,000    | 348.00   | 89,436,000.00    |
| PARADE TECHNOLOGIES LTD      | 47,000     | 893.00   | 41,971,000.00    |
| POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU | 1,236,000  | 32.30    | 39,922,800.00    |
| REALTEK SEMICONDUCTOR CORP   | 210,703    | 316.50   | 66,687,499.50    |
| SILERGY CORP                 | 132,000    | 526.00   | 69,432,000.00    |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 10,550,000 | 503.00   | 5,306,650,000.00 |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP | 5,023,000  | 45.95    | 230,806,850.00   |

|        |                              |             |           |                                       |  |
|--------|------------------------------|-------------|-----------|---------------------------------------|--|
|        | VANGUARD INTERNATIONAL SEMI  | 374,000     | 92.00     | 34,408,000.00                         |  |
|        | WIN SEMICONDUCTORS CORP      | 127,000     | 180.00    | 22,860,000.00                         |  |
|        | WINBOND ELECTRONICS CORP     | 1,082,000   | 21.00     | 22,722,000.00                         |  |
|        | ニュー台湾ドル 小計                   | 146,126,243 |           | 12,334,224,014.89<br>(52,500,624,519) |  |
| インドルピー | BHARAT PETROLEUM CORP LTD    | 361,468     | 346.75    | 125,339,029.00                        |  |
|        | COAL INDIA LTD               | 645,260     | 226.15    | 145,925,549.00                        |  |
|        | HINDUSTAN PETROLEUM CORP     | 281,412     | 248.05    | 69,804,246.60                         |  |
|        | INDIAN OIL CORP LTD          | 1,200,931   | 82.50     | 99,076,807.50                         |  |
|        | OIL & NATURAL GAS CORP LTD   | 1,031,742   | 152.45    | 157,289,067.90                        |  |
|        | PETRONET LNG LTD             | 330,086     | 225.25    | 74,351,871.50                         |  |
|        | RELIANCE INDUSTRIES LTD      | 1,300,298   | 2,382.55  | 3,098,024,999.90                      |  |
|        | ACC LTD                      | 29,062      | 2,165.70  | 62,939,573.40                         |  |
|        | AMBUJA CEMENTS LTD           | 287,173     | 460.20    | 132,157,014.60                        |  |
|        | ASIAN PAINTS LTD             | 168,006     | 2,775.00  | 466,216,650.00                        |  |
|        | BERGER PAINTS INDIA LTD      | 102,972     | 548.75    | 56,505,885.00                         |  |
|        | GRASIM INDUSTRIES LTD        | 112,199     | 1,593.75  | 178,817,156.25                        |  |
|        | HINDALCO INDUSTRIES LTD      | 632,730     | 489.10    | 309,468,243.00                        |  |
|        | JINDAL STEEL & POWER LTD     | 179,644     | 595.35    | 106,951,055.40                        |  |
|        | JSW STEEL LTD                | 289,822     | 724.65    | 210,019,512.30                        |  |
|        | PI INDUSTRIES LTD            | 30,631      | 2,974.15  | 91,101,188.65                         |  |
|        | PIDILITE INDUSTRIES LTD      | 61,549      | 2,315.30  | 142,504,399.70                        |  |
|        | SHREE CEMENT LTD             | 4,303       | 22,146.80 | 95,297,680.40                         |  |
|        | SRF LTD                      | 59,800      | 2,128.35  | 127,275,330.00                        |  |
|        | TATA STEEL LTD               | 3,191,999   | 121.00    | 386,231,879.00                        |  |
|        | ULTRATECH CEMENT LTD         | 46,568      | 6,705.10  | 312,243,096.80                        |  |
|        | UPL LTD                      | 202,028     | 737.95    | 149,086,562.60                        |  |
|        | VEDANTA LTD                  | 364,582     | 326.25    | 118,944,877.50                        |  |
|        | ABB INDIA LTD                | 24,900      | 2,873.35  | 71,546,415.00                         |  |
|        | ADANI ENTERPRISES LTD        | 128,506     | 3,388.95  | 435,500,408.70                        |  |
|        | BHARAT ELECTRONICS LTD       | 1,669,456   | 99.15     | 165,526,562.40                        |  |
|        | HAVELLS INDIA LTD            | 103,125     | 1,180.50  | 121,739,062.50                        |  |
|        | LARSEN & TOUBRO LTD          | 292,194     | 2,174.70  | 635,434,291.80                        |  |
|        | SIEMENS LTD                  | 29,493      | 2,995.30  | 88,340,382.90                         |  |
|        | INDIAN RAILWAY CATERING & TO | 91,600      | 627.55    | 57,483,580.00                         |  |
|        | ADANI PORTS AND SPECIAL ECON | 211,622     | 713.15    | 150,918,229.30                        |  |
|        | CONTAINER CORP OF INDIA LTD  | 103,994     | 649.60    | 67,554,502.40                         |  |
|        | INTERGLOBE AVIATION LTD      | 39,111      | 2,109.25  | 82,494,876.75                         |  |
|        | BAJAJ AUTO LTD               | 30,404      | 3,717.40  | 113,023,829.60                        |  |
|        | BALKRISHNA INDUSTRIES LTD    | 38,519      | 2,239.85  | 86,276,782.15                         |  |
|        | BHARAT FORGE LTD             | 117,494     | 862.65    | 101,356,199.10                        |  |
|        | EICHER MOTORS LTD            | 55,810      | 3,213.85  | 179,364,968.50                        |  |

|                              |           |           |                  |
|------------------------------|-----------|-----------|------------------|
| HERO MOTOCORP LTD            | 50,721    | 2,785.00  | 141,257,985.00   |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD      | 361,059   | 1,311.50  | 473,528,878.50   |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD      | 50,595    | 8,784.10  | 444,431,539.50   |
| MRF LTD                      | 969       | 89,571.75 | 86,795,025.75    |
| SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN | 685,401   | 72.65     | 49,794,382.65    |
| TATA MOTORS LTD              | 767,605   | 419.05    | 321,664,875.25   |
| TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT | 45,400    | 2,570.15  | 116,684,810.00   |
| TVS MOTOR CO LTD             | 98,759    | 1,037.90  | 102,501,966.10   |
| PAGE INDUSTRIES LTD          | 2,494     | 39,854.90 | 99,398,120.60    |
| TITAN CO LTD                 | 151,271   | 2,356.60  | 356,485,238.60   |
| INDIAN HOTELS CO LTD         | 372,300   | 291.45    | 108,506,835.00   |
| JUBILANT FOODWORKS LTD       | 184,460   | 493.85    | 91,095,571.00    |
| INFO EDGE INDIA LTD          | 37,381    | 3,668.25  | 137,122,853.25   |
| TRENT LTD                    | 68,216    | 1,212.10  | 82,684,613.60    |
| ZOMATO LTD                   | 1,745,700 | 47.75     | 83,357,175.00    |
| AVENUE SUPERMARTS LTD        | 74,427    | 3,515.10  | 261,618,347.70   |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD     | 44,379    | 4,388.15  | 194,741,708.85   |
| ITC LTD                      | 1,324,450 | 339.25    | 449,319,662.50   |
| MARICO LTD                   | 250,392   | 505.40    | 126,548,116.80   |
| NESTLE INDIA LTD             | 13,370    | 19,235.50 | 257,178,635.00   |
| TATA CONSUMER PRODUCTS LTD   | 215,604   | 740.05    | 159,557,740.20   |
| UNITED SPIRITS LTD           | 139,825   | 768.55    | 107,462,503.75   |
| VARUN BEVERAGES LTD          | 100,994   | 1,239.65  | 125,197,212.10   |
| COLGATE PALMOLIVE (INDIA)    | 49,765    | 1,451.20  | 72,218,968.00    |
| DABUR INDIA LTD              | 242,335   | 563.30    | 136,507,305.50   |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 175,156   | 914.20    | 160,127,615.20   |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD       | 343,681   | 2,622.35  | 901,251,870.35   |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE  | 40,157    | 4,224.35  | 169,637,222.95   |
| AUROBINDO PHARMA LTD         | 104,437   | 417.75    | 43,628,556.75    |
| BIOCON LTD                   | 147,697   | 235.20    | 34,738,334.40    |
| CIPLA LTD                    | 201,691   | 1,035.25  | 208,800,607.75   |
| DIVI'S LABORATORIES LTD      | 54,059    | 3,335.70  | 180,324,606.30   |
| DR. REDDY'S LABORATORIES     | 55,825    | 4,200.95  | 234,518,033.75   |
| LUPIN LTD                    | 81,026    | 747.20    | 60,542,627.20    |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS     | 419,017   | 1,040.05  | 435,798,630.85   |
| TORRENT PHARMACEUTICALS LTD  | 44,978    | 1,556.75  | 70,019,501.50    |
| AU SMALL FINANCE BANK LTD    | 80,800    | 615.90    | 49,764,720.00    |
| AXIS BANK LTD                | 991,764   | 892.35    | 885,000,605.40   |
| BANDHAN BANK LTD             | 266,045   | 244.95    | 65,167,722.75    |
| ICICI BANK LTD               | 2,179,817 | 855.30    | 1,864,397,480.10 |
| KOTAK MAHINDRA BANK LTD      | 244,225   | 1,749.80  | 427,344,905.00   |
| STATE BANK OF INDIA          | 745,040   | 568.70    | 423,704,248.00   |



|        |                              |            |          |                                       |  |
|--------|------------------------------|------------|----------|---------------------------------------|--|
|        | YES BANK LTD                 | 4,242,068  | 17.90    | 75,933,017.20                         |  |
|        | BAJAJ FINANCE LTD            | 120,222    | 5,795.90 | 696,794,689.80                        |  |
|        | BAJAJ FINSERV LTD            | 179,095    | 1,314.35 | 235,393,513.25                        |  |
|        | BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN | 11,900     | 5,742.65 | 68,337,535.00                         |  |
|        | CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND | 151,200    | 718.40   | 108,622,080.00                        |  |
|        | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE  | 734,245    | 2,710.60 | 1,990,244,497.00                      |  |
|        | MUTHOOT FINANCE LTD          | 48,400     | 1,040.05 | 50,338,420.00                         |  |
|        | SBI CARDS & PAYMENT SERVICES | 84,000     | 715.10   | 60,068,400.00                         |  |
|        | SHRIRAM FINANCE LTD          | 96,620     | 1,254.20 | 121,180,804.00                        |  |
|        | HDFC LIFE INSURANCE CO LTD   | 391,109    | 585.05   | 228,818,320.45                        |  |
|        | ICICI LOMBARD GENERAL INSURA | 94,410     | 1,136.95 | 107,339,449.50                        |  |
|        | ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA | 141,318    | 464.15   | 65,592,749.70                         |  |
|        | SBI LIFE INSURANCE CO LTD    | 179,514    | 1,257.45 | 225,729,879.30                        |  |
|        | DLF LTD                      | 228,304    | 352.05   | 80,374,423.20                         |  |
|        | GODREJ PROPERTIES LTD        | 51,331     | 1,196.35 | 61,409,841.85                         |  |
|        | HCL TECHNOLOGIES LTD         | 456,890    | 1,122.75 | 512,973,247.50                        |  |
|        | INFOSYS LTD                  | 1,434,786  | 1,543.00 | 2,213,874,798.00                      |  |
|        | LTIMINDTREE LTD              | 37,310     | 4,430.65 | 165,307,551.50                        |  |
|        | MPHASIS LTD                  | 51,526     | 2,070.00 | 106,658,820.00                        |  |
|        | TATA CONSULTANCY SVCS LTD    | 391,025    | 3,429.75 | 1,341,117,993.75                      |  |
|        | TATA ELXSI LTD               | 13,000     | 6,597.20 | 85,763,600.00                         |  |
|        | TECH MAHINDRA LTD            | 273,157    | 1,051.15 | 287,128,980.55                        |  |
|        | WIPRO LTD                    | 546,840    | 401.55   | 219,583,602.00                        |  |
|        | BHARTI AIRTEL LTD            | 962,619    | 776.50   | 747,473,653.50                        |  |
|        | INDUS TOWERS LTD             | 270,878    | 157.90   | 42,771,636.20                         |  |
|        | ADANI GREEN ENERGY LTD       | 130,888    | 1,857.80 | 243,163,726.40                        |  |
|        | ADANI POWER LTD              | 283,920    | 261.00   | 74,103,120.00                         |  |
|        | ADANI TOTAL GAS LTD          | 123,984    | 3,660.00 | 453,781,440.00                        |  |
|        | ADANI TRANSMISSION LTD       | 112,086    | 2,517.75 | 282,204,526.50                        |  |
|        | GAIL INDIA LTD               | 830,025    | 100.90   | 83,749,522.50                         |  |
|        | INDRAPRASTHA GAS LTD         | 135,251    | 413.15   | 55,878,950.65                         |  |
|        | NTPC LTD                     | 1,645,606  | 165.90   | 273,006,035.40                        |  |
|        | POWER GRID CORP OF INDIA LTD | 1,468,872  | 219.40   | 322,270,516.80                        |  |
|        | TATA POWER CO LTD            | 561,689    | 201.45   | 113,152,249.05                        |  |
|        | インドルピー 小計                    | 43,587,868 |          | 31,672,700,716.10<br>(50,676,321,145) |  |
| チェココルナ | KOMERCNI BANKA AS            | 32,083     | 710.00   | 22,778,930.00                         |  |
|        | MONETA MONEY BANK AS         | 145,308    | 78.70    | 11,435,739.60                         |  |
|        | CEZ AS                       | 67,416     | 875.50   | 59,022,708.00                         |  |
|        | チェココルナ 小計                    | 244,807    |          | 93,237,377.60<br>(553,307,893)        |  |
|        | AGILITY                      | 535,846    | 0.59     | 320,435.90                            |  |

|               |                              |            |           |                   |                 |
|---------------|------------------------------|------------|-----------|-------------------|-----------------|
| クウェートディナール    | BOUBAYAN BANK K.S.C          | 574,856    | 0.80      | 464,483.64        |                 |
|               | GULF BANK                    | 816,898    | 0.31      | 259,773.56        |                 |
|               | KUWAIT FINANCE HOUSE         | 3,286,291  | 0.83      | 2,740,766.69      |                 |
|               | NATIONAL BANK OF KUWAIT      | 3,006,405  | 1.11      | 3,352,141.57      |                 |
|               | MABANEE CO KPSC              | 197,406    | 0.83      | 164,834.01        |                 |
|               | MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO | 1,118,010  | 0.56      | 629,439.63        |                 |
| クウェートディナール 小計 |                              | 9,535,712  |           | 7,931,875.00      | (3,368,429,356) |
| コロンビアペソ       | BANCOLOMBIA SA               | 84,654     | 42,080.00 | 3,562,240,320.00  |                 |
|               | BANCOLOMBIA SA-PREF          | 190,643    | 34,200.00 | 6,519,990,600.00  |                 |
|               | INTERCONEXION ELECTRICA SA   | 241,634    | 20,980.00 | 5,069,481,320.00  |                 |
| コロンビアペソ 小計    |                              | 516,931    |           | 15,151,712,240.00 | (431,626,826)   |
| ハンガリーフォリント    | MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL | 136,418    | 2,670.00  | 364,236,060.00    |                 |
|               | RICHTER GEDEON NYRT          | 65,222     | 8,300.00  | 541,342,600.00    |                 |
|               | OTP BANK PLC                 | 101,228    | 11,250.00 | 1,138,815,000.00  |                 |
| ハンガリーフォリント 小計 |                              | 302,868    |           | 2,044,393,660.00  | (746,471,501)   |
| アラブディルハム      | MULTIPLY GROUP               | 1,427,401  | 4.70      | 6,708,784.70      |                 |
|               | Q HOLDING PJSC               | 866,439    | 3.76      | 3,257,810.64      |                 |
|               | ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO | 1,323,475  | 4.50      | 5,955,637.50      |                 |
|               | ABU DHABI COMMERCIAL BANK    | 1,229,769  | 8.87      | 10,908,051.03     |                 |
|               | ABU DHABI ISLAMIC BANK       | 703,542    | 9.18      | 6,458,515.56      |                 |
|               | DUBAI ISLAMIC BANK           | 1,437,129  | 5.66      | 8,134,150.14      |                 |
|               | FIRST ABU DHABI BANK PJSC    | 1,867,479  | 15.52     | 28,983,274.08     |                 |
|               | ALDAR PROPERTIES PJSC        | 1,767,691  | 4.51      | 7,972,286.41      |                 |
|               | EMAAR PROPERTIES PJSC        | 2,013,969  | 5.87      | 11,821,998.03     |                 |
|               | EMIRATES TELECOM GROUP CO    | 1,436,867  | 25.66     | 36,870,007.22     |                 |
| アラブディルハム 小計   |                              | 14,073,761 |           | 127,070,515.31    | (4,479,235,664) |
| ポーランドズロチ      | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN | 296,514    | 64.36     | 19,083,641.04     |                 |
|               | KGHM POLSKA MIEDZ SA         | 57,355     | 148.15    | 8,497,143.25      |                 |
|               | LPP SA                       | 460        | 10,380.00 | 4,774,800.00      |                 |
|               | CD PROJEKT SA                | 39,305     | 131.52    | 5,169,393.60      |                 |
|               | CYFROWY POLSAT SA            | 84,090     | 18.79     | 1,580,051.10      |                 |
|               | ALLEGRO.EU SA                | 145,456    | 29.07     | 4,228,405.92      |                 |
|               | PEPCO GROUP NV               | 65,200     | 40.36     | 2,631,472.00      |                 |
|               | DINO POLSKA SA               | 19,370     | 375.40    | 7,271,498.00      |                 |
|               | BANK PEKAO SA                | 84,233     | 91.90     | 7,741,012.70      |                 |
|               | MBANK SA                     | 5,779      | 313.40    | 1,811,138.60      |                 |
|               | PKO BANK POLSKI SA           | 400,856    | 32.62     | 13,075,922.72     |                 |
|               | SANTANDER BANK POLSKA SA     | 13,971     | 282.00    | 3,939,822.00      |                 |

|          |                              |            |          |                                      |  |
|----------|------------------------------|------------|----------|--------------------------------------|--|
|          | POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE | 230,064    | 36.28    | 8,346,721.92                         |  |
|          | PGE SA                       | 258,050    | 7.44     | 1,920,408.10                         |  |
|          | ポーランドズロチ 小計                  | 1,700,703  |          | 90,071,430.95<br>(2,695,036,292)     |  |
| 南アフリカランド | EXXARO RESOURCES LTD         | 101,347    | 219.50   | 22,245,666.50                        |  |
|          | AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD | 64,622     | 294.41   | 19,025,363.02                        |  |
|          | ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD  | 22,359     | 1,311.24 | 29,318,015.16                        |  |
|          | ANGLOGOLD ASHANTI LTD        | 165,877    | 375.70   | 62,319,988.90                        |  |
|          | GOLD FIELDS LTD              | 401,399    | 207.80   | 83,410,712.20                        |  |
|          | HARMONY GOLD MINING CO LTD   | 193,027    | 65.21    | 12,587,290.67                        |  |
|          | IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 377,694    | 213.96   | 80,811,408.24                        |  |
|          | KUMBA IRON ORE LTD           | 23,695     | 502.05   | 11,896,074.75                        |  |
|          | NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT | 166,313    | 183.55   | 30,526,751.15                        |  |
|          | SASOL LTD                    | 258,360    | 317.13   | 81,933,706.80                        |  |
|          | SIBANYE STILLWATER LTD       | 1,121,622  | 47.03    | 52,749,882.66                        |  |
|          | BIDVEST GROUP LTD            | 116,525    | 223.40   | 26,031,685.00                        |  |
|          | MULTICHOICE GROUP LTD        | 209,009    | 119.00   | 24,872,071.00                        |  |
|          | MR PRICE GROUP LTD           | 101,919    | 159.51   | 16,257,099.69                        |  |
|          | NASPERS LTD-N SHS            | 93,328     | 3,378.66 | 315,323,580.48                       |  |
|          | PEPKOR HOLDINGS LTD          | 512,188    | 20.51    | 10,504,975.88                        |  |
|          | THE FOSCHINI GROUP LTD       | 131,787    | 106.87   | 14,084,076.69                        |  |
|          | WOOLWORTHS HOLDINGS LTD      | 403,060    | 76.20    | 30,713,172.00                        |  |
|          | BID CORP LTD                 | 137,607    | 358.32   | 49,307,340.24                        |  |
|          | CLICKS GROUP LTD             | 93,821     | 266.70   | 25,022,060.70                        |  |
|          | SHOPRITE HOLDINGS LTD        | 205,466    | 247.92   | 50,939,130.72                        |  |
|          | SPAR GROUP LIMITED/THE       | 85,961     | 135.60   | 11,656,311.60                        |  |
|          | ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 157,183    | 142.68   | 22,426,870.44                        |  |
|          | ABSA GROUP LTD               | 385,108    | 200.14   | 77,075,515.12                        |  |
|          | CAPITEC BANK HOLDINGS LTD    | 37,261     | 1,843.57 | 68,693,261.77                        |  |
|          | NEDBANK GROUP LTD            | 221,373    | 223.39   | 49,452,514.47                        |  |
|          | STANDARD BANK GROUP LTD      | 569,145    | 171.56   | 97,642,516.20                        |  |
|          | FIRSTRAND LTD                | 2,143,772  | 64.17    | 137,565,849.24                       |  |
|          | REINET INVESTMENTS SCA       | 47,485     | 327.38   | 15,545,639.30                        |  |
|          | REMGRO LTD                   | 232,196    | 143.68   | 33,361,921.28                        |  |
|          | DISCOVERY LTD                | 213,552    | 135.49   | 28,934,160.48                        |  |
|          | OLD MUTUAL LTD               | 1,698,336  | 11.40    | 19,361,030.40                        |  |
|          | SANLAM LTD                   | 756,539    | 54.34    | 41,110,329.26                        |  |
|          | NEPI ROCKCASTLE N.V.         | 207,413    | 107.07   | 22,207,709.91                        |  |
|          | MTN GROUP LTD                | 721,919    | 138.79   | 100,195,138.01                       |  |
|          | VODACOM GROUP LTD            | 268,705    | 122.55   | 32,929,797.75                        |  |
|          | 南アフリカランド 小計                  | 12,646,973 |          | 1,808,038,617.68<br>(13,650,691,563) |  |

|        |                              |         |        |              |  |
|--------|------------------------------|---------|--------|--------------|--|
| オフショア元 | CHINA MERCHANTS ENERGY -A    | 176,500 | 6.34   | 1,119,010.00 |  |
|        | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A | 724,325 | 4.54   | 3,288,435.50 |  |
|        | CHINA SHENHUA ENERGY CO-A    | 155,628 | 28.71  | 4,468,079.88 |  |
|        | COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A | 26,000  | 14.32  | 372,320.00   |  |
|        | GUANGHUI ENERGY CO LTD-A     | 235,000 | 10.56  | 2,481,600.00 |  |
|        | OFFSHORE OIL ENGINEERING-A   | 42,000  | 6.73   | 282,660.00   |  |
|        | PETROCHINA CO LTD-A          | 932,100 | 5.19   | 4,837,599.00 |  |
|        | SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A | 201,900 | 20.02  | 4,042,038.00 |  |
|        | SHANXI COKING COAL ENERGY-A  | 38,870  | 11.98  | 465,662.60   |  |
|        | SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A | 28,400  | 20.83  | 591,572.00   |  |
|        | YANKUANG ENERGY GROUP CO-A   | 100,055 | 36.19  | 3,620,990.45 |  |
|        | YANTAI JEREH OILFIELD-A      | 9,100   | 32.27  | 293,657.00   |  |
|        | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A | 350,000 | 5.20   | 1,820,000.00 |  |
|        | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A  | 79,700  | 29.48  | 2,349,556.00 |  |
|        | BAOSHAN IRON & STEEL CO-A    | 435,096 | 6.13   | 2,667,138.48 |  |
|        | BBMG CORPORATION-A           | 79,100  | 2.49   | 196,959.00   |  |
|        | CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A  | 27,200  | 41.94  | 1,140,768.00 |  |
|        | CHINA JUSHI CO LTD -A        | 110,447 | 14.75  | 1,629,093.25 |  |
|        | CHINA NORTHERN RARE EARTH -A | 68,500  | 28.71  | 1,966,635.00 |  |
|        | CHINA RARE EARTH RESOURCES-A | 32,500  | 38.51  | 1,251,575.00 |  |
|        | CMOC GROUP LTD-A             | 515,101 | 5.13   | 2,642,468.13 |  |
|        | CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A | 9,100   | 76.19  | 693,329.00   |  |
|        | GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A | 102,531 | 78.20  | 8,017,924.20 |  |
|        | GEM CO LTD-A                 | 131,700 | 7.88   | 1,037,796.00 |  |
|        | GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A | 39,780  | 47.58  | 1,892,732.40 |  |
|        | HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A  | 257,100 | 16.90  | 4,344,990.00 |  |
|        | HENGYI PETROCHEMICAL CO -A   | 35,148  | 7.39   | 259,743.72   |  |
|        | HESTEEL CO LTD-A             | 100,800 | 2.38   | 239,904.00   |  |
|        | HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A | 9,600   | 90.60  | 869,760.00   |  |
|        | HUAFON CHEMICAL CO LTD -A    | 106,636 | 7.58   | 808,300.88   |  |
|        | HUAXIN CEMENT CO LTD-A       | 12,900  | 16.05  | 207,045.00   |  |
|        | HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A | 38,600  | 31.65  | 1,221,690.00 |  |
|        | HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A  | 185,200 | 4.94   | 914,888.00   |  |
|        | INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A  | 951,300 | 2.01   | 1,912,113.00 |  |
|        | INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A | 80,316  | 4.43   | 355,799.88   |  |
|        | JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A | 72,300  | 14.68  | 1,061,364.00 |  |
|        | JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A | 2,900   | 105.30 | 305,370.00   |  |
|        | JIANGXI COPPER CO LTD-A      | 99,100  | 19.60  | 1,942,360.00 |  |
|        | LB GROUP CO LTD-A            | 59,600  | 20.29  | 1,209,284.00 |  |
|        | NINGBO SHANSHAN CO LTD-A     | 41,100  | 19.20  | 789,120.00   |  |
|        | NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A | 116,800 | 13.30  | 1,553,440.00 |  |
|        | PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A | 81,700  | 5.07   | 414,219.00   |  |
|        |                              |         |        |              |  |

|                              |         |        |              |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A | 118,300 | 25.02  | 2,959,866.00 |
| RONGSHENG PETROCHEMICAL CO-A | 191,671 | 12.72  | 2,438,055.12 |
| SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A  | 84,740  | 17.79  | 1,507,524.60 |
| SHANDONG GOLD MINING CO LT-A | 90,424  | 20.00  | 1,808,480.00 |
| SHANDONG HUALU HENGSHENG-A   | 49,850  | 34.52  | 1,720,822.00 |
| SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A  | 336,100 | 3.59   | 1,206,599.00 |
| SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A | 24,600  | 11.36  | 279,456.00   |
| SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A | 24,080  | 54.31  | 1,307,784.80 |
| SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A | 145,500 | 9.41   | 1,369,155.00 |
| SHANXI TAIGANG STAINLESS-A   | 145,000 | 4.57   | 662,650.00   |
| SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A | 20,880  | 48.35  | 1,009,548.00 |
| SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A  | 11,900  | 253.40 | 3,015,460.00 |
| SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A | 17,980  | 23.64  | 425,047.20   |
| SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL-A   | 12,000  | 25.38  | 304,560.00   |
| SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A | 47,100  | 23.63  | 1,112,973.00 |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A  | 58,100  | 3.25   | 188,825.00   |
| SKSHU PAINT CO LTD-A         | 9,660   | 124.48 | 1,202,476.80 |
| SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TE-A | 15,800  | 62.95  | 994,610.00   |
| TIANQI LITHIUM CORP-A        | 32,200  | 93.98  | 3,026,156.00 |
| TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A | 100,000 | 8.91   | 891,000.00   |
| TONGKUN GROUP CO LTD-A       | 60,900  | 15.36  | 935,424.00   |
| TONGLING NONFERROUS METALS-A | 510,800 | 3.52   | 1,798,016.00 |
| WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A  | 87,500  | 94.92  | 8,305,500.00 |
| WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A | 4,900   | 68.80  | 337,120.00   |
| WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A | 16,600  | 94.72  | 1,572,352.00 |
| XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A     | 13,400  | 21.46  | 287,564.00   |
| YINTAI GOLD CO LTD-A         | 26,460  | 12.61  | 333,660.60   |
| YONGXING SPECIAL MATERIALS-A | 11,200  | 110.31 | 1,235,472.00 |
| YOUNGY CO LTD-A              | 10,000  | 114.24 | 1,142,400.00 |
| YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A | 34,651  | 149.93 | 5,195,224.43 |
| YUNNAN YUNTIANHUA CO-A       | 40,000  | 22.34  | 893,600.00   |
| ZANGGE MINING CO LTD-A       | 34,400  | 28.00  | 963,200.00   |
| ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A | 28,015  | 65.00  | 1,820,975.00 |
| ZHEJIANG JUHUA CO-A          | 26,100  | 16.27  | 424,647.00   |
| ZHEJIANG YONGTAI TECH-A      | 25,300  | 23.37  | 591,261.00   |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A  | 822,400 | 11.91  | 9,794,784.00 |
| AECC AERO-ENGINE CONTROL-A   | 78,931  | 24.68  | 1,948,017.08 |
| AECC AVIATION POWER CO-A     | 79,200  | 43.80  | 3,468,960.00 |
| AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A  | 181,400 | 10.56  | 1,915,584.00 |
| AVICOPTER PLC-A              | 37,400  | 45.55  | 1,703,570.00 |
| BEIJING EASPRING MATERIAL-A  | 14,200  | 64.38  | 914,196.00   |
| BEIJING NEW BUILDING MATER-A | 16,100  | 28.62  | 460,782.00   |

|                              |           |        |               |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| BEIJING UNITED INFORMATION-A | 17,255    | 97.68  | 1,685,468.40  |
| CHINA BAOAN GROUP-A          | 49,260    | 12.27  | 604,420.20    |
| CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A    | 73,000    | 23.66  | 1,727,180.00  |
| CHINA ENERGY ENGINEERING C-A | 543,500   | 2.35   | 1,277,225.00  |
| CHINA NATIONAL CHEMICAL-A    | 98,000    | 8.61   | 843,780.00    |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-A    | 870,900   | 5.77   | 5,025,093.00  |
| CHINA STATE CONSTRUCTION -A  | 1,305,480 | 5.57   | 7,271,523.60  |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A | 64,708    | 452.00 | 29,248,016.00 |
| CRRC CORP LTD-A              | 410,000   | 5.30   | 2,173,000.00  |
| DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A | 144,760   | 21.42  | 3,100,759.20  |
| EVE ENERGY CO LTD-A          | 67,288    | 84.87  | 5,710,732.56  |
| FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A | 36,143    | 6.43   | 232,399.49    |
| GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A | 9,750     | 174.56 | 1,701,960.00  |
| GOTION HIGH-TECH CO LTD-A    | 35,700    | 31.79  | 1,134,903.00  |
| GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A | 7,800     | 103.29 | 805,662.00    |
| HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A   | 9,940     | 37.57  | 373,445.80    |
| JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A | 26,032    | 68.16  | 1,774,341.12  |
| JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A | 103,700   | 15.46  | 1,603,202.00  |
| KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A  | 47,400    | 18.15  | 860,310.00    |
| METALLURGICAL CORP OF CHIN-A | 527,534   | 3.38   | 1,783,064.92  |
| MING YANG SMART ENERGY GRO-A | 47,900    | 27.30  | 1,307,670.00  |
| NARI TECHNOLOGY CO LTD-A     | 227,008   | 26.79  | 6,081,544.32  |
| NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A | 4,000     | 327.15 | 1,308,600.00  |
| NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A | 24,000    | 64.20  | 1,540,800.00  |
| NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A | 8,300     | 76.34  | 633,622.00    |
| NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A | 49,900    | 20.92  | 1,043,908.00  |
| POWER CONSTRUCTION CORP OF-A | 293,400   | 7.04   | 2,065,536.00  |
| PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A  | 3,400     | 298.00 | 1,013,200.00  |
| SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A | 340,616   | 17.27  | 5,882,438.32  |
| SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A | 84,500    | 2.63   | 222,235.00    |
| SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A | 407,700   | 4.07   | 1,659,339.00  |
| SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A | 91,551    | 71.11  | 6,510,191.61  |
| SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A  | 132,600   | 11.54  | 1,530,204.00  |
| SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A    | 12,000    | 44.16  | 529,920.00    |
| SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A | 38,400    | 128.55 | 4,936,320.00  |
| SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A  | 37,600    | 22.90  | 861,040.00    |
| SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A | 3,520     | 445.54 | 1,568,300.80  |
| TBEA CO LTD-A                | 81,400    | 21.24  | 1,728,936.00  |
| TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A   | 12,000    | 16.10  | 193,200.00    |
| WEICHAI POWER CO LTD-A       | 103,651   | 11.07  | 1,147,416.57  |
| WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A | 9,240     | 113.68 | 1,050,403.20  |
| XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A   | 363,600   | 5.66   | 2,057,976.00  |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| XIAMEN C & D INC-A           | 26,900  | 13.29  | 357,501.00    |
| XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A | 129,800 | 11.51  | 1,493,998.00  |
| ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A   | 36,000  | 33.11  | 1,191,960.00  |
| ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A | 4,620   | 50.87  | 235,019.40    |
| ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY-A | 12,000  | 47.41  | 568,920.00    |
| ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A | 15,000  | 23.42  | 351,300.00    |
| ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A | 90,500  | 12.56  | 1,136,680.00  |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A  | 143,900 | 5.84   | 840,376.00    |
| BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A | 336,637 | 4.80   | 1,615,857.60  |
| SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A | 8,800   | 57.26  | 503,888.00    |
| ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A | 58,110  | 19.55  | 1,136,050.50  |
| AIR CHINA LTD-A              | 142,600 | 10.76  | 1,534,376.00  |
| CHINA EASTERN AIRLINES CO-A  | 547,400 | 5.44   | 2,977,856.00  |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A | 205,800 | 7.85   | 1,615,530.00  |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A | 269,330 | 10.42  | 2,806,418.60  |
| DAQIN RAILWAY CO LTD -A      | 874,000 | 6.70   | 5,855,800.00  |
| S F HOLDING CO LTD-A         | 142,200 | 60.37  | 8,584,614.00  |
| SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A | 38,100  | 61.99  | 2,361,819.00  |
| SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A | 139,900 | 5.32   | 744,268.00    |
| YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A   | 75,200  | 21.33  | 1,604,016.00  |
| YUNDA HOLDING CO LTD-A       | 78,060  | 13.39  | 1,045,223.40  |
| BYD CO LTD -A                | 48,000  | 270.07 | 12,963,360.00 |
| CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A | 2,600   | 129.09 | 335,634.00    |
| CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A  | 151,190 | 13.54  | 2,047,112.60  |
| FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A   | 73,700  | 8.00   | 589,600.00    |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A | 46,838  | 37.15  | 1,740,031.70  |
| GREAT WALL MOTOR CO LTD-A    | 164,354 | 30.40  | 4,996,361.60  |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A | 348,900 | 11.53  | 4,022,817.00  |
| HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A  | 68,200  | 17.88  | 1,219,416.00  |
| HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A | 12,000  | 123.91 | 1,486,920.00  |
| NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A  | 12,360  | 15.28  | 188,860.80    |
| NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A  | 51,300  | 64.83  | 3,325,779.00  |
| SAIC MOTOR CORP LTD-A        | 159,244 | 14.84  | 2,363,180.96  |
| SAILUN GROUP CO LTD-A        | 107,100 | 10.14  | 1,085,994.00  |
| SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A | 11,400  | 22.36  | 254,904.00    |
| SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A | 8,700   | 139.12 | 1,210,344.00  |
| ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A    | 11,400  | 87.25  | 994,650.00    |
| GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A | 199,753 | 35.05  | 7,001,342.65  |
| HAIER SMART HOME CO LTD-A    | 208,929 | 26.39  | 5,513,636.31  |
| HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A  | 9,000   | 30.92  | 278,280.00    |
| JASON FURNITURE HANGZHOU C-A | 16,120  | 43.80  | 706,056.00    |
| OPPEIN HOME GROUP INC-A      | 12,917  | 128.62 | 1,661,384.54  |

|                              |         |          |               |  |
|------------------------------|---------|----------|---------------|--|
| TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A  | 310,000 | 4.12     | 1,277,200.00  |  |
| ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A     | 5,200   | 52.65    | 273,780.00    |  |
| SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A | 27,000  | 57.77    | 1,559,790.00  |  |
| SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A  | 268,100 | 5.51     | 1,477,231.00  |  |
| SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A | 24,843  | 15.13    | 375,874.59    |  |
| 37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A | 75,300  | 21.19    | 1,595,607.00  |  |
| BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A | 27,900  | 9.31     | 259,749.00    |  |
| FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A | 280,502 | 7.00     | 1,963,514.00  |  |
| G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A  | 700     | 359.50   | 251,650.00    |  |
| MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A | 25,280  | 32.08    | 810,982.40    |  |
| PERFECT WORLD CO LTD-A       | 18,300  | 14.27    | 261,141.00    |  |
| ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A  | 126,520 | 3.97     | 502,284.40    |  |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A | 48,899  | 230.50   | 11,271,219.50 |  |
| SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A | 30,800  | 7.92     | 243,936.00    |  |
| WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A  | 48,200  | 4.81     | 231,842.00    |  |
| DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A | 16,420  | 39.57    | 649,739.40    |  |
| YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A | 6,552   | 58.74    | 384,864.48    |  |
| ANGEL YEAST CO LTD-A         | 7,800   | 43.00    | 335,400.00    |  |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A | 10,200  | 288.95   | 2,947,290.00  |  |
| ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A | 5,625   | 56.92    | 320,175.00    |  |
| ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A | 21,800  | 69.03    | 1,504,854.00  |  |
| ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A   | 5,900   | 162.28   | 957,452.00    |  |
| BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A | 40,300  | 9.10     | 366,730.00    |  |
| CHONGQING BREWERY CO-A       | 4,600   | 123.97   | 570,262.00    |  |
| CHONGQING FULING ZHACAI-A    | 7,500   | 26.32    | 197,400.00    |  |
| FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A | 91,778  | 79.74    | 7,318,377.72  |  |
| FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A  | 9,800   | 23.11    | 226,478.00    |  |
| GUANGDONG HAID GROUP CO-A    | 25,019  | 62.84    | 1,572,193.96  |  |
| HEILONGJIANG AGRICULTURE-A   | 118,600 | 14.10    | 1,672,260.00  |  |
| HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A | 87,500  | 25.60    | 2,240,000.00  |  |
| INNER MONGOLIA YILI INDUS-A  | 161,700 | 32.33    | 5,227,761.00  |  |
| JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A | 32,590  | 57.41    | 1,870,991.90  |  |
| JIANGSU YANGHE BREWERY -A    | 44,981  | 183.11   | 8,236,470.91  |  |
| JIUGUI LIQUOR CO LTD-A       | 3,600   | 139.20   | 501,120.00    |  |
| JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A | 7,600   | 38.20    | 290,320.00    |  |
| JUEWEI FOOD CO LTD-A         | 5,500   | 53.82    | 296,010.00    |  |
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A     | 31,782  | 1,860.01 | 59,114,837.82 |  |
| LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A      | 37,800  | 247.80   | 9,366,840.00  |  |
| MUYUAN FOODS CO LTD-A        | 190,980 | 48.10    | 9,186,138.00  |  |
| NEW HOPE LIUHE CO LTD-A      | 59,400  | 12.86    | 763,884.00    |  |
| SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A | 24,705  | 37.23    | 919,767.15    |  |
| SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A | 27,760  | 296.40   | 8,228,064.00  |  |



|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A    | 12,600  | 82.77  | 1,042,902.00  |
| TOLY BREAD CO LTD-A          | 10,192  | 16.10  | 164,091.20    |
| TONGWEI CO LTD-A             | 109,600 | 41.93  | 4,595,528.00  |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-A    | 40,761  | 105.16 | 4,286,426.76  |
| WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A | 261,140 | 20.66  | 5,395,152.40  |
| WULIANGYE YIBIN CO LTD-A     | 93,900  | 208.72 | 19,598,808.00 |
| YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A | 23,700  | 45.39  | 1,075,743.00  |
| YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A | 12,500  | 17.17  | 214,625.00    |
| BY-HEALTH CO LTD-A           | 15,000  | 24.05  | 360,750.00    |
| PROYA COSMETICS CO LTD-A     | 6,300   | 165.81 | 1,044,603.00  |
| YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A | 9,700   | 138.99 | 1,348,203.00  |
| AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A | 212,910 | 33.76  | 7,187,841.60  |
| GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A  | 128,900 | 30.34  | 3,910,826.00  |
| GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A | 4,400   | 86.66  | 381,304.00    |
| HUADONG MEDICINE CO LTD-A    | 57,140  | 48.91  | 2,794,717.40  |
| JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A   | 7,600   | 34.36  | 261,136.00    |
| JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A  | 64,300  | 31.65  | 2,035,095.00  |
| JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A    | 17,800  | 13.66  | 243,148.00    |
| LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A    | 95,160  | 23.68  | 2,253,388.80  |
| MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A | 35,560  | 6.62   | 235,407.20    |
| OVCTEK CHINA INC-A           | 17,260  | 37.65  | 649,839.00    |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A   | 183,900 | 18.74  | 3,446,286.00  |
| SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A | 38,300  | 341.05 | 13,062,215.00 |
| SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A | 10,000  | 55.90  | 559,000.00    |
| TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A | 7,000   | 169.42 | 1,185,940.00  |
| APELOA PHARMACEUTICAL CO-A   | 15,000  | 24.96  | 374,400.00    |
| ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A | 3,640   | 169.00 | 615,160.00    |
| BEIJING TONGRENTANG CO-A     | 29,900  | 46.98  | 1,404,702.00  |
| BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A  | 9,860   | 135.80 | 1,338,988.00  |
| BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A | 3,800   | 61.40  | 233,320.00    |
| BGI GENOMICS CO LTD-A        | 17,000  | 54.57  | 927,690.00    |
| CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A  | 8,700   | 208.60 | 1,814,820.00  |
| CHINA RESOURCES SANJIU MED-A | 9,300   | 49.22  | 457,746.00    |
| CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A | 60,198  | 104.58 | 6,295,506.84  |
| DAAN GENE CO LTD-A           | 19,360  | 15.88  | 307,436.80    |
| DONG-E-E-JIAOCO LTD-A        | 6,200   | 44.04  | 273,048.00    |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A | 7,089   | 123.38 | 874,640.82    |
| HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A | 54,190  | 23.20  | 1,257,208.00  |
| HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A | 29,900  | 27.45  | 820,755.00    |
| IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A | 8,100   | 611.90 | 4,956,390.00  |
| JIANGSU HENGRUI PHARMACEUT-A | 234,143 | 43.54  | 10,194,586.22 |
| JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A | 18,400  | 12.01  | 220,984.00    |

|                               |           |        |               |
|-------------------------------|-----------|--------|---------------|
| JOINN LABORATORIES CHINA C-A  | 14,840    | 66.43  | 985,821.20    |
| LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A  | 5,800     | 34.51  | 200,158.00    |
| NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A  | 12,522    | 19.47  | 243,803.34    |
| PHARMARON BEIJING CO LTD-A    | 18,750    | 82.70  | 1,550,625.00  |
| SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A  | 10,780    | 21.23  | 228,859.40    |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A  | 48,600    | 36.31  | 1,764,666.00  |
| SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A  | 24,600    | 63.59  | 1,564,314.00  |
| SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A  | 240,500   | 6.39   | 1,536,795.00  |
| SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A  | 15,425    | 37.47  | 577,974.75    |
| SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A     | 8,200     | 37.05  | 303,810.00    |
| SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A   | 16,100    | 28.90  | 465,290.00    |
| SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A  | 13,600    | 27.81  | 378,216.00    |
| WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A     | 32,480    | 40.81  | 1,325,508.80  |
| WUXI APPTec CO LTD-A          | 116,211   | 97.50  | 11,330,572.50 |
| YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A  | 80,260    | 58.25  | 4,675,145.00  |
| ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A   | 19,300    | 317.77 | 6,132,961.00  |
| ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A  | 13,860    | 22.18  | 307,414.80    |
| ZHEJIANG JIUIZHOU PHARMACEU-A | 25,700    | 46.03  | 1,182,971.00  |
| ZHEJIANG NHU CO LTD-A         | 85,176    | 19.52  | 1,662,635.52  |
| ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A  | 5,000     | 55.47  | 277,350.00    |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A  | 3,906,800 | 2.92   | 11,407,856.00 |
| BANK OF BEIJING CO LTD -A     | 346,600   | 4.27   | 1,479,982.00  |
| BANK OF CHENGDU CO LTD-A      | 34,393    | 14.36  | 493,883.48    |
| BANK OF CHINA LTD-A           | 772,400   | 3.22   | 2,487,128.00  |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-A   | 792,233   | 4.87   | 3,858,174.71  |
| BANK OF HANGZHOU CO LTD-A     | 151,000   | 13.28  | 2,005,280.00  |
| BANK OF JIANGSU CO LTD-A      | 324,350   | 7.52   | 2,439,112.00  |
| BANK OF NANJING CO LTD -A     | 159,900   | 10.66  | 1,704,534.00  |
| BANK OF NINGBO CO LTD -A      | 236,111   | 33.21  | 7,841,246.31  |
| BANK OF SHANGHAI CO LTD-A     | 207,711   | 6.05   | 1,256,651.55  |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-A     | 91,200    | 5.63   | 513,456.00    |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A    | 956,010   | 3.10   | 2,963,631.00  |
| CHINA MERCHANTS BANK-A        | 565,699   | 41.05  | 23,221,943.95 |
| CHINA MINSHENG BANKING-A      | 746,028   | 3.50   | 2,611,098.00  |
| CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A  | 241,200   | 3.01   | 726,012.00    |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A  | 56,500    | 3.60   | 203,400.00    |
| HUAXIA BANK CO LTD-A          | 198,750   | 5.23   | 1,039,462.50  |
| IND & COMM BK OF CHINA-A      | 1,164,728 | 4.33   | 5,043,272.24  |
| INDUSTRIAL BANK CO LTD -A     | 582,874   | 17.96  | 10,468,417.04 |
| PING AN BANK CO LTD-A         | 679,061   | 15.13  | 10,274,192.93 |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A  | 526,500   | 4.90   | 2,579,850.00  |
| SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A  | 884,337   | 7.36   | 6,508,720.32  |

|                              |           |        |               |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A | 749,400   | 5.97   | 4,473,918.00  |
| AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A | 461,900   | 4.94   | 2,281,786.00  |
| CAITONG SECURITIES CO LTD-A  | 960,855   | 7.89   | 7,581,145.95  |
| CHANGJIANG SECURITIES CO L-A | 52,500    | 5.85   | 307,125.00    |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-A | 70,200    | 9.94   | 697,788.00    |
| CHINA GREAT WALL SECURITIE-A | 58,000    | 9.26   | 537,080.00    |
| CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A | 32,692    | 40.03  | 1,308,660.76  |
| CHINA MERCHANTS SECURITIES-A | 159,900   | 14.60  | 2,334,540.00  |
| CITIC SECURITIES CO-A        | 397,445   | 21.67  | 8,612,633.15  |
| CSC FINANCIAL CO LTD-A       | 192,700   | 27.35  | 5,270,345.00  |
| DONGXING SECURITIES CO LT-A  | 26,200    | 8.54   | 223,748.00    |
| EAST MONEY INFORMATION CO-A  | 435,279   | 23.23  | 10,111,531.17 |
| EVERBRIGHT SECURITIE CO -A   | 101,600   | 16.28  | 1,654,048.00  |
| FIRST CAPITAL SECURITIES C-A | 97,100    | 6.09   | 591,339.00    |
| GF SECURITIES CO LTD-A       | 281,900   | 17.80  | 5,017,820.00  |
| GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A | 110,261   | 6.72   | 740,953.92    |
| GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A  | 51,600    | 12.16  | 627,456.00    |
| GUOSEN SECURITIES CO LTD-A   | 73,100    | 9.49   | 693,719.00    |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A | 173,625   | 14.49  | 2,515,826.25  |
| GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A  | 31,900    | 7.19   | 229,361.00    |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-A  | 242,979   | 9.42   | 2,288,862.18  |
| HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A | 13,530    | 118.90 | 1,608,717.00  |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-A   | 115,240   | 13.13  | 1,513,101.20  |
| HUAXI SECURITIES CO LTD-A    | 24,900    | 8.27   | 205,923.00    |
| INDUSTRIAL SECURITIES CO-A   | 180,700   | 6.96   | 1,257,672.00  |
| ORIENT SECURITIES CO LTD-A   | 139,500   | 11.03  | 1,538,685.00  |
| SEALAND SECURITIES CO LTD -A | 40,000    | 3.61   | 144,400.00    |
| SHANXI SECURITIES CO LTD-A   | 26,900    | 6.02   | 161,938.00    |
| SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A  | 1,048,114 | 4.21   | 4,412,559.94  |
| SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A  | 28,500    | 7.23   | 206,055.00    |
| SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A | 53,700    | 4.05   | 217,485.00    |
| WESTERN SECURITIES CO LTD-A  | 247,600   | 6.76   | 1,673,776.00  |
| ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A | 74,000    | 10.80  | 799,200.00    |
| ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A | 132,200   | 7.04   | 930,688.00    |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-A    | 85,400    | 36.10  | 3,082,940.00  |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A | 153,200   | 26.29  | 4,027,628.00  |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A | 31,386    | 33.13  | 1,039,818.18  |
| PICC HOLDING CO-A            | 1,251,900 | 5.30   | 6,635,070.00  |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-A | 290,422   | 52.10  | 15,130,986.20 |
| CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A | 137,922   | 14.45  | 1,992,972.90  |
| CHINA VANKE CO LTD -A        | 194,956   | 18.58  | 3,622,282.48  |
| GEMDALE CORP-A               | 42,900    | 9.95   | 426,855.00    |

|                              |           |        |               |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A | 246,800   | 15.80  | 3,899,440.00  |
| SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A     | 58,700    | 21.62  | 1,269,094.00  |
| SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A  | 160,740   | 12.34  | 1,983,531.60  |
| YOUNGOR GROUP CO-A           | 106,400   | 6.51   | 692,664.00    |
| 360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A | 319,600   | 7.04   | 2,249,984.00  |
| BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A | 17,500    | 294.70 | 5,157,250.00  |
| BEIJING SHIJI INFORMATION -A | 16,464    | 17.25  | 284,004.00    |
| DHC SOFTWARE CO LTD -A       | 281,500   | 6.18   | 1,739,670.00  |
| HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A   | 50,398    | 46.21  | 2,328,891.58  |
| IFLYTEK CO LTD - A           | 48,285    | 37.88  | 1,829,035.80  |
| NAVINFO CO LTD-A             | 18,600    | 11.83  | 220,038.00    |
| SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A   | 8,500     | 153.57 | 1,305,345.00  |
| SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A | 35,230    | 50.30  | 1,772,069.00  |
| THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A | 12,400    | 106.60 | 1,321,840.00  |
| YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A  | 87,015    | 26.08  | 2,269,351.20  |
| AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A | 36,700    | 29.42  | 1,079,714.00  |
| BEIJING YUANLIU HONGYUAN E-A | 8,200     | 104.25 | 854,850.00    |
| BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A | 2,825,200 | 4.03   | 11,385,556.00 |
| CETC CYBERSPACE SECURITY T-A | 26,600    | 34.24  | 910,784.00    |
| CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A | 48,197    | 34.50  | 1,662,796.50  |
| CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A | 164,000   | 11.52  | 1,889,280.00  |
| CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A | 296,998   | 4.84   | 1,437,470.32  |
| CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A | 13,700    | 113.34 | 1,552,758.00  |
| FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A | 222,100   | 9.53   | 2,116,613.00  |
| GOERTEK INC -A               | 71,400    | 18.85  | 1,345,890.00  |
| GRG BANKING EQUIPMENT CO -A  | 166,500   | 10.15  | 1,689,975.00  |
| GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A | 21,800    | 8.68   | 189,224.00    |
| GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A | 8,400     | 63.61  | 534,324.00    |
| HUAGONG TECH CO LTD-A        | 33,500    | 18.70  | 626,450.00    |
| INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A | 54,900    | 23.86  | 1,309,914.00  |
| LENS TECHNOLOGY CO LTD-A     | 109,400   | 11.27  | 1,232,938.00  |
| LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A | 217,700   | 4.97   | 1,081,969.00  |
| LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A | 149,112   | 31.09  | 4,635,892.08  |
| MAXSCEND MICROELECTRONICS -A | 10,752    | 138.55 | 1,489,689.60  |
| NINESTAR CORP-A              | 39,700    | 53.68  | 2,131,096.00  |
| OFILM GROUP CO LTD-A         | 25,700    | 5.06   | 130,042.00    |
| SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A | 21,600    | 16.04  | 346,464.00    |
| SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A    | 4,480     | 77.40  | 346,752.00    |
| SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A | 12,000    | 85.83  | 1,029,960.00  |
| SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A  | 15,300    | 26.45  | 404,685.00    |
| TIANJIN712 COMMUNICATION &-A | 9,000     | 34.77  | 312,930.00    |
| TIANMA MICROELECTRONICS-A    | 111,100   | 9.35   | 1,038,785.00  |

|                              |           |        |               |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| UNISPLENDOUR CORP LTD-A      | 38,248    | 23.76  | 908,772.48    |
| WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A | 25,000    | 59.51  | 1,487,750.00  |
| WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A | 120,794   | 11.51  | 1,390,338.94  |
| WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A | 18,040    | 12.73  | 229,649.20    |
| XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A   | 6,300     | 172.90 | 1,089,270.00  |
| YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A | 22,450    | 62.00  | 1,391,900.00  |
| ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A  | 75,700    | 12.68  | 959,876.00    |
| ZHEJIANG SUPCON TECHNOLOGY-A | 35,500    | 94.81  | 3,365,755.00  |
| ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A   | 5,700     | 28.99  | 165,243.00    |
| ZHUZHOU HONGDA ELECTRONICS-A | 10,000    | 47.15  | 471,500.00    |
| ZTE CORP-A                   | 81,600    | 27.36  | 2,232,576.00  |
| CHINA UNITED NETWORK-A       | 1,185,800 | 5.53   | 6,557,474.00  |
| CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A | 240,000   | 6.02   | 1,444,800.00  |
| CHINA THREE GORGES RENEWAB-A | 661,300   | 5.80   | 3,835,540.00  |
| CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A | 506,540   | 21.03  | 10,652,536.20 |
| ENN NATURAL GAS CO LTD-A     | 73,600    | 18.37  | 1,352,032.00  |
| GD POWER DEVELOPMENT CO -A   | 570,400   | 4.18   | 2,384,272.00  |
| HUADIAN POWER INTL CORP-A    | 64,400    | 5.89   | 379,316.00    |
| HUANENG POWER INTL INC-A     | 157,200   | 7.31   | 1,149,132.00  |
| SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A | 37,560    | 6.11   | 229,491.60    |
| SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A | 180,400   | 12.61  | 2,274,844.00  |
| ADVANCED MICRO-FABRICATION-A | 9,900     | 108.35 | 1,072,665.00  |
| CHINA RESOURCES MICROELECT-A | 21,000    | 56.46  | 1,185,660.00  |
| FLAT GLASS GROUP CO LTD-A    | 101,300   | 37.77  | 3,826,101.00  |
| GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A | 48,300    | 3.11   | 150,213.00    |
| GIGADEVICE SEMICONDUCTO-CL A | 13,556    | 122.63 | 1,662,372.28  |
| HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A | 23,016    | 73.92  | 1,701,342.72  |
| HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A | 33,200    | 35.66  | 1,183,912.00  |
| INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A  | 10,100    | 79.99  | 807,899.00    |
| JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A | 103,200   | 66.00  | 6,811,200.00  |
| JCET GROUP CO LTD-A          | 47,200    | 27.25  | 1,286,200.00  |
| LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A | 207,189   | 47.15  | 9,768,961.35  |
| MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A  | 18,400    | 64.65  | 1,189,560.00  |
| NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A  | 20,900    | 245.69 | 5,134,921.00  |
| SG MICRO CORP-A              | 6,075     | 186.75 | 1,134,506.25  |
| SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A | 8,600     | 118.98 | 1,023,228.00  |
| STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A | 3,500     | 345.42 | 1,208,970.00  |
| TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A | 131,600   | 41.65  | 5,481,140.00  |
| TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A | 201,300   | 8.91   | 1,793,583.00  |
| TONGFU MICROELECTRONIC CO-A  | 29,100    | 18.35  | 533,985.00    |
| TRINA SOLAR CO LTD-A         | 56,200    | 71.00  | 3,990,200.00  |
| UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A | 18,199    | 126.00 | 2,293,074.00  |

|                |                              |            |        |                                      |  |
|----------------|------------------------------|------------|--------|--------------------------------------|--|
|                | WILL SEMICONDUCTOR CO LTD-A  | 55,915     | 96.58  | 5,400,270.70                         |  |
|                | ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A | 29,700     | 66.95  | 1,988,415.00                         |  |
|                | オフショア元 小計                    | 61,948,860 |        | 1,030,950,704.06<br>(19,688,581,070) |  |
| サウジアラビア<br>リアル | RABIGH REFINING AND PETROCHE | 202,319    | 11.20  | 2,265,972.80                         |  |
|                | SAUDI ARABIAN OIL CO         | 1,063,148  | 33.10  | 35,190,198.80                        |  |
|                | ADVANCED PETROCHEMICALS CO   | 57,072     | 48.05  | 2,742,309.60                         |  |
|                | NATIONAL INDUSTRIALIZATION C | 122,759    | 13.06  | 1,603,232.54                         |  |
|                | SABIC AGRI-NUTRIENTS CO      | 98,800     | 140.20 | 13,851,760.00                        |  |
|                | SAHARA INTERNATIONAL PETROCH | 145,670    | 38.00  | 5,535,460.00                         |  |
|                | SAUDI ARABIAN MINING CO      | 383,909    | 73.60  | 28,255,702.40                        |  |
|                | SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP  | 379,746    | 97.40  | 36,987,260.40                        |  |
|                | SAUDI IND INVESTMENT GROUP   | 194,677    | 24.86  | 4,839,670.22                         |  |
|                | SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO | 362,675    | 13.42  | 4,867,098.50                         |  |
|                | YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL | 104,973    | 44.75  | 4,697,541.75                         |  |
|                | SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP | 15,573     | 194.00 | 3,021,162.00                         |  |
|                | JARIR MARKETING CO           | 24,000     | 150.60 | 3,614,400.00                         |  |
|                | NAHDI MEDICAL CO             | 18,802     | 183.60 | 3,452,047.20                         |  |
|                | ALMARAI CO                   | 103,694    | 54.70  | 5,672,061.80                         |  |
|                | SAVOLA                       | 104,437    | 29.60  | 3,091,335.20                         |  |
|                | DALLAH HEALTHCARE CO         | 17,729     | 134.80 | 2,389,869.20                         |  |
|                | DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL | 38,669     | 235.00 | 9,087,215.00                         |  |
|                | MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO | 19,343     | 205.60 | 3,976,920.80                         |  |
|                | AL RAJHI BANK                | 838,054    | 79.80  | 66,876,709.20                        |  |
|                | ALINMA BANK                  | 452,830    | 33.00  | 14,943,390.00                        |  |
|                | ARAB NATIONAL BANK           | 240,739    | 28.10  | 6,764,765.90                         |  |
|                | BANK AL-JAZIRA               | 183,665    | 19.46  | 3,574,120.90                         |  |
|                | BANK ALBILAD                 | 193,355    | 45.10  | 8,720,310.50                         |  |
|                | BANQUE SAUDI FRANSI          | 278,276    | 40.20  | 11,186,695.20                        |  |
|                | RIYAD BANK                   | 554,712    | 32.25  | 17,889,462.00                        |  |
|                | SAUDI BRITISH BANK           | 415,939    | 35.25  | 14,661,849.75                        |  |
|                | SAUDI INVESTMENT BANK/THE    | 205,040    | 17.50  | 3,588,200.00                         |  |
|                | THE SAUDI NATIONAL BANK      | 951,255    | 48.20  | 45,850,491.00                        |  |
|                | SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING  | 16,046     | 171.20 | 2,747,075.20                         |  |
|                | BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE  | 29,457     | 147.40 | 4,341,961.80                         |  |
|                | DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV | 180,939    | 11.84  | 2,142,317.76                         |  |
|                | EMAAR ECONOMIC CITY          | 162,006    | 8.14   | 1,318,728.84                         |  |
|                | ARABIAN INTERNET & COMMUNICA | 10,771     | 242.60 | 2,613,044.60                         |  |
|                | ELM CO                       | 10,228     | 340.40 | 3,481,611.20                         |  |
|                | ETIHAD ETISALAT CO           | 171,916    | 35.95  | 6,180,380.20                         |  |
|                | MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO | 142,448    | 10.54  | 1,501,401.92                         |  |
|                | SAUDI TELECOM CO             | 627,883    | 37.45  | 23,514,218.35                        |  |

|         |                              |           |        |                                    |  |
|---------|------------------------------|-----------|--------|------------------------------------|--|
|         | ACWA POWER CO                | 30,596    | 156.00 | 4,772,976.00                       |  |
|         | SAUDI ELECTRICITY CO         | 336,532   | 23.18  | 7,800,811.76                       |  |
|         | サウジアラビアリアル 小計                | 9,490,682 |        | 429,611,740.29<br>(14,817,308,922) |  |
| トルコリラ   | TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE | 59,228    | 627.00 | 37,135,956.00                      |  |
|         | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | 486,774   | 38.68  | 18,828,418.32                      |  |
|         | HEKTAS TICARET T.A.S         | 473,600   | 33.50  | 15,865,600.00                      |  |
|         | SASA POLYESTER SANAYI        | 189,000   | 104.10 | 19,674,900.00                      |  |
|         | ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI    | 318,713   | 61.65  | 19,648,656.45                      |  |
|         | KOC HOLDING AS               | 330,276   | 80.15  | 26,471,621.40                      |  |
|         | TURK SISE VE CAM FABRIKALARI | 688,169   | 41.96  | 28,875,571.24                      |  |
|         | TURK HAVA YOLLARI AO         | 257,239   | 151.80 | 39,048,880.20                      |  |
|         | FORD OTOMOTIV SANAYI AS      | 24,370    | 506.40 | 12,340,968.00                      |  |
|         | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS    | 164,559   | 136.40 | 22,445,847.60                      |  |
|         | AKBANK T.A.S.                | 1,330,071 | 17.74  | 23,595,459.54                      |  |
|         | HACI OMER SABANCI HOLDING    | 350,000   | 41.18  | 14,413,000.00                      |  |
|         | TURKIYE IS BANKASI-C         | 1,541,777 | 11.61  | 17,900,030.97                      |  |
|         | YAPI VE KREDI BANKASI        | 1,348,324 | 9.72   | 13,105,709.28                      |  |
|         | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS  | 496,142   | 39.94  | 19,815,911.48                      |  |
|         | トルコリラ 小計                     | 8,058,242 |        | 329,166,530.48<br>(2,262,262,814)  |  |
| ユーロ     | MYTILINEOS S.A.              | 65,300    | 22.86  | 1,492,758.00                       |  |
|         | FF GROUP                     | 5,889     | 4.80   | 28,267.20                          |  |
|         | OPAP SA                      | 72,528    | 13.22  | 958,820.16                         |  |
|         | JUMBO SA                     | 66,836    | 16.43  | 1,098,115.48                       |  |
|         | ALPHA SERVICES AND HOLDINGS  | 974,172   | 1.15   | 1,127,117.00                       |  |
|         | EUROBANK ERGASIAS SERVICES A | 1,015,188 | 1.15   | 1,173,557.32                       |  |
|         | NATIONAL BANK OF GREECE      | 201,393   | 4.16   | 837,794.88                         |  |
|         | HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA | 76,208    | 14.60  | 1,112,636.80                       |  |
|         | PUBLIC POWER CORP            | 59,582    | 7.10   | 423,032.20                         |  |
|         | TERNA ENERGY SA              | 32,000    | 20.62  | 659,840.00                         |  |
|         | ユーロ 小計                       | 2,569,096 |        | 8,911,939.04<br>(1,257,385,479)    |  |
| カタールリアル | QATAR FUEL QSC               | 288,993   | 17.85  | 5,158,525.05                       |  |
|         | QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT) | 970,867   | 3.83   | 3,718,420.61                       |  |
|         | MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI | 1,634,477 | 2.23   | 3,657,959.52                       |  |
|         | INDUSTRIES QATAR             | 601,258   | 13.88  | 8,345,461.04                       |  |
|         | COMMERCIAL BANK PSQC         | 1,269,997 | 5.70   | 7,250,412.87                       |  |
|         | MASRAF AL RAYAN              | 2,468,651 | 3.07   | 7,578,758.57                       |  |
|         | QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC  | 429,709   | 10.88  | 4,675,233.92                       |  |
|         | QATAR ISLAMIC BANK           | 680,327   | 20.00  | 13,606,540.00                      |  |
|         | QATAR NATIONAL BANK          | 1,977,286 | 18.60  | 36,777,519.60                      |  |

|            |                              |               |       |                                      |  |
|------------|------------------------------|---------------|-------|--------------------------------------|--|
|            | BARWA REAL ESTATE CO         | 892,615       | 2.98  | 2,659,992.70                         |  |
|            | OORED00 QPSC                 | 397,674       | 9.20  | 3,658,600.80                         |  |
|            | QATAR ELECTRICITY & WATER CO | 266,231       | 17.80 | 4,738,911.80                         |  |
| カタールリアル 小計 |                              | 11,878,085    |       | 101,826,336.48<br>(3,611,780,154)    |  |
| 合 計        |                              | 2,433,014,499 |       | 380,653,382,197<br>(380,653,382,197) |  |

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

## (2)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 通貨           | 種 類  | 銘 柄                         | 口数        | 評価額                            | 備考 |
|--------------|------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----|
| メキシコ<br>ペソ   | 投資証券 | OPERADORA DE SITES MEX- A-1 | 434,300   | 9,502,484.00                   |    |
|              |      | TRUST FIBRA UNO             | 1,521,600 | 39,029,040.00                  |    |
| メキシコペソ合計     |      |                             | 1,955,900 | 48,531,524.00<br>(333,736,731) |    |
| 南アフリ<br>カランド | 投資証券 | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD  | 1,670,736 | 23,657,621.76                  |    |
| 南アフリカランド合計   |      |                             | 1,670,736 | 23,657,621.76<br>(178,615,044) |    |
| 合計           |      |                             |           | 512,351,775<br>(512,351,775)   |    |

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

## 外貨建有価証券の内訳

| 種類         | 銘柄数      | 組入株式<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|------------|----------|--------------|----------------|-------------------------|
| アメリカドル     | 株式 53銘柄  | 100.00%      | —              | 3.14%                   |
| 香港ドル       | 株式 192銘柄 | 100.00%      | —              | 25.72%                  |
| マレーシアリングット | 株式 34銘柄  | 100.00%      | —              | 1.50%                   |
| タイバーツ      | 株式 42銘柄  | 100.00%      | —              | 2.18%                   |
| フィリピンペソ    | 株式 17銘柄  | 100.00%      | —              | 0.75%                   |
| インドネシアルピア  | 株式 22銘柄  | 100.00%      | —              | 1.79%                   |
| メキシコペソ     | 株式 21銘柄  | 96.47%       | —              | 2.39%                   |
|            | 投資証券 2銘柄 | —            | 3.53%          | 0.09%                   |
| ブラジルリアル    | 株式 48銘柄  | 100.00%      | —              | 5.21%                   |
| チリペソ       | 株式 12銘柄  | 100.00%      | —              | 0.55%                   |
| 韓国ウォン      | 株式 102銘柄 | 100.00%      | —              | 11.84%                  |



|            |      |       |         |       |        |
|------------|------|-------|---------|-------|--------|
| ニュー台湾ドル    | 株式   | 88銘柄  | 100.00% | —     | 13.77% |
| インドルピー     | 株式   | 113銘柄 | 100.00% | —     | 13.30% |
| チェココルナ     | 株式   | 3銘柄   | 100.00% | —     | 0.15%  |
| クウェートディナール | 株式   | 7銘柄   | 100.00% | —     | 0.88%  |
| コロンビアペソ    | 株式   | 3銘柄   | 100.00% | —     | 0.11%  |
| ハンガリーフォリント | 株式   | 3銘柄   | 100.00% | —     | 0.20%  |
| アラブディルハム   | 株式   | 10銘柄  | 100.00% | —     | 1.18%  |
| ポーランドズロチ   | 株式   | 14銘柄  | 100.00% | —     | 0.71%  |
| 南アフリカランド   | 株式   | 36銘柄  | 98.71%  | —     | 3.58%  |
|            | 投資証券 | 1銘柄   | —       | 1.29% | 0.05%  |
| オフショア元     | 株式   | 422銘柄 | 100.00% | —     | 5.17%  |
| サウジアラビアリヤル | 株式   | 40銘柄  | 100.00% | —     | 3.89%  |
| トルコリラ      | 株式   | 15銘柄  | 100.00% | —     | 0.59%  |
| ユーロ        | 株式   | 10銘柄  | 100.00% | —     | 0.33%  |
| カタールリアル    | 株式   | 12銘柄  | 100.00% | —     | 0.95%  |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

| (単位：円)          |                 |
|-----------------|-----------------|
| [令和 5年 1月26日現在] |                 |
| 資産の部            |                 |
| 流動資産            |                 |
| コール・ローン         | 2,053,655,815   |
| 国債証券            | 565,897,043,750 |
| 地方債証券           | 37,330,326,096  |
| 特殊債券            | 34,577,163,135  |
| 社債券             | 40,402,603,000  |
| 派生商品評価勘定        | 1,458,900       |
| 未収入金            | 780,094,500     |
| 未収利息            | 1,191,507,780   |
| 前払金             | 1,500,000       |
| 前払費用            | 33,533,524      |
| 差入委託証拠金         | 12,240,000      |
| 流動資産合計          | 682,281,126,500 |
| 資産合計            | 682,281,126,500 |
| 負債の部            |                 |
| 流動負債            |                 |
| 派生商品評価勘定        | 2,605,500       |
| 未払金             | 200,000,000     |

| [令和 5年 1月26日現在] |                 |
|-----------------|-----------------|
| 未払解約金           | 589,231,130     |
| 未払利息            | 923             |
| 流動負債合計          | 791,837,553     |
| 負債合計            | 791,837,553     |
| 純資産の部           |                 |
| 元本等             |                 |
| 元本              | 532,608,638,593 |
| 剰余金             |                 |
| 剰余金又は欠損金（△）     | 148,880,650,354 |
| 元本等合計           | 681,489,288,947 |
| 純資産合計           | 681,489,288,947 |
| 負債純資産合計         | 682,281,126,500 |

## 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 5年 1月26日現在]  |
|-------------------------------|------------------|
| 1. 期首                         | 令和 4年 1月27日      |
| 期首元本額                         | 494,247,048,543円 |
| 期中追加設定元本額                     | 136,680,127,492円 |
| 期中一部解約元本額                     | 98,318,537,442円  |
| 元本の内訳※                        |                  |
| 三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）        | 6,710,468,624円   |
| 三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）      | 8,759,552,705円   |
| 三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）        | 2,119,236,078円   |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）   | 52,339,887,773円  |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金） | 87,379,656,527円  |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）   | 25,218,085,849円  |
| 三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）     | 190,117,173円     |
| 三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）        | 164,154,667円     |
| 三菱ＵＦＪ 国内債券インデックスファンド          | 2,123,233,541円   |
| eMAXIS 国内債券インデックス             | 7,601,794,762円   |
| eMAXIS バランス（８資産均等型）           | 3,716,903,467円   |

|                                  | [令和 5年 1月26日現在] |
|----------------------------------|-----------------|
| eMAXIS バランス（波乗り型）                | 472,849,476円    |
| 三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）      | 13,318,821,953円 |
| 三菱UFJ 国内債券インデックスファンド（確定拠出年金）     | 39,072,776,913円 |
| コアバランス                           | 2,357,238円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金） | 8,325,731,486円  |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金） | 3,311,884,033円  |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金） | 1,445,376,901円  |
| eMAXIS Slim 国内債券インデックス           | 13,692,090,992円 |
| 国内債券セレクション（ラップ向け）                | 8,515,387,887円  |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）         | 15,479,626,195円 |
| つみたて8資産均等バランス                    | 7,146,045,062円  |
| つみたて4資産均等バランス                    | 2,454,263,524円  |
| eMAXIS マイマネージャース 1970s           | 13,106,129円     |
| eMAXIS マイマネージャース 1980s           | 8,329,208円      |
| eMAXIS マイマネージャース 1990s           | 229,438円        |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金） | 4,164,780,034円  |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金） | 1,687,370,807円  |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金） | 614,875,432円    |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式15）             | 4,557,060,574円  |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式40）             | 4,281,314,734円  |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式65）             | 2,069,994,433円  |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金） | 430,765,500円    |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式25）             | 822,320,419円    |
| 国内債券インデックスファンド（ラップ向け）            | 1,598,101,729円  |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金） | 161,704,024円    |
| ラップ向けインデックスf 国内債券                | 5,485,008,192円  |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）        | 2,176,441,359円  |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）        | 2,341,733,194円  |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式80）             | 1,710,397円      |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）           | 112,114,045円    |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）         | 150,524,199円    |
| eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）            | 73,455,541円     |
| eMAXIS バランス（4資産均等型）              | 1,092,704,237円  |
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）        | 1,584,239,223円  |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）        | 889,967,040円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）       | 1,860,091,771円  |

|                                         | [令和 5年 1月26日現在]  |
|-----------------------------------------|------------------|
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）                 | 252,497,491円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）                | 32,106,089円      |
| 三菱UFJ 日本債券ファンドVA（適格機関投資家限定）             | 6,767,038,674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）   | 129,273円         |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）           | 26,667,251円      |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）           | 9,306,131,413円   |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）         | 746,163,479円     |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）         | 4,447,606,419円   |
| MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）          | 115,310,049,229円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）         | 455,765,990円     |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）           | 4,286,840円       |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）         | 2,140,383円       |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）           | 4,214,247,019円   |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）           | 2,652,546,795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）   | 3,854,583,062円   |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）              | 404,694,887円     |
| MUKAM 日本債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）        | 11,627,717,204円  |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）     | 3,838,733,836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）              | 2,805,101円       |
| 日本債券インデックスファンドS                         | 1,128,594,650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） | 429,832,474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） | 424,280,144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） | 424,729,389円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01（適格機関投資家限定） | 421,626,267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） | 419,477,595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） | 420,955,442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） | 413,671,752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） | 416,234,104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） | 418,690,273円     |

|                                         | [令和 5年 1月26日現在]  |
|-----------------------------------------|------------------|
| 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） | 416,840,490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） | 462,440,331円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05（適格機関投資家限定） | 469,323,041円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07（適格機関投資家限定） | 477,586,919円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09（適格機関投資家限定） | 478,244,702円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11（適格機関投資家限定） | 481,227,287円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01（適格機関投資家限定） | 490,248,647円     |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA              | 16,989,141円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA            | 24,097,422円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA              | 4,605,951円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA              | 8,079,159円       |
| 三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）              | 20,933,070円      |
| 三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）              | 54,864,834円      |
| 三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）              | 15,774,713円      |
| 三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）              | 46,083,452円      |
| 三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド                | 4,224,478,963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）     | 2,050,408,376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）   | 4,144,942,495円   |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）     | 2,476,838,587円   |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）     | 1,642,384,003円   |
| 合計                                      | 532,608,638,593円 |
| 2. 受益権の総数                               | 532,608,638,593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 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26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 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26日                                                                                                                                                                                                                                          |
|-------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。<br>当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。<br>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。<br>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。                                                                           |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                        | [令和 5年 1月26日現在]                                                                                                                                                                                         |
|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                                  |
| 2.時価の算定方法                 | (1) 有価証券<br>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。<br>(2) デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。<br>(3) 上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価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 5年 1月26日現在]    |
|-------|--------------------|
|       | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 国債証券  | △21,768,855,030    |
| 地方債証券 | △639,756,301       |
| 特殊債券  | △720,496,798       |
| 社債券   | △440,688,000       |
| 合計    | △23,569,796,129    |

(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 5年 1月26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<br>買建 | 885,540,000 | —     | 884,400,000 | △1,140,000 |
| 合計   |              | 885,540,000 | —     | 884,400,000 | △1,140,000 |

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

|              | [令和 5年 1月26日現在] |
|--------------|-----------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.2795円         |
| (1万口当たり純資産額) | (12,795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４３３回利付国債（２年）  | 100,000,000   | 100,065,000   |  |
|      | 第４３４回利付国債（２年）  | 6,100,000,000 | 6,103,660,000 |  |
|      | 第４３５回利付国債（２年）  | 1,400,000,000 | 1,400,812,000 |  |
|      | 第４３７回利付国債（２年）  | 1,800,000,000 | 1,800,954,000 |  |
|      | 第４３８回利付国債（２年）  | 2,100,000,000 | 2,101,029,000 |  |
|      | 第４３９回利付国債（２年）  | 1,800,000,000 | 1,800,810,000 |  |
|      | 第４４０回利付国債（２年）  | 900,000,000   | 900,423,000   |  |
|      | 第４４１回利付国債（２年）  | 3,700,000,000 | 3,701,850,000 |  |
|      | 第４４２回利付国債（２年）  | 2,370,000,000 | 2,371,042,800 |  |
|      | 第４４３回利付国債（２年）  | 1,300,000,000 | 1,300,598,000 |  |
|      | 第１３９回利付国債（５年）  | 2,520,000,000 | 2,524,158,000 |  |
|      | 第１４０回利付国債（５年）  | 3,470,000,000 | 3,476,037,800 |  |
|      | 第１４１回利付国債（５年）  | 5,240,000,000 | 5,250,322,800 |  |
|      | 第１４２回利付国債（５年）  | 310,000,000   | 310,675,800   |  |
|      | 第１４３回利付国債（５年）  | 5,380,000,000 | 5,392,643,000 |  |
|      | 第１４４回利付国債（５年）  | 6,380,000,000 | 6,396,013,800 |  |
|      | 第１４５回利付国債（５年）  | 5,810,000,000 | 5,826,093,700 |  |
|      | 第１４６回利付国債（５年）  | 4,790,000,000 | 4,803,843,100 |  |
|      | 第１４７回利付国債（５年）  | 1,340,000,000 | 1,339,785,600 |  |
|      | 第１４８回利付国債（５年）  | 2,180,000,000 | 2,178,517,600 |  |
|      | 第１４９回利付国債（５年）  | 7,130,000,000 | 7,119,590,200 |  |
|      | 第１５０回利付国債（５年）  | 5,230,000,000 | 5,216,768,100 |  |
|      | 第１５１回利付国債（５年）  | 750,000,000   | 747,060,000   |  |
|      | 第１５２回利付国債（５年）  | 2,830,000,000 | 2,830,000,000 |  |
|      | 第１５３回利付国債（５年）  | 6,040,000,000 | 6,008,290,000 |  |
|      | 第１５４回利付国債（５年）  | 6,480,000,000 | 6,466,521,600 |  |
|      | 第１回利付国債（４０年）   | 675,000,000   | 805,767,750   |  |
|      | 第２回利付国債（４０年）   | 1,035,000,000 | 1,192,320,000 |  |
|      | 第３回利付国債（４０年）   | 718,000,000   | 830,158,780   |  |
|      | 第４回利付国債（４０年）   | 1,218,000,000 | 1,411,856,880 |  |
|      | 第５回利付国債（４０年）   | 575,000,000   | 643,080,000   |  |
|      | 第６回利付国債（４０年）   | 1,230,000,000 | 1,339,064,100 |  |
|      | 第７回利付国債（４０年）   | 1,390,000,000 | 1,444,404,600 |  |
|      | 第８回利付国債（４０年）   | 1,510,000,000 | 1,455,156,800 |  |
|      | 第９回利付国債（４０年）   | 2,770,000,000 | 1,950,800,200 |  |
|      | 第１０回利付国債（４０年）  | 2,370,000,000 | 1,966,768,200 |  |
|      | 第１１回利付国債（４０年）  | 2,200,000,000 | 1,756,678,000 |  |
|      | 第１２回利付国債（４０年）  | 2,040,000,000 | 1,449,766,800 |  |
|      | 第１３回利付国債（４０年）  | 2,320,000,000 | 1,635,878,400 |  |
|      | 第１４回利付国債（４０年）  | 2,410,000,000 | 1,814,561,300 |  |
|      | 第１５回利付国債（４０年）  | 2,300,000,000 | 1,888,300,000 |  |
|      | 第３３３回利付国債（１０年） | 3,540,000,000 | 3,566,089,800 |  |



|                |                |                |  |
|----------------|----------------|----------------|--|
| 第334回利付国債（10年） | 3,990,000,000  | 4,024,752,900  |  |
| 第335回利付国債（10年） | 3,890,000,000  | 3,923,298,400  |  |
| 第336回利付国債（10年） | 2,460,000,000  | 2,484,009,600  |  |
| 第337回利付国債（10年） | 1,620,000,000  | 1,629,671,400  |  |
| 第338回利付国債（10年） | 3,330,000,000  | 3,359,237,400  |  |
| 第339回利付国債（10年） | 4,020,000,000  | 4,058,953,800  |  |
| 第340回利付国債（10年） | 3,470,000,000  | 3,507,198,400  |  |
| 第341回利付国債（10年） | 3,320,000,000  | 3,348,817,600  |  |
| 第342回利付国債（10年） | 2,570,000,000  | 2,577,247,400  |  |
| 第343回利付国債（10年） | 4,870,000,000  | 4,882,369,800  |  |
| 第344回利付国債（10年） | 4,620,000,000  | 4,629,240,000  |  |
| 第345回利付国債（10年） | 6,340,000,000  | 6,347,354,400  |  |
| 第346回利付国債（10年） | 6,130,000,000  | 6,130,000,000  |  |
| 第347回利付国債（10年） | 5,700,000,000  | 5,693,730,000  |  |
| 第348回利付国債（10年） | 4,970,000,000  | 4,959,662,400  |  |
| 第349回利付国債（10年） | 6,090,000,000  | 6,067,771,500  |  |
| 第350回利付国債（10年） | 6,730,000,000  | 6,697,426,800  |  |
| 第351回利付国債（10年） | 4,830,000,000  | 4,801,647,900  |  |
| 第352回利付国債（10年） | 2,950,000,000  | 2,929,438,500  |  |
| 第353回利付国債（10年） | 5,950,000,000  | 5,899,841,500  |  |
| 第354回利付国債（10年） | 5,380,000,000  | 5,326,307,600  |  |
| 第355回利付国債（10年） | 4,810,000,000  | 4,752,616,700  |  |
| 第356回利付国債（10年） | 7,130,000,000  | 7,034,743,200  |  |
| 第357回利付国債（10年） | 5,250,000,000  | 5,172,037,500  |  |
| 第358回利付国債（10年） | 6,280,000,000  | 6,190,007,600  |  |
| 第359回利付国債（10年） | 7,870,000,000  | 7,717,007,200  |  |
| 第360回利付国債（10年） | 5,430,000,000  | 5,309,128,200  |  |
| 第361回利付国債（10年） | 6,050,000,000  | 5,899,778,500  |  |
| 第362回利付国債（10年） | 12,010,000,000 | 11,688,972,700 |  |
| 第363回利付国債（10年） | 13,990,000,000 | 13,593,803,200 |  |
| 第364回利付国債（10年） | 7,890,000,000  | 7,653,773,400  |  |
| 第367回利付国債（10年） | 1,020,000,000  | 1,017,643,800  |  |
| 第368回利付国債（10年） | 630,000,000    | 632,690,100    |  |
| 第1回利付国債（30年）   | 196,000,000    | 228,153,800    |  |
| 第2回利付国債（30年）   | 268,000,000    | 306,833,200    |  |
| 第3回利付国債（30年）   | 307,000,000    | 350,041,400    |  |
| 第4回利付国債（30年）   | 252,000,000    | 300,187,440    |  |
| 第5回利付国債（30年）   | 238,000,000    | 272,124,440    |  |
| 第6回利付国債（30年）   | 339,000,000    | 395,707,920    |  |
| 第7回利付国債（30年）   | 339,000,000    | 394,507,860    |  |
| 第8回利付国債（30年）   | 302,000,000    | 338,110,140    |  |
| 第9回利付国債（30年）   | 206,000,000    | 222,640,680    |  |

|               |               |               |  |
|---------------|---------------|---------------|--|
| 第10回利付国債（30年） | 398,000,000   | 418,222,380   |  |
| 第11回利付国債（30年） | 237,000,000   | 262,892,250   |  |
| 第12回利付国債（30年） | 325,000,000   | 373,782,500   |  |
| 第13回利付国債（30年） | 595,000,000   | 678,109,600   |  |
| 第14回利付国債（30年） | 683,000,000   | 807,599,690   |  |
| 第15回利付国債（30年） | 686,000,000   | 819,330,960   |  |
| 第16回利付国債（30年） | 547,000,000   | 653,730,640   |  |
| 第17回利付国債（30年） | 577,000,000   | 683,589,210   |  |
| 第18回利付国債（30年） | 687,000,000   | 806,847,150   |  |
| 第19回利付国債（30年） | 593,000,000   | 696,442,920   |  |
| 第20回利付国債（30年） | 655,000,000   | 785,587,350   |  |
| 第21回利付国債（30年） | 529,000,000   | 622,119,870   |  |
| 第22回利付国債（30年） | 975,000,000   | 1,171,413,750 |  |
| 第23回利付国債（30年） | 194,000,000   | 233,193,820   |  |
| 第24回利付国債（30年） | 541,000,000   | 650,547,090   |  |
| 第25回利付国債（30年） | 1,287,000,000 | 1,515,146,490 |  |
| 第26回利付国債（30年） | 1,014,000,000 | 1,207,085,880 |  |
| 第27回利付国債（30年） | 460,000,000   | 554,525,400   |  |
| 第28回利付国債（30年） | 1,426,000,000 | 1,718,600,940 |  |
| 第29回利付国債（30年） | 530,000,000   | 630,816,600   |  |
| 第30回利付国債（30年） | 1,421,000,000 | 1,669,618,160 |  |
| 第31回利付国債（30年） | 2,223,000,000 | 2,574,300,690 |  |
| 第32回利付国債（30年） | 1,689,000,000 | 1,978,460,820 |  |
| 第33回利付国債（30年） | 1,227,000,000 | 1,376,963,940 |  |
| 第34回利付国債（30年） | 2,231,000,000 | 2,572,967,680 |  |
| 第35回利付国債（30年） | 2,029,000,000 | 2,276,314,810 |  |
| 第36回利付国債（30年） | 1,929,000,000 | 2,162,486,160 |  |
| 第37回利付国債（30年） | 2,717,000,000 | 3,000,274,420 |  |
| 第38回利付国債（30年） | 1,590,000,000 | 1,725,150,000 |  |
| 第39回利付国債（30年） | 1,360,000,000 | 1,498,788,000 |  |
| 第40回利付国債（30年） | 1,720,000,000 | 1,863,018,000 |  |
| 第41回利付国債（30年） | 1,210,000,000 | 1,287,415,800 |  |
| 第42回利付国債（30年） | 1,520,000,000 | 1,615,471,200 |  |
| 第43回利付国債（30年） | 1,480,000,000 | 1,572,500,000 |  |
| 第44回利付国債（30年） | 1,470,000,000 | 1,560,096,300 |  |
| 第45回利付国債（30年） | 1,480,000,000 | 1,513,670,000 |  |
| 第46回利付国債（30年） | 2,000,000,000 | 2,042,420,000 |  |
| 第47回利付国債（30年） | 1,780,000,000 | 1,848,565,600 |  |
| 第48回利付国債（30年） | 1,870,000,000 | 1,868,391,800 |  |
| 第49回利付国債（30年） | 1,860,000,000 | 1,855,164,000 |  |
| 第50回利付国債（30年） | 2,090,000,000 | 1,835,500,700 |  |
| 第51回利付国債（30年） | 1,920,000,000 | 1,491,302,400 |  |

|               |               |               |  |
|---------------|---------------|---------------|--|
| 第52回利付国債（30年） | 1,750,000,000 | 1,423,397,500 |  |
| 第53回利付国債（30年） | 1,710,000,000 | 1,420,531,200 |  |
| 第54回利付国債（30年） | 1,610,000,000 | 1,399,090,000 |  |
| 第55回利付国債（30年） | 1,730,000,000 | 1,498,993,100 |  |
| 第56回利付国債（30年） | 1,740,000,000 | 1,503,238,200 |  |
| 第57回利付国債（30年） | 1,730,000,000 | 1,490,222,000 |  |
| 第58回利付国債（30年） | 2,450,000,000 | 2,104,231,500 |  |
| 第59回利付国債（30年） | 1,590,000,000 | 1,329,192,300 |  |
| 第60回利付国債（30年） | 1,630,000,000 | 1,427,700,700 |  |
| 第61回利付国債（30年） | 1,660,000,000 | 1,378,879,000 |  |
| 第62回利付国債（30年） | 1,320,000,000 | 1,037,058,000 |  |
| 第63回利付国債（30年） | 1,300,000,000 | 989,378,000   |  |
| 第64回利付国債（30年） | 1,720,000,000 | 1,305,136,000 |  |
| 第65回利付国債（30年） | 1,330,000,000 | 1,009,017,800 |  |
| 第66回利付国債（30年） | 1,210,000,000 | 915,292,400   |  |
| 第67回利付国債（30年） | 3,200,000,000 | 2,551,616,000 |  |
| 第68回利付国債（30年） | 1,710,000,000 | 1,361,348,100 |  |
| 第69回利付国債（30年） | 1,720,000,000 | 1,406,495,600 |  |
| 第70回利付国債（30年） | 2,130,000,000 | 1,737,760,500 |  |
| 第71回利付国債（30年） | 1,860,000,000 | 1,515,397,800 |  |
| 第72回利付国債（30年） | 1,910,000,000 | 1,557,032,000 |  |
| 第73回利付国債（30年） | 1,930,000,000 | 1,569,688,300 |  |
| 第74回利付国債（30年） | 2,230,000,000 | 1,967,975,000 |  |
| 第75回利付国債（30年） | 1,870,000,000 | 1,780,988,000 |  |
| 第76回利付国債（30年） | 2,370,000,000 | 2,309,493,900 |  |
| 第67回利付国債（20年） | 80,000,000    | 81,778,400    |  |
| 第68回利付国債（20年） | 1,041,000,000 | 1,067,712,060 |  |
| 第69回利付国債（20年） | 120,000,000   | 122,941,200   |  |
| 第70回利付国債（20年） | 732,000,000   | 756,756,240   |  |
| 第71回利付国債（20年） | 360,000,000   | 371,170,800   |  |
| 第72回利付国債（20年） | 1,079,000,000 | 1,116,667,890 |  |
| 第73回利付国債（20年） | 520,000,000   | 539,869,200   |  |
| 第74回利付国債（20年） | 698,000,000   | 725,989,800   |  |
| 第75回利付国債（20年） | 705,000,000   | 736,873,050   |  |
| 第76回利付国債（20年） | 410,000,000   | 426,777,200   |  |
| 第77回利付国債（20年） | 370,000,000   | 385,935,900   |  |
| 第78回利付国債（20年） | 310,000,000   | 324,142,200   |  |
| 第79回利付国債（20年） | 150,000,000   | 157,201,500   |  |
| 第80回利付国債（20年） | 585,000,000   | 614,489,850   |  |
| 第81回利付国債（20年） | 250,000,000   | 263,267,500   |  |
| 第82回利付国債（20年） | 1,082,000,000 | 1,142,278,220 |  |
| 第83回利付国債（20年） | 395,000,000   | 419,019,950   |  |

|                |               |               |  |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第84回利付国債（20年）  | 880,000,000   | 930,960,800   |  |
| 第85回利付国債（20年）  | 520,000,000   | 554,138,000   |  |
| 第86回利付国債（20年）  | 1,047,000,000 | 1,122,310,710 |  |
| 第87回利付国債（20年）  | 420,000,000   | 448,891,800   |  |
| 第88回利付国債（20年）  | 1,264,000,000 | 1,361,517,600 |  |
| 第89回利付国債（20年）  | 340,000,000   | 365,078,400   |  |
| 第90回利付国債（20年）  | 1,270,000,000 | 1,369,631,500 |  |
| 第91回利付国債（20年）  | 548,000,000   | 592,985,320   |  |
| 第92回利付国債（20年）  | 1,282,000,000 | 1,383,380,560 |  |
| 第93回利付国債（20年）  | 190,000,000   | 204,934,000   |  |
| 第94回利付国債（20年）  | 875,000,000   | 947,388,750   |  |
| 第95回利付国債（20年）  | 1,107,000,000 | 1,212,486,030 |  |
| 第96回利付国債（20年）  | 340,000,000   | 369,427,000   |  |
| 第97回利付国債（20年）  | 573,000,000   | 627,492,300   |  |
| 第98回利付国債（20年）  | 610,000,000   | 665,192,800   |  |
| 第99回利付国債（20年）  | 1,480,000,000 | 1,618,291,200 |  |
| 第100回利付国債（20年） | 1,030,000,000 | 1,135,719,200 |  |
| 第101回利付国債（20年） | 723,000,000   | 804,576,090   |  |
| 第102回利付国債（20年） | 520,000,000   | 581,053,200   |  |
| 第103回利付国債（20年） | 760,000,000   | 845,173,200   |  |
| 第104回利付国債（20年） | 610,000,000   | 671,854,000   |  |
| 第105回利付国債（20年） | 920,000,000   | 1,016,747,200 |  |
| 第106回利付国債（20年） | 571,000,000   | 634,232,540   |  |
| 第107回利付国債（20年） | 607,000,000   | 672,829,150   |  |
| 第108回利付国債（20年） | 1,000,000,000 | 1,096,820,000 |  |
| 第109回利付国債（20年） | 560,000,000   | 615,893,600   |  |
| 第110回利付国債（20年） | 876,000,000   | 974,033,160   |  |
| 第111回利付国債（20年） | 861,000,000   | 965,146,560   |  |
| 第112回利付国債（20年） | 1,050,000,000 | 1,170,414,000 |  |
| 第113回利付国債（20年） | 922,000,000   | 1,030,814,440 |  |
| 第114回利付国債（20年） | 1,600,000,000 | 1,794,576,000 |  |
| 第115回利付国債（20年） | 944,000,000   | 1,065,171,840 |  |
| 第116回利付国債（20年） | 461,000,000   | 522,248,460   |  |
| 第117回利付国債（20年） | 1,320,000,000 | 1,486,135,200 |  |
| 第118回利付国債（20年） | 520,000,000   | 582,051,600   |  |
| 第119回利付国債（20年） | 400,000,000   | 441,804,000   |  |
| 第120回利付国債（20年） | 780,000,000   | 850,270,200   |  |
| 第121回利付国債（20年） | 1,299,000,000 | 1,445,709,060 |  |
| 第122回利付国債（20年） | 100,000,000   | 110,551,000   |  |
| 第123回利付国債（20年） | 1,318,000,000 | 1,489,498,160 |  |
| 第124回利付国債（20年） | 1,240,000,000 | 1,391,850,400 |  |
| 第125回利付国債（20年） | 1,844,000,000 | 2,104,077,760 |  |

|                |               |               |  |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第126回利付国債（20年） | 200,000,000   | 224,966,000   |  |
| 第127回利付国債（20年） | 440,000,000   | 491,462,400   |  |
| 第128回利付国債（20年） | 1,974,000,000 | 2,209,991,700 |  |
| 第129回利付国債（20年） | 280,000,000   | 311,203,200   |  |
| 第130回利付国債（20年） | 1,862,000,000 | 2,073,783,880 |  |
| 第131回利付国債（20年） | 420,000,000   | 464,272,200   |  |
| 第132回利付国債（20年） | 187,000,000   | 207,081,930   |  |
| 第133回利付国債（20年） | 2,320,000,000 | 2,588,980,800 |  |
| 第134回利付国債（20年） | 4,545,000,000 | 5,079,310,200 |  |
| 第135回利付国債（20年） | 50,000,000    | 55,415,000    |  |
| 第136回利付国債（20年） | 190,000,000   | 208,910,700   |  |
| 第137回利付国債（20年） | 8,382,000,000 | 9,301,170,120 |  |
| 第138回利付国債（20年） | 160,000,000   | 174,590,400   |  |
| 第139回利付国債（20年） | 310,000,000   | 341,207,700   |  |
| 第140回利付国債（20年） | 2,717,000,000 | 3,017,038,310 |  |
| 第141回利付国債（20年） | 1,120,000,000 | 1,243,211,200 |  |
| 第142回利付国債（20年） | 2,460,000,000 | 2,753,748,600 |  |
| 第143回利付国債（20年） | 1,840,000,000 | 2,023,650,400 |  |
| 第144回利付国債（20年） | 1,520,000,000 | 1,657,119,200 |  |
| 第145回利付国債（20年） | 2,460,000,000 | 2,728,755,000 |  |
| 第146回利付国債（20年） | 3,170,000,000 | 3,515,434,900 |  |
| 第147回利付国債（20年） | 3,200,000,000 | 3,512,896,000 |  |
| 第148回利付国債（20年） | 2,710,000,000 | 2,943,195,500 |  |
| 第149回利付国債（20年） | 2,770,000,000 | 3,005,422,300 |  |
| 第150回利付国債（20年） | 3,170,000,000 | 3,399,793,300 |  |
| 第151回利付国債（20年） | 3,420,000,000 | 3,586,109,400 |  |
| 第152回利付国債（20年） | 2,840,000,000 | 2,973,934,400 |  |
| 第153回利付国債（20年） | 3,190,000,000 | 3,371,734,300 |  |
| 第154回利付国債（20年） | 2,890,000,000 | 3,015,830,600 |  |
| 第155回利付国債（20年） | 3,330,000,000 | 3,388,041,900 |  |
| 第156回利付国債（20年） | 2,700,000,000 | 2,541,321,000 |  |
| 第157回利付国債（20年） | 3,360,000,000 | 3,066,000,000 |  |
| 第158回利付国債（20年） | 2,840,000,000 | 2,688,855,200 |  |
| 第159回利付国債（20年） | 2,110,000,000 | 2,018,088,400 |  |
| 第160回利付国債（20年） | 3,070,000,000 | 2,966,909,400 |  |
| 第161回利付国債（20年） | 2,300,000,000 | 2,185,598,000 |  |
| 第162回利付国債（20年） | 3,820,000,000 | 3,617,845,600 |  |
| 第163回利付国債（20年） | 2,840,000,000 | 2,678,801,600 |  |
| 第164回利付国債（20年） | 3,350,000,000 | 3,101,162,000 |  |
| 第165回利付国債（20年） | 2,700,000,000 | 2,488,347,000 |  |
| 第166回利付国債（20年） | 3,170,000,000 | 2,998,724,900 |  |
| 第167回利付国債（20年） | 2,680,000,000 | 2,447,510,000 |  |

|         |                   |                 |                 |  |
|---------|-------------------|-----------------|-----------------|--|
|         | 第168回利付国債（20年）    | 2,630,000,000   | 2,353,429,200   |  |
|         | 第169回利付国債（20年）    | 2,540,000,000   | 2,223,770,000   |  |
|         | 第170回利付国債（20年）    | 1,470,000,000   | 1,280,208,300   |  |
|         | 第171回利付国債（20年）    | 2,310,000,000   | 2,001,060,600   |  |
|         | 第172回利付国債（20年）    | 2,070,000,000   | 1,816,466,400   |  |
|         | 第173回利付国債（20年）    | 2,800,000,000   | 2,445,968,000   |  |
|         | 第174回利付国債（20年）    | 4,000,000,000   | 3,478,240,000   |  |
|         | 第175回利付国債（20年）    | 2,690,000,000   | 2,372,391,700   |  |
|         | 第176回利付国債（20年）    | 2,460,000,000   | 2,161,552,800   |  |
|         | 第177回利付国債（20年）    | 2,770,000,000   | 2,382,227,700   |  |
|         | 第178回利付国債（20年）    | 3,270,000,000   | 2,855,919,900   |  |
|         | 第179回利付国債（20年）    | 2,730,000,000   | 2,377,038,300   |  |
|         | 第180回利付国債（20年）    | 2,430,000,000   | 2,231,784,900   |  |
|         | 第181回利付国債（20年）    | 2,100,000,000   | 1,960,770,000   |  |
|         | 第182回利付国債（20年）    | 3,030,000,000   | 2,928,282,900   |  |
| 国債証券 合計 |                   | 569,789,000,000 | 565,897,043,750 |  |
| 地方債証券   | 第1回東京都公募公債（20年）   | 20,000,000      | 20,121,200      |  |
|         | 第4回東京都公募公債（20年）   | 200,000,000     | 206,946,000     |  |
|         | 第5回東京都公募公債（20年）   | 100,000,000     | 104,286,000     |  |
|         | 第7回東京都公募公債（20年）   | 100,000,000     | 105,412,000     |  |
|         | 第7回東京都公募公債（30年）   | 80,000,000      | 94,640,800      |  |
|         | 第10回東京都公募公債（30年）  | 100,000,000     | 115,128,000     |  |
|         | 第20回東京都公募公債（20年）  | 80,000,000      | 88,383,200      |  |
|         | 第21回東京都公募公債（20年）  | 80,000,000      | 89,133,600      |  |
|         | 第28回東京都公募公債（20年）  | 100,000,000     | 105,966,000     |  |
|         | 第33回東京都公募公債（20年）  | 100,000,000     | 89,404,000      |  |
|         | 第729回東京都公募公債      | 200,000,000     | 201,380,000     |  |
|         | 第730回東京都公募公債      | 100,000,000     | 100,660,000     |  |
|         | 第733回東京都公募公債      | 700,000,000     | 704,648,000     |  |
|         | 第738回東京都公募公債      | 100,000,000     | 100,597,000     |  |
|         | 第757回東京都公募公債      | 150,000,000     | 149,365,500     |  |
|         | 第758回東京都公募公債      | 150,000,000     | 149,365,500     |  |
|         | 第782回東京都公募公債      | 100,000,000     | 99,364,000      |  |
|         | 第809回東京都公募公債      | 100,000,000     | 96,485,000      |  |
|         | 第3回東京都公募公債（20年）   | 400,000,000     | 409,952,000     |  |
|         | 平成26年度第9回北海道公募公債  | 100,000,000     | 100,702,000     |  |
|         | 平成26年度第13回北海道公募公債 | 100,000,000     | 100,660,000     |  |
|         | 平成27年度第1回北海道公募公債  | 300,000,000     | 302,088,000     |  |
|         | 平成27年度第5回北海道公募公債  | 100,000,000     | 101,105,000     |  |
|         | 平成30年度第14回北海道公募公債 | 100,000,000     | 98,814,000      |  |
|         | 第36回2号宮城県公募公債     | 342,000,000     | 330,337,800     |  |
|         | 第2回神奈川県公募公債（20年）  | 680,000,000     | 703,786,400     |  |

|                       |             |             |  |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 第2回神奈川県公募公債（30年）      | 180,000,000 | 220,923,000 |  |
| 第3回神奈川県公募公債（20年）      | 500,000,000 | 523,895,000 |  |
| 第4回神奈川県公募公債（30年）      | 100,000,000 | 120,000,000 |  |
| 第20回神奈川県公募公債（20年）     | 500,000,000 | 548,420,000 |  |
| 第27回神奈川県公募公債（20年）     | 100,000,000 | 105,421,000 |  |
| 第234回神奈川県公募公債         | 100,000,000 | 99,491,000  |  |
| 第243回神奈川県公募公債         | 100,000,000 | 97,263,000  |  |
| 第256回神奈川県公募公債         | 350,000,000 | 338,173,500 |  |
| 第7回大阪府公募公債（20年）       | 220,000,000 | 241,375,200 |  |
| 第11回大阪府公募公債（20年）      | 100,000,000 | 108,822,000 |  |
| 第179回大阪府公募公債（5年）      | 100,000,000 | 99,613,000  |  |
| 第184回大阪府公募公債（5年）      | 120,000,000 | 119,329,200 |  |
| 第191回大阪府公募公債（5年）      | 160,000,000 | 158,608,000 |  |
| 第385回大阪府公募公債          | 200,000,000 | 201,510,000 |  |
| 第388回大阪府公募公債          | 200,000,000 | 201,398,000 |  |
| 第391回大阪府公募公債          | 210,000,000 | 211,570,800 |  |
| 第393回大阪府公募公債          | 110,000,000 | 110,795,300 |  |
| 第400回大阪府公募公債          | 136,000,000 | 137,474,240 |  |
| 第410回大阪府公募公債          | 200,000,000 | 198,822,000 |  |
| 第415回大阪府公募公債          | 100,000,000 | 99,736,000  |  |
| 第417回大阪府公募公債          | 300,000,000 | 300,216,000 |  |
| 第420回大阪府公募公債          | 100,000,000 | 99,635,000  |  |
| 第426回大阪府公募公債          | 100,000,000 | 99,365,000  |  |
| 第435回大阪府公募公債          | 130,000,000 | 128,710,400 |  |
| 第439回大阪府公募公債          | 100,000,000 | 98,803,000  |  |
| 第455回大阪府公募公債          | 148,000,000 | 143,824,920 |  |
| 第460回大阪府公募公債          | 194,000,000 | 187,169,260 |  |
| 第464回大阪府公募公債          | 800,000,000 | 765,552,000 |  |
| 第465回大阪府公募公債          | 500,000,000 | 480,060,000 |  |
| 第467回大阪府公募公債          | 200,000,000 | 192,382,000 |  |
| 第471回大阪府公募公債          | 97,000,000  | 92,343,030  |  |
| 平成26年度第2回京都府公募公債（15年） | 200,000,000 | 207,800,000 |  |
| 平成26年度第5回京都府公募公債（20年） | 100,000,000 | 106,134,000 |  |
| 第1回兵庫県公募公債（12年）       | 100,000,000 | 101,404,000 |  |
| 第1回兵庫県公募公債（15年）       | 400,000,000 | 420,832,000 |  |
| 第2回兵庫県公募公債（20年）       | 300,000,000 | 328,875,000 |  |
| 第2回兵庫県公募公債（30年）       | 90,000,000  | 104,202,000 |  |
| 第5回兵庫県公募公債（12年）       | 100,000,000 | 101,898,000 |  |
| 第5回兵庫県公募公債（15年）       | 200,000,000 | 210,098,000 |  |
| 第6回兵庫県公募公債（15年）       | 100,000,000 | 105,283,000 |  |
| 第9回兵庫県公募公債（15年）       | 500,000,000 | 517,725,000 |  |
| 第27回兵庫県公募公債（20年）      | 200,000,000 | 184,302,000 |  |

|                        |             |             |  |
|------------------------|-------------|-------------|--|
| 平成28年度第29回兵庫県公募公債      | 100,000,000 | 100,072,000 |  |
| 第6回静岡県公募公債（15年）        | 300,000,000 | 311,535,000 |  |
| 第11回静岡県公募公債（20年）       | 550,000,000 | 601,282,000 |  |
| 第14回静岡県公募公債（20年）       | 100,000,000 | 109,951,000 |  |
| 平成26年度第3回静岡県公募公債       | 800,000,000 | 806,152,000 |  |
| 令和2年度第15回静岡県公募公債（5年）   | 120,000,000 | 119,548,800 |  |
| 令和2年度第13回静岡県公募公債（5年）   | 120,000,000 | 119,548,800 |  |
| 平成20年度第8回愛知県公募公債（20年）  | 200,000,000 | 219,024,000 |  |
| 平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）  | 700,000,000 | 780,129,000 |  |
| 平成24年度第14回愛知県公募公債（15年） | 100,000,000 | 104,876,000 |  |
| 平成26年度第7回愛知県公募公債       | 600,000,000 | 604,356,000 |  |
| 平成26年度第15回愛知県公募公債      | 200,000,000 | 201,400,000 |  |
| 平成27年度第7回愛知県公募公債       | 100,000,000 | 101,092,000 |  |
| 平成30年度第5回愛知県公募公債       | 100,000,000 | 99,177,000  |  |
| 平成30年度第8回愛知県公募公債       | 200,000,000 | 198,726,000 |  |
| 令和3年度第18回愛知県公募公債       | 100,000,000 | 96,752,000  |  |
| 平成26年度第7回広島県公募公債       | 260,000,000 | 261,957,800 |  |
| 平成28年度第1回広島県公募公債       | 100,000,000 | 99,784,000  |  |
| 平成28年度第1回広島県公募公債（20年）  | 100,000,000 | 92,014,000  |  |
| 平成30年度第4回広島県公募公債       | 200,000,000 | 198,564,000 |  |
| 令和3年度第7回広島県公募公債        | 100,000,000 | 96,406,000  |  |
| 第10回埼玉県公募公債（20年）       | 100,000,000 | 110,142,000 |  |
| 第14回埼玉県公募公債（20年）       | 200,000,000 | 214,422,000 |  |
| 第16回埼玉県公募公債（20年）       | 100,000,000 | 102,806,000 |  |
| 平成26年度第8回埼玉県公募公債       | 100,000,000 | 100,449,000 |  |
| 平成30年度第4回埼玉県公募公債       | 100,000,000 | 99,231,000  |  |
| 令和2年度第1回埼玉県公募公債        | 100,000,000 | 97,396,000  |  |
| 令和3年度第2回埼玉県公募公債（5年）    | 110,000,000 | 109,558,900 |  |
| 平成19年度第1回福岡県公募公債（30年）  | 70,000,000  | 84,016,100  |  |
| 平成20年度第1回福岡県公募公債（30年）  | 80,000,000  | 92,008,800  |  |
| 平成22年度第2回福岡県公募公債（20年）  | 800,000,000 | 892,784,000 |  |
| 平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）  | 100,000,000 | 104,934,000 |  |
| 平成26年度第8回福岡県公募公債       | 200,000,000 | 201,260,000 |  |
| 平成26年度第1回福岡県公募公債       | 100,000,000 | 100,774,000 |  |
| 平成27年度第7回福岡県公募公債       | 100,000,000 | 100,998,000 |  |
| 令和2年度第4回福岡県公募公債        | 200,000,000 | 193,482,000 |  |
| 第9回千葉県公募公債（20年）        | 80,000,000  | 87,468,000  |  |
| 平成25年度第1回千葉県公募公債       | 82,500,000  | 82,613,850  |  |
| 平成27年度第3回千葉県公募公債       | 200,000,000 | 201,962,000 |  |
| 平成27年度第6回千葉県公募公債       | 500,000,000 | 505,060,000 |  |
| 平成28年度第3回千葉県公募公債       | 400,000,000 | 398,472,000 |  |
| 平成30年度第6回千葉県公募公債       | 100,000,000 | 98,506,000  |  |



|                     |             |             |  |
|---------------------|-------------|-------------|--|
| 令和元年度第6回千葉県公募公債     | 100,000,000 | 97,665,000  |  |
| 平成27年度第2回新潟県公募公債    | 100,000,000 | 100,276,000 |  |
| 令和4年度第1回長野県公募公債     | 300,000,000 | 290,820,000 |  |
| 第2回群馬県公募公債（20年）     | 100,000,000 | 111,206,000 |  |
| 第7回群馬県公募公債（20年）     | 100,000,000 | 91,080,000  |  |
| 平成27年度第1回岐阜県公募公債    | 300,000,000 | 303,207,000 |  |
| 令和2年度第2回岐阜県公募公債（5年） | 100,000,000 | 99,732,000  |  |
| 平成27年度第1回大分県公募公債    | 203,400,000 | 205,421,796 |  |
| 第131回共同発行市場公募地方債    | 100,000,000 | 100,623,000 |  |
| 第132回共同発行市場公募地方債    | 100,000,000 | 100,665,000 |  |
| 第133回共同発行市場公募地方債    | 200,000,000 | 201,488,000 |  |
| 第134回共同発行市場公募地方債    | 250,000,000 | 251,912,500 |  |
| 第135回共同発行市場公募地方債    | 200,000,000 | 201,560,000 |  |
| 第136回共同発行市場公募地方債    | 300,000,000 | 302,253,000 |  |
| 第140回共同発行市場公募地方債    | 200,000,000 | 201,440,000 |  |
| 第142回共同発行市場公募地方債    | 400,000,000 | 401,868,000 |  |
| 第144回共同発行市場公募地方債    | 200,000,000 | 201,550,000 |  |
| 第145回共同発行市場公募地方債    | 100,000,000 | 100,661,000 |  |
| 第151回共同発行市場公募地方債    | 200,000,000 | 201,922,000 |  |
| 第152回共同発行市場公募地方債    | 100,000,000 | 101,075,000 |  |
| 第153回共同発行市場公募地方債    | 100,000,000 | 101,012,000 |  |
| 第158回共同発行市場公募地方債    | 200,000,000 | 199,568,000 |  |
| 第185回共同発行市場公募地方債    | 300,000,000 | 297,927,000 |  |
| 第193回共同発行市場公募地方債    | 100,000,000 | 97,964,000  |  |
| 第198回共同発行市場公募地方債    | 100,000,000 | 97,255,000  |  |
| 第232回共同発行市場公募地方債    | 450,000,000 | 440,455,500 |  |
| 令和元年度第3回堺市公募公債      | 100,000,000 | 97,433,000  |  |
| 平成27年度第1回佐賀県公募公債    | 500,000,000 | 505,105,000 |  |
| 平成29年度第1回佐賀県公募公債    | 100,000,000 | 99,498,000  |  |
| 平成30年度第1回福島県公募公債    | 100,000,000 | 99,308,000  |  |
| 令和元年度第2回栃木県公募公債     | 100,000,000 | 97,385,000  |  |
| 令和2年度第2回栃木県公募公債     | 100,000,000 | 96,520,000  |  |
| 令和3年度第1回熊本県公募公債（5年） | 200,000,000 | 198,918,000 |  |
| 第5回大阪市公募公債（20年）     | 100,000,000 | 111,655,000 |  |
| 第15回大阪市公募公債（20年）    | 100,000,000 | 111,622,000 |  |
| 平成26年度第7回大阪市公募公債    | 100,000,000 | 100,778,000 |  |
| 第1回名古屋市公募公債（30年）    | 100,000,000 | 118,066,000 |  |
| 第9回名古屋市公募公債（20年）    | 100,000,000 | 109,685,000 |  |
| 第9回名古屋市公募公債（30年）    | 90,000,000  | 100,341,900 |  |
| 第28回名古屋市公募公債（5年）    | 500,000,000 | 498,410,000 |  |
| 第491回名古屋市公募公債       | 400,000,000 | 404,544,000 |  |
| 第511回名古屋市公募公債       | 100,000,000 | 97,128,000  |  |

|          |                             |                |                |  |
|----------|-----------------------------|----------------|----------------|--|
|          | 第1回京都市公募公債（15年）             | 100,000,000    | 101,403,000    |  |
|          | 第3回京都市公募公債（20年）             | 100,000,000    | 105,700,000    |  |
|          | 第5回京都市公募公債（20年）             | 50,000,000     | 54,182,500     |  |
|          | 平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）       | 110,000,000    | 118,878,100    |  |
|          | 平成20年度第24回神戸市公募公債（20年）      | 200,000,000    | 219,486,000    |  |
|          | 平成22年度第4回神戸市公募公債            | 100,000,000    | 109,691,000    |  |
|          | 第5回横浜市公募公債（20年）             | 100,000,000    | 104,922,000    |  |
|          | 第7回横浜市公募公債（20年）             | 450,000,000    | 475,258,500    |  |
|          | 平成27年度第2回横浜市公募公債            | 200,000,000    | 202,174,000    |  |
|          | 平成27年度第3回横浜市公募公債            | 400,000,000    | 404,228,000    |  |
|          | 平成27年度第4回横浜市公募公債            | 300,000,000    | 303,036,000    |  |
|          | 第27回横浜市公募公債（20年）            | 100,000,000    | 107,144,000    |  |
|          | 第33回横浜市公募公債（20年）            | 100,000,000    | 91,424,000     |  |
|          | 第35回横浜市公募公債（20年）            | 500,000,000    | 461,010,000    |  |
|          | 第54回横浜市公募公債（5年）             | 300,000,000    | 299,196,000    |  |
|          | 平成22年度第8回札幌市公募公債（30年）       | 80,000,000     | 91,492,800     |  |
|          | 平成23年度第3回札幌市公募公債            | 100,000,000    | 110,544,000    |  |
|          | 令和元年度第2回札幌市公募公債（5年）         | 600,000,000    | 599,202,000    |  |
|          | 令和2年度第7回札幌市公募公債             | 200,000,000    | 192,538,000    |  |
|          | 令和3年度第2回札幌市公募公債（5年）         | 100,000,000    | 99,510,000     |  |
|          | 第7回川崎市公募公債（20年）             | 100,000,000    | 110,213,000    |  |
|          | 第12回川崎市公募公債（20年）            | 100,000,000    | 111,261,000    |  |
|          | 第62回川崎市公募公債（5年）             | 490,000,000    | 487,349,100    |  |
|          | 第17回北九州市公募公債（20年）           | 100,000,000    | 106,773,000    |  |
|          | 平成25年度第4回福岡市公募公債            | 50,000,000     | 50,234,500     |  |
|          | 平成30年度第11回福岡市公募公債（5年）       | 100,000,000    | 99,924,000     |  |
|          | 令和3年度第4回千葉市公募公債             | 100,000,000    | 95,534,000     |  |
|          | 平成26年度第4回福井県公募公債            | 100,000,000    | 100,703,000    |  |
|          | 令和2年度第2回徳島県公募公債             | 100,000,000    | 96,520,000     |  |
|          | 平成28年度第1回山梨県公募公債            | 200,000,000    | 199,066,000    |  |
|          | 平成30年度第1回山梨県公募公債            | 100,000,000    | 99,487,000     |  |
|          | 令和2年度第1回山梨県公募公債             | 700,000,000    | 676,116,000    |  |
|          | 第96回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券   | 100,000,000    | 110,446,000    |  |
| 地方債証券 合計 |                             | 36,622,900,000 | 37,330,326,096 |  |
| 特殊債券     | 第4回政府保証新関西国際空港債券            | 104,000,000    | 105,019,200    |  |
|          | 第6回神奈川県住宅供給公社債券             | 100,000,000    | 97,832,000     |  |
|          | 第26回政府保証日本政策投資銀行            | 100,000,000    | 100,741,000    |  |
|          | 第36回日本政策投資銀行債券（財投機関債）       | 30,000,000     | 32,442,600     |  |
|          | 第1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    | 124,156,000    |  |
|          | 第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債） | 140,000,000    | 149,930,200    |  |

|                               |             |             |  |
|-------------------------------|-------------|-------------|--|
| 第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）  | 300,000,000 | 322,923,000 |  |
| 第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）  | 30,000,000  | 36,629,100  |  |
| 第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）  | 200,000,000 | 239,674,000 |  |
| 第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）  | 200,000,000 | 216,404,000 |  |
| 第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）  | 110,000,000 | 130,062,900 |  |
| 第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）  | 300,000,000 | 327,063,000 |  |
| 第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）  | 200,000,000 | 218,320,000 |  |
| 第28回道路債券（財投機関債）               | 100,000,000 | 119,101,000 |  |
| 第33回道路債券（財投機関債）               | 300,000,000 | 361,077,000 |  |
| 第38回道路債券（財投機関債）               | 200,000,000 | 206,976,000 |  |
| 第42回道路債券（財投機関債）               | 200,000,000 | 208,862,000 |  |
| 第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）  | 150,000,000 | 165,045,000 |  |
| 第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）  | 100,000,000 | 110,843,000 |  |
| 第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000 | 115,529,000 |  |
| 第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000 | 113,892,000 |  |
| 第116回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000 | 107,615,000 |  |
| 第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000 | 110,472,000 |  |
| 第145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 | 97,793,000  |  |
| 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 | 110,569,000 |  |
| 第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債） | 300,000,000 | 304,467,000 |  |
| 第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 103,871,000 |  |
| 第158回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000 | 110,648,000 |  |
| 第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 102,780,000 |  |
| 第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000 | 110,915,000 |  |
| 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 | 107,702,000 |  |
| 第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 600,000,000 | 604,206,000 |  |
| 第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000 | 100,778,000 |  |
| 第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000 | 100,820,000 |  |

|                              |               |               |  |
|------------------------------|---------------|---------------|--|
| 第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 124,000,000   | 124,996,960   |  |
| 第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 100,000,000   | 105,982,000   |  |
| 第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 1,183,000,000 | 1,192,227,400 |  |
| 第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 100,000,000   | 100,757,000   |  |
| 第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 200,000,000   | 201,650,000   |  |
| 第247回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 650,000,000   | 656,649,500   |  |
| 第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 101,000,000   | 101,996,870   |  |
| 第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 100,000,000   | 101,207,000   |  |
| 第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 100,000,000   | 100,858,000   |  |
| 第263回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 200,000,000   | 201,738,000   |  |
| 第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 100,000,000   | 100,720,000   |  |
| 第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 200,000,000   | 200,368,000   |  |
| 第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 300,000,000   | 299,220,000   |  |
| 第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 100,000,000   | 99,158,000    |  |
| 第1回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）  | 50,000,000    | 55,474,000    |  |
| 第4回公営企業債券（30年）（財投機関債）        | 100,000,000   | 121,098,000   |  |
| 第7回公営企業債券（20年）（財投機関債）        | 100,000,000   | 102,419,000   |  |
| 第8回公営企業債券（20年）（財投機関債）        | 100,000,000   | 102,477,000   |  |
| 第9回公営企業債券（20年）（財投機関債）        | 50,000,000    | 51,830,500    |  |
| 第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）     | 500,000,000   | 499,460,000   |  |
| 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   | 109,187,000   |  |
| 第12回公営企業債券（20年）（財投機関債）       | 300,000,000   | 312,186,000   |  |
| 第13回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債） | 100,000,000   | 111,429,000   |  |
| 第14回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債） | 80,000,000    | 89,631,200    |  |
| 第16回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債） | 80,000,000    | 87,612,800    |  |
| 第17回公営企業債券（20年）（財投機関債）       | 150,000,000   | 160,453,500   |  |
| 第22回公営企業債券（20年）（財投機関債）       | 100,000,000   | 108,661,000   |  |
| 第23回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債） | 100,000,000   | 109,561,000   |  |
| 第24回公営企業債券（20年）（財投機関債）       | 300,000,000   | 328,950,000   |  |

|                              |             |             |  |
|------------------------------|-------------|-------------|--|
| 第27回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債） | 50,000,000  | 53,943,500  |  |
| 第27回地方公共団体金融機構債券（5年）（財投機関債）  | 100,000,000 | 99,730,000  |  |
| 第44回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債） | 100,000,000 | 103,232,000 |  |
| 第46回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 17,000,000  | 17,015,640  |  |
| 第48回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 36,000,000  | 36,066,240  |  |
| F54回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）      | 200,000,000 | 203,406,000 |  |
| 第58回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 300,000,000 | 302,052,000 |  |
| 第59回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 315,000,000 | 317,353,050 |  |
| 第60回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）      | 200,000,000 | 201,634,000 |  |
| 第61回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 100,000,000 | 100,798,000 |  |
| 第64回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 240,000,000 | 241,852,800 |  |
| 第67回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）      | 170,000,000 | 171,237,600 |  |
| 第73回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 302,000,000 | 304,923,360 |  |
| 第77回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 100,000,000 | 100,845,000 |  |
| 第77回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）      | 300,000,000 | 302,892,000 |  |
| 第78回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 150,000,000 | 151,288,500 |  |
| 第81回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 100,000,000 | 100,182,000 |  |
| 第82回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 674,000,000 | 672,631,780 |  |
| 第83回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 102,000,000 | 101,753,160 |  |
| F90回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）      | 100,000,000 | 106,010,000 |  |
| 第91回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 300,000,000 | 299,187,000 |  |
| 第100回政府保証地方公共団体金融機構債券        | 325,000,000 | 322,835,500 |  |
| 第102回政府保証地方公共団体金融機構債券        | 131,000,000 | 130,439,320 |  |
| F104回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）     | 100,000,000 | 102,490,000 |  |
| 第108回政府保証地方公共団体金融機構債券        | 223,000,000 | 221,191,470 |  |
| 第115回政府保証地方公共団体金融機構債券        | 200,000,000 | 197,922,000 |  |
| F131回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）     | 70,000,000  | 74,921,700  |  |
| F151回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）     | 100,000,000 | 104,613,000 |  |
| F203回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）     | 200,000,000 | 206,666,000 |  |
| F234回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）     | 100,000,000 | 106,898,000 |  |
| 第27回首都高速道路                   | 100,000,000 | 99,496,000  |  |
| 第24回阪神高速道路                   | 200,000,000 | 199,316,000 |  |
| 第10回日本政策金融公庫（財投機関債）          | 80,000,000  | 89,011,200  |  |
| 第15回日本政策金融公庫（財投機関債）          | 80,000,000  | 87,577,600  |  |
| 第5回本州四国連絡橋債券（財投機関債）          | 200,000,000 | 207,774,000 |  |
| 第48回福祉医療機構債券（財投機関債）          | 400,000,000 | 398,532,000 |  |
| 第54回福祉医療機構債券（財投機関債）          | 100,000,000 | 98,892,000  |  |

|                       |             |             |  |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 第4回中部国際空港（財投機関債）      | 200,000,000 | 199,398,000 |  |
| 第232回政府保証預金保険機構債券     | 400,000,000 | 400,220,000 |  |
| 第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 9,773,000   | 9,803,394   |  |
| 第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 32,235,000  | 32,589,907  |  |
| 第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 9,904,000   | 9,940,248   |  |
| 第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券 | 39,260,000  | 38,956,520  |  |
| 第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券 | 40,328,000  | 39,986,421  |  |
| 第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 9,878,000   | 9,911,585   |  |
| 第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券 | 47,204,000  | 46,640,384  |  |
| 第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 9,915,000   | 9,949,999   |  |
| 第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 10,555,000  | 10,659,600  |  |
| 第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 20,214,000  | 20,282,929  |  |
| 第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券 | 67,255,000  | 66,118,390  |  |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 11,336,000  | 11,552,290  |  |
| 第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 21,812,000  | 22,080,723  |  |
| 第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 20,380,000  | 21,441,594  |  |
| 第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 20,571,000  | 21,581,447  |  |
| 第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券    | 20,328,000  | 20,380,039  |  |
| 第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 20,872,000  | 21,847,974  |  |
| 第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 20,154,000  | 21,096,602  |  |
| 第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 38,772,000  | 40,443,460  |  |
| 第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券    | 10,225,000  | 10,322,444  |  |
| 第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 40,476,000  | 42,179,230  |  |
| 第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 21,684,000  | 22,522,303  |  |
| 第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券    | 29,541,000  | 29,623,419  |  |
| 第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 42,134,000  | 43,336,083  |  |
| 第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券    | 10,562,000  | 10,674,802  |  |
| 第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 24,701,000  | 25,718,928  |  |
| 第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 94,896,000  | 99,307,715  |  |
| 第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 59,166,000  | 61,695,346  |  |
| 第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 17,258,000  | 17,980,765  |  |
| 第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 36,598,000  | 38,177,203  |  |
| 第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 37,266,000  | 38,756,267  |  |
| 第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 38,674,000  | 40,125,048  |  |
| 第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 40,488,000  | 42,036,666  |  |
| 第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券    | 21,442,000  | 21,693,514  |  |
| 第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 43,670,000  | 45,220,721  |  |
| 第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 45,898,000  | 47,509,478  |  |
| 第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 25,848,000  | 26,744,408  |  |
| 第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 26,001,000  | 26,944,316  |  |
| 第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 55,572,000  | 57,634,832  |  |
| 第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 56,622,000  | 58,500,717  |  |

|                               |             |             |  |
|-------------------------------|-------------|-------------|--|
| 第6 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 56,958,000  | 58,682,118  |  |
| 第6 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 31,820,000  | 32,709,050  |  |
| 第6 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 31,598,000  | 32,347,820  |  |
| 第6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 104,403,000 | 106,954,609 |  |
| 第7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 32,787,000  | 33,802,085  |  |
| 第7 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 36,874,000  | 38,152,421  |  |
| 第7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 31,516,000  | 32,433,115  |  |
| 第7 7 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）   | 30,000,000  | 31,557,900  |  |
| 第7 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 32,387,000  | 33,142,588  |  |
| 第8 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 36,447,000  | 37,275,075  |  |
| 第8 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 38,931,000  | 39,739,986  |  |
| 第8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 152,380,000 | 155,355,981 |  |
| 第8 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 79,156,000  | 80,718,539  |  |
| 第8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）   | 100,000,000 | 109,761,000 |  |
| 第8 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 42,375,000  | 43,026,303  |  |
| 第9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 130,491,000 | 131,955,109 |  |
| 第9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 46,183,000  | 46,319,239  |  |
| 第9 3 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）   | 200,000,000 | 209,916,000 |  |
| 第9 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 57,916,000  | 58,193,996  |  |
| 第9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 55,272,000  | 55,320,639  |  |
| 第9 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 56,568,000  | 57,064,101  |  |
| 第1 0 0 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 200,000,000 | 220,162,000 |  |
| 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 | 104,668,000 |  |
| 第1 0 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 59,860,000  | 60,120,391  |  |
| 第1 0 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 125,174,000 | 123,121,146 |  |
| 第1 0 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 274,056,000 | 266,640,044 |  |
| 第1 1 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 210,744,000 | 202,727,298 |  |
| 第1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 145,692,000 | 142,022,018 |  |
| 第1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 507,472,000 | 495,297,746 |  |
| 第1 2 1 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 130,000,000 | 146,126,500 |  |
| 第1 2 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 223,647,000 | 217,349,100 |  |
| 第1 2 3 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 111,098,000 |  |
| 第1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 74,889,000  | 72,612,374  |  |
| 第1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 76,792,000  | 74,264,775  |  |
| 第1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 75,754,000  | 73,402,595  |  |
| 第1 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 155,060,000 | 150,484,179 |  |
| 第1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 154,106,000 | 149,191,559 |  |
| 第1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 77,146,000  | 74,509,921  |  |

|                            |             |             |  |
|----------------------------|-------------|-------------|--|
| 第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 76,998,000  | 74,375,448  |  |
| 第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 233,934,000 | 226,216,517 |  |
| 第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 78,657,000  | 75,836,359  |  |
| 第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 79,345,000  | 76,722,647  |  |
| 第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 159,614,000 | 154,629,254 |  |
| 第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 158,800,000 | 154,204,328 |  |
| 第143回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 104,058,000 |  |
| 第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 167,750,000 | 158,802,215 |  |
| 第149回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 200,000,000 | 201,366,000 |  |
| 第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 258,555,000 | 244,401,699 |  |
| 第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 173,678,000 | 164,681,479 |  |
| 第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 87,036,000  | 82,993,177  |  |
| 第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 90,091,000  | 85,981,949  |  |
| 第161回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 101,658,000 |  |
| 第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 182,306,000 | 173,659,226 |  |
| 第164回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 100,943,000 |  |
| 第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 91,461,000  | 87,121,175  |  |
| 第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 277,440,000 | 264,869,193 |  |
| 第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 186,616,000 | 177,908,497 |  |
| 第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 187,240,000 | 178,162,604 |  |
| 第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 189,516,000 | 179,424,273 |  |
| 第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 94,686,000  | 89,617,458  |  |
| 第174回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 180,000,000 | 181,501,200 |  |
| 第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 96,027,000  | 91,217,967  |  |
| 第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 192,232,000 | 181,813,025 |  |
| 第177回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 192,808,000 | 183,587,921 |  |
| 第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 96,251,000  | 92,344,171  |  |
| 第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 193,778,000 | 185,356,408 |  |
| 第180回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 96,984,000  | 93,129,855  |  |
| 第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 97,518,000  | 93,562,669  |  |
| 第182回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 196,142,000 | 188,055,065 |  |
| 第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 196,814,000 | 189,077,241 |  |
| 第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 197,884,000 | 189,584,745 |  |
| 第186回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 99,463,000  | 97,260,889  |  |
| 第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 200,000,000 | 200,134,000 |  |
| 第194回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 99,352,000  |  |
| 第203回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 99,713,000  |  |
| 第6回沖縄振興開発金融公庫債券（財投機関債）     | 50,000,000  | 52,249,500  |  |



|         |                              |                |                |  |
|---------|------------------------------|----------------|----------------|--|
|         | い第８３２号商工債券                   | 100,000,000    | 99,833,000     |  |
|         | い第８４３号商工債券                   | 200,000,000    | 199,668,000    |  |
|         | い第８４８号商工債券                   | 100,000,000    | 99,671,000     |  |
|         | い第８５０号商工債券                   | 300,000,000    | 298,821,000    |  |
|         | い第８５２号商工債券                   | 100,000,000    | 99,504,000     |  |
|         | い第８５４号商工債券                   | 500,000,000    | 496,875,000    |  |
|         | い第８５７号商工債券                   | 100,000,000    | 99,276,000     |  |
|         | 第３７６回信金中金債                   | 100,000,000    | 99,559,000     |  |
|         | 第１１号商工債券（１０年）                | 300,000,000    | 302,466,000    |  |
|         | 第２５６号商工債券（３年）                | 300,000,000    | 299,559,000    |  |
|         | 第２５７号商工債券（３年）                | 200,000,000    | 199,672,000    |  |
|         | 第２回信金中金債（１０年）                | 100,000,000    | 100,917,000    |  |
|         | 第７回国際協力機構債券（財投機関債）           | 70,000,000     | 77,366,800     |  |
|         | 第８３回東日本高速道路                  | 400,000,000    | 396,572,000    |  |
|         | 第７８回中日本高速道路                  | 300,000,000    | 299,637,000    |  |
|         | 第２９回西日本高速道路                  | 200,000,000    | 200,210,000    |  |
|         | 第５６回西日本高速道路                  | 900,000,000    | 896,346,000    |  |
|         | 第６１回西日本高速道路                  | 700,000,000    | 693,763,000    |  |
|         | 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    | 102,338,000    |  |
| 特殊債券 合計 |                              | 34,050,546,000 | 34,577,163,135 |  |
| 社債券     | 第１９回フランス相互信用連合銀行             | 100,000,000    | 100,272,000    |  |
|         | 第２６回フランス相互信用連合銀行             | 100,000,000    | 99,992,000     |  |
|         | 第２９回フランス相互信用連合銀行             | 200,000,000    | 198,608,000    |  |
|         | 第３５回フランス相互信用連合銀行             | 500,000,000    | 486,510,000    |  |
|         | 第３８回フランス相互信用連合銀行             | 300,000,000    | 299,061,000    |  |
|         | 第６回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー         | 200,000,000    | 200,830,000    |  |
|         | 第２１回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー        | 300,000,000    | 299,685,000    |  |
|         | 第２５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー        | 100,000,000    | 97,157,000     |  |
|         | 第１回サントナデル銀行（２０１９）            | 500,000,000    | 494,290,000    |  |
|         | 第１２回新関西国際空港                  | 100,000,000    | 102,986,000    |  |
|         | 第２７回新関西国際空港                  | 100,000,000    | 99,283,000     |  |
|         | 第３２回成田国際空港                   | 100,000,000    | 98,024,000     |  |
|         | 第１７回ナショナル・オーストラリア銀行          | 300,000,000    | 300,012,000    |  |
|         | 第１回国際石油開発帝石                  | 100,000,000    | 99,390,000     |  |
|         | 第１０回明治ホールディングス（サステナビリティ）     | 200,000,000    | 198,516,000    |  |
|         | 第１６回アサヒグループホールディングス          | 100,000,000    | 99,300,000     |  |
|         | 第９回サントリーホールディングス             | 200,000,000    | 198,866,000    |  |
|         | 第５回サントリー食品インターナショナル          | 200,000,000    | 199,398,000    |  |
|         | 第２２回味の素                      | 100,000,000    | 99,999,000     |  |
|         | 第３回 キューピー                    | 100,000,000    | 99,770,000     |  |
|         | 第１３回日本たばこ産業                  | 200,000,000    | 197,278,000    |  |

|                           |             |             |  |
|---------------------------|-------------|-------------|--|
| 第6回ヒューリック                 | 400,000,000 | 395,052,000 |  |
| 第4回トヨタ紡織                  | 200,000,000 | 199,730,000 |  |
| 第9回クラレ                    | 100,000,000 | 99,614,000  |  |
| 第16回旭化成                   | 200,000,000 | 199,220,000 |  |
| 第42回王子ホールディングス            | 300,000,000 | 298,299,000 |  |
| 第11回イビデン                  | 200,000,000 | 199,260,000 |  |
| 第4回野村総合研究所                | 100,000,000 | 99,030,000  |  |
| 第6回花王                     | 200,000,000 | 199,598,000 |  |
| 第1回アステラス製薬                | 400,000,000 | 399,988,000 |  |
| 第19回オリエンタルランド             | 300,000,000 | 299,142,000 |  |
| 第12回ヤフー                   | 500,000,000 | 494,575,000 |  |
| 第19回Zホールディングス             | 400,000,000 | 395,396,000 |  |
| 第22回Zホールディングス             | 200,000,000 | 199,084,000 |  |
| 第11回ブリヂストン                | 500,000,000 | 496,940,000 |  |
| 第12回日本電気硝子                | 100,000,000 | 98,770,000  |  |
| 第4回新日本製鐵                  | 200,000,000 | 199,136,000 |  |
| 第36回ジェイ エフ イー ホールディングス    | 400,000,000 | 397,732,000 |  |
| 第14回LIXIL                 | 200,000,000 | 198,772,000 |  |
| 第1回日本郵政（グリーン）             | 100,000,000 | 99,110,000  |  |
| 第30回ダイキン工業                | 200,000,000 | 197,510,000 |  |
| 第19回日立製作所                 | 100,000,000 | 98,886,000  |  |
| 第17回パナソニック                | 300,000,000 | 300,252,000 |  |
| 第18回パナソニック                | 100,000,000 | 99,490,000  |  |
| 第22回パナソニック                | 100,000,000 | 98,483,000  |  |
| 第18回デンソー                  | 300,000,000 | 297,369,000 |  |
| 第40回三菱重工業                 | 300,000,000 | 297,426,000 |  |
| 第18回J A三井リース              | 100,000,000 | 99,073,000  |  |
| 第10回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス | 100,000,000 | 99,378,000  |  |
| 第67回日産自動車（サステナビリティ）       | 200,000,000 | 199,936,000 |  |
| 第26回トヨタ自動車（サステナビリティ）      | 800,000,000 | 795,008,000 |  |
| 第1回明治安田生命2018基金           | 200,000,000 | 199,822,000 |  |
| 第1回明治安田生命2019基金           | 200,000,000 | 199,398,000 |  |
| 第63回三井物産                  | 400,000,000 | 432,120,000 |  |
| 第51回住友商事                  | 100,000,000 | 103,118,000 |  |
| 第1回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ      | 100,000,000 | 100,540,000 |  |
| 第3回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ      | 300,000,000 | 300,981,000 |  |
| 第17回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ     | 500,000,000 | 491,360,000 |  |
| 第23回三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付        | 200,000,000 | 225,330,000 |  |
| 第26回三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付        | 200,000,000 | 207,508,000 |  |
| 第29回三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付        | 200,000,000 | 209,206,000 |  |
| 第30回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）      | 100,000,000 | 110,331,000 |  |
| 第88回三菱東京ＵＦＪ銀行             | 100,000,000 | 107,845,000 |  |

|                           |               |               |  |
|---------------------------|---------------|---------------|--|
| 第15回みずほフィナンシャルグループ劣後特約付   | 100,000,000   | 97,736,000    |  |
| 第18回みずほ銀行（劣後特約付）          | 100,000,000   | 104,825,000   |  |
| 第28回芙蓉総合リース               | 500,000,000   | 494,330,000   |  |
| 第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス       | 1,200,000,000 | 1,196,520,000 |  |
| 第17回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス       | 300,000,000   | 297,369,000   |  |
| 第20回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン） | 600,000,000   | 597,696,000   |  |
| 第34回東京センチュリー              | 300,000,000   | 292,035,000   |  |
| 第70回ホンダファイナンス             | 200,000,000   | 199,148,000   |  |
| 第72回ホンダファイナンス             | 400,000,000   | 398,180,000   |  |
| 第95回トヨタファイナンス             | 500,000,000   | 499,030,000   |  |
| 第96回トヨタファイナンス             | 800,000,000   | 795,528,000   |  |
| 第97回トヨタファイナンス             | 200,000,000   | 199,448,000   |  |
| 第31回リコーリース                | 100,000,000   | 99,819,000    |  |
| 第41回リコーリース                | 500,000,000   | 494,430,000   |  |
| 第79回アコム                   | 300,000,000   | 299,088,000   |  |
| 第80回アコム                   | 200,000,000   | 198,626,000   |  |
| 第81回アコム                   | 100,000,000   | 98,565,000    |  |
| 第201回オリックス                | 500,000,000   | 494,320,000   |  |
| 第1回三菱HCキャピタル              | 900,000,000   | 895,365,000   |  |
| 第69回三菱UFJリース              | 500,000,000   | 495,985,000   |  |
| 第3回野村ホールディングス             | 200,000,000   | 196,792,000   |  |
| 第24回野村ホールディングス            | 100,000,000   | 103,990,000   |  |
| 第27回野村ホールディングス            | 100,000,000   | 103,820,000   |  |
| 第137回三菱地所                 | 300,000,000   | 298,896,000   |  |
| 第12回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス       | 100,000,000   | 100,640,000   |  |
| 第13回森トラスト総合リート投資法人        | 200,000,000   | 199,672,000   |  |
| 第36回京王電鉄                  | 200,000,000   | 197,714,000   |  |
| 第34回東日本旅客鉄道               | 100,000,000   | 103,203,000   |  |
| 第53回東日本旅客鉄道               | 300,000,000   | 327,717,000   |  |
| 第100回東日本旅客鉄道              | 200,000,000   | 208,842,000   |  |
| 第102回東日本旅客鉄道              | 100,000,000   | 100,592,000   |  |
| 第163回東日本旅客鉄道              | 600,000,000   | 594,558,000   |  |
| 第174回東日本旅客鉄道              | 700,000,000   | 696,451,000   |  |
| 第73回西日本旅客鉄道               | 400,000,000   | 396,284,000   |  |
| 第42回東海旅客鉄道                | 100,000,000   | 110,099,000   |  |
| 第53回東海旅客鉄道                | 100,000,000   | 107,428,000   |  |
| 第2回東京地下鉄                  | 500,000,000   | 514,545,000   |  |
| 第28回東京地下鉄                 | 300,000,000   | 295,419,000   |  |
| 第50回阪急阪神ホールディングス          | 200,000,000   | 196,968,000   |  |
| 第58回阪急阪神ホールディングス          | 200,000,000   | 198,618,000   |  |
| 第64回名古屋鉄道                 | 200,000,000   | 198,308,000   |  |
| 第8回ニッコンホールディングス           | 100,000,000   | 99,819,000    |  |

|                    |             |             |  |
|--------------------|-------------|-------------|--|
| 第１回横浜高速鉄道          | 300,000,000 | 301,311,000 |  |
| 第９回九州旅客鉄道          | 200,000,000 | 198,884,000 |  |
| 第３１回ＫＤＤＩ（サステナビリティ） | 200,000,000 | 199,740,000 |  |
| 第９回ソフトバンク          | 300,000,000 | 294,855,000 |  |
| 第１４回ソフトバンク         | 100,000,000 | 98,548,000  |  |
| 第１６回ソフトバンク         | 300,000,000 | 282,180,000 |  |
| 第５４８回東京電力          | 100,000,000 | 103,859,000 |  |
| 第５６７回東京電力          | 100,000,000 | 101,031,000 |  |
| 第５０８回関西電力          | 200,000,000 | 198,472,000 |  |
| 第５１０回関西電力          | 500,000,000 | 496,075,000 |  |
| 第５１１回関西電力          | 100,000,000 | 98,762,000  |  |
| 第５１８回関西電力          | 200,000,000 | 196,222,000 |  |
| 第５２４回関西電力          | 200,000,000 | 196,158,000 |  |
| 第５３２回関西電力          | 100,000,000 | 99,766,000  |  |
| 第５４３回関西電力          | 200,000,000 | 198,822,000 |  |
| 第３８１回中国電力          | 100,000,000 | 100,859,000 |  |
| 第３８５回中国電力          | 100,000,000 | 100,958,000 |  |
| 第３９３回中国電力          | 100,000,000 | 98,893,000  |  |
| 第４００回中国電力          | 200,000,000 | 197,194,000 |  |
| 第４０９回中国電力          | 200,000,000 | 195,666,000 |  |
| 第３０７回北陸電力          | 100,000,000 | 101,998,000 |  |
| 第３２２回北陸電力          | 100,000,000 | 99,033,000  |  |
| 第４８５回東北電力          | 100,000,000 | 99,074,000  |  |
| 第４９４回東北電力          | 200,000,000 | 197,942,000 |  |
| 第５２９回東北電力          | 500,000,000 | 493,455,000 |  |
| 第５５２回東北電力          | 400,000,000 | 398,968,000 |  |
| 第４４９回九州電力          | 300,000,000 | 296,787,000 |  |
| 第４６８回九州電力          | 100,000,000 | 97,809,000  |  |
| 第４７１回九州電力          | 300,000,000 | 293,259,000 |  |
| 第４８４回九州電力          | 400,000,000 | 384,160,000 |  |
| 第４９３回九州電力          | 400,000,000 | 393,988,000 |  |
| 第２９回沖縄電力           | 200,000,000 | 199,424,000 |  |
| 第５０回電源開発           | 200,000,000 | 198,104,000 |  |
| 第５７回電源開発           | 100,000,000 | 97,646,000  |  |
| 第５９回電源開発           | 300,000,000 | 293,286,000 |  |
| 第６４回電源開発           | 600,000,000 | 581,484,000 |  |
| 第６７回電源開発           | 200,000,000 | 190,952,000 |  |
| 第６回東京電力パワーグリッド     | 100,000,000 | 98,657,000  |  |
| 第１３回東京電力パワーグリッド    | 300,000,000 | 293,388,000 |  |
| 第１５回東京電力パワーグリッド    | 100,000,000 | 96,281,000  |  |
| 第１６回東京電力パワーグリッド    | 200,000,000 | 198,836,000 |  |
| 第２５回東京電力パワーグリッド    | 100,000,000 | 98,389,000  |  |

|                         |                 |                 |  |
|-------------------------|-----------------|-----------------|--|
| 第２８回東京電力パワーグリッド         | 400,000,000     | 392,768,000     |  |
| 第３１回東京電力パワーグリッド         | 300,000,000     | 293,559,000     |  |
| 第３３回東京電力パワーグリッド         | 200,000,000     | 197,484,000     |  |
| 第３５回東京電力パワーグリッド         | 100,000,000     | 98,819,000      |  |
| 第３８回東京電力パワーグリッド         | 400,000,000     | 398,288,000     |  |
| 第３９回東京電力パワーグリッド         | 400,000,000     | 390,552,000     |  |
| 第４１回東京電力パワーグリッド         | 100,000,000     | 98,922,000      |  |
| 第４４回東京電力パワーグリッド         | 200,000,000     | 197,034,000     |  |
| 第４７回東京電力パワーグリッド         | 200,000,000     | 187,192,000     |  |
| 第４９回東京電力パワーグリッド         | 400,000,000     | 391,372,000     |  |
| 第１回東京電力リニューアブルパワー（グリーン） | 200,000,000     | 198,460,000     |  |
| 第３回東京電力リニューアブルパワー（グリーン） | 400,000,000     | 394,500,000     |  |
| 第１３回広島ガス                | 200,000,000     | 196,658,000     |  |
| 第７回ファーストリテイリング          | 100,000,000     | 99,357,000      |  |
| 社債券 合計                  | 40,600,000,000  | 40,402,603,000  |  |
| 合計                      | 681,062,446,000 | 678,207,135,981 |  |

## 第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

## 外国債券インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

| (単位：円)          |                 |
|-----------------|-----------------|
| [令和 5年 1月26日現在] |                 |
| 資産の部            |                 |
| 流動資産            |                 |
| 預金              | 2,928,385,849   |
| コール・ローン         | 1,326,513,223   |
| 国債証券            | 385,399,953,248 |
| 派生商品評価勘定        | 118,006         |
| 未収入金            | 73,075          |
| 未収利息            | 2,399,058,168   |
| 前払費用            | 509,607,787     |
| 流動資産合計          | 392,563,709,356 |
| 資産合計            | 392,563,709,356 |
| 負債の部            |                 |
| 流動負債            |                 |
| 派生商品評価勘定        | 14,510,971      |
| 未払金             | 944,592,025     |
| 未払解約金           | 57,548,203      |
| 未払利息            | 596             |

[令和 5年 1月26日現在]

|             |                 |
|-------------|-----------------|
| 流動負債合計      | 1,016,651,795   |
| 負債合計        | 1,016,651,795   |
| 純資産の部       |                 |
| 元本等         |                 |
| 元本          | 174,401,387,040 |
| 剰余金         |                 |
| 剰余金又は欠損金（△） | 217,145,670,521 |
| 元本等合計       | 391,547,057,561 |
| 純資産合計       | 391,547,057,561 |
| 負債純資産合計     | 392,563,709,356 |

## 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<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。 |

（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 5年 1月26日現在]  |
|-------------------------------|------------------|
| 1. 期首                         | 令和 4年 1月27日      |
| 期首元本額                         | 128,220,682,456円 |
| 期中追加設定元本額                     | 78,774,912,397円  |
| 期中一部解約元本額                     | 32,594,207,813円  |
| 元本の内訳※                        |                  |
| 三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）        | 288,126,767円     |
| 三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）      | 599,983,269円     |
| 三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）        | 358,623,319円     |
| 三菱ＵＦＪ 外国債券オープン                | 943,202,474円     |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）   | 2,247,315,132円   |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金） | 5,985,047,972円   |
| 三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）   | 4,267,470,223円   |
| 三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）     | 552,529,775円     |
| 三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（成長型）        | 94,604,463円      |

|                                  | [令和 5年 1月26日現在] |
|----------------------------------|-----------------|
| ファンド・マネジャー（海外債券）                 | 454,994,389円    |
| eMAXIS 先進国債券インデックス               | 5,607,450,772円  |
| eMAXIS バランス（8資産均等型）              | 2,284,495,931円  |
| eMAXIS バランス（波乗り型）                | 232,312,835円    |
| 三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）      | 912,267,257円    |
| コアバランス                           | 1,355,556円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金） | 366,381,473円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金） | 183,656,477円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金） | 115,950,825円    |
| eMAXIS Slim 先進国債券インデックス          | 25,990,673,993円 |
| 海外債券セレクション（ラップ向け）                | 5,632,377,387円  |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）         | 9,590,582,417円  |
| つみたて8資産均等バランス                    | 4,440,354,717円  |
| つみたて4資産均等バランス                    | 1,463,102,667円  |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s            | 2,527,868円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s            | 787,849円        |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s            | 130,932円        |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金） | 184,527,503円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金） | 112,782,218円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金） | 57,439,940円     |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式15）             | 586,997,727円    |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式40）             | 879,737,122円    |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式65）             | 1,050,863,820円  |
| 三菱UFJ DC年金インデックス（先進国債券）          | 1,138,876,432円  |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金） | 47,206,921円     |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式25）             | 124,506,757円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金） | 17,759,417円     |
| ラップ向けインデックスf 先進国債券               | 3,000,094,572円  |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式80）             | 7,380,644円      |
| ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）         | 3,898,433,052円  |
| ラップ向けダイナミックアロケーションファンド           | 25,186,548円     |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド            | 9,295,486円      |
| アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）          | 32,083,510円     |
| 三菱UFJ 外国債券オープン（確定拠出年金）           | 2,989,024,875円  |
| 三菱UFJ 外国債券オープン（毎月分配型）            | 18,743,472,784円 |
| ワールド・インカムオープン                    | 1,078,079,867円  |

|                                       | [令和 5年 1月26日現在] |
|---------------------------------------|-----------------|
| 三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド                | 14,583,972,007円 |
| 三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）           | 432,123,162円    |
| 三菱UFJ 世界国債インデックスファンド（年1回決算型）          | 1,833,060,644円  |
| eMAXIS バランス（4資産均等型）                   | 651,394,294円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）             | 495,920,340円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）             | 204,282,570円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）            | 154,689,872円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）               | 47,257,650円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）              | 18,194,405円     |
| 三菱UFJ 外国債券ファンドVA（適格機関投資家限定）           | 1,280,502,264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） | 8,854円          |
| 三菱UFJ 外国債券ファンドVA2（適格機関投資家限定）          | 14,766,674円     |
| MUAM 世界債券オープン（適格機関投資家限定）              | 1,644,117,717円  |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）         | 12,809,506円     |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）         | 1,786,959,067円  |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）       | 1,263,768,317円  |
| MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）        | 32,111,079,560円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）       | 525,160,427円    |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）         | 1,236,335円      |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）       | 805,817円        |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）         | 1,528,953,530円  |
| アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）        | 65,730,535円     |
| アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）       | 114,207,191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） | 672,493,265円    |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）            | 27,719,449円     |
| MUKAM 外国債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）      | 2,751,499,633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）   | 670,216,424円    |
| 外国債券インデックスファンドV（適格機関投資家限定）            | 739,817,415円    |
| 海外債券インデックスファンドS                       | 822,150,656円    |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA            | 1,692,220円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA          | 3,237,606円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA            | 813,779円        |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA            | 840,907円        |
| 三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA                | 8,699,201円      |
| 三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）            | 4,766,750円      |
| 三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）            | 10,387,295円     |
| 三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）            | 6,700,133円      |



|                                       | [令和 5年 1月26日現在]  |
|---------------------------------------|------------------|
| 三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）            | 15,667,078円      |
| 外国債券インデックスファンドi（適格機関投資家限定）            | 110,853,063円     |
| 三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド              | 1,805,625,990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）   | 205,142,300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） | 560,512,205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）   | 438,764,006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）   | 172,730,993円     |
| 合計                                    | 174,401,387,040円 |
| 2. 受益権の総数                             | 174,401,387,040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 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>                                                                                                                                                                                                                         |

### 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                        | [令和 5年 1月26日現在]                                                                                                                                                                                                                    |
|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                                                             |
| 2.時価の算定方法                 | <p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価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 5年 1月26日現在]    |
|------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | △12,789,886,649    |
| 合計   | △12,789,886,649    |

(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 5年 1月26日現在]

| 区分        | 種類        | 契約額等（円）       |       | 時価（円）         | 評価損益（円）     |
|-----------|-----------|---------------|-------|---------------|-------------|
|           |           |               | うち1年超 |               |             |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引    |               |       |               |             |
|           | 買建        |               |       |               |             |
|           | アメリカドル    | 1,386,577,334 | —     | 1,372,752,228 | △13,825,106 |
|           | カナダドル     | 4,823,050     | —     | 4,823,065     | 15          |
|           | オーストラリアドル | 15,591,469    | —     | 15,615,547    | 24,078      |
|           | イギリスポンド   | 9,628,278     | —     | 9,621,282     | △6,996      |
|           | デンマーククローネ | 4,197,248     | —     | 4,171,002     | △26,246     |
|           | イスラエルシェケル | 4,266,988     | —     | 4,215,310     | △51,678     |
|           | オフショア元    | 39,317,874    | —     | 39,122,610    | △195,264    |

|  |                |               |   |               |             |
|--|----------------|---------------|---|---------------|-------------|
|  | ユーロ<br>売建      | 65,033,136    | — | 64,888,100    | △145,036    |
|  | マレーシアリン<br>ギット | 18,000,900    | — | 17,911,987    | 88,913      |
|  | 中国元            | 162,269,595   | — | 162,525,240   | △255,645    |
|  | 合計             | 1,709,705,872 | — | 1,695,646,371 | △14,392,965 |

（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 5年 1月26日現在] |
| 1口当たり純資産額    | 2,2451円         |
| (1万口当たり純資産額) | (22,451円)       |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

| 通貨         | 種 類  | 銘 柄                 | 券面総額          | 評価額           | 備考 |
|------------|------|---------------------|---------------|---------------|----|
| アメリカ<br>ドル | 国債証券 | 0.125 T-NOTE 240215 | 10,000,000.00 | 9,531,740.69  |    |
|            |      | 0.25 T-NOTE 240315  | 11,400,000.00 | 10,848,703.06 |    |
|            |      | 0.25 T-NOTE 240615  | 7,100,000.00  | 6,695,078.12  |    |
|            |      | 0.25 T-NOTE 250531  | 5,000,000.00  | 4,581,738.30  |    |

|                     |               |               |  |
|---------------------|---------------|---------------|--|
| 0.25 T-NOTE 250630  | 6,650,000.00  | 6,089,165.99  |  |
| 0.25 T-NOTE 250731  | 5,800,000.00  | 5,291,253.92  |  |
| 0.25 T-NOTE 250831  | 4,200,000.00  | 3,821,261.72  |  |
| 0.25 T-NOTE 250930  | 5,100,000.00  | 4,635,521.47  |  |
| 0.375 T-NOTE 240415 | 5,300,000.00  | 5,035,621.10  |  |
| 0.375 T-NOTE 240715 | 6,200,000.00  | 5,843,015.65  |  |
| 0.375 T-NOTE 240815 | 7,200,000.00  | 6,766,031.23  |  |
| 0.375 T-NOTE 240915 | 12,000,000.00 | 11,253,281.28 |  |
| 0.375 T-NOTE 250430 | 4,670,000.00  | 4,302,875.98  |  |
| 0.375 T-NOTE 251130 | 10,150,000.00 | 9,202,402.29  |  |
| 0.375 T-NOTE 251231 | 7,300,000.00  | 6,614,626.94  |  |
| 0.375 T-NOTE 260131 | 7,700,000.00  | 6,947,896.49  |  |
| 0.375 T-NOTE 270731 | 7,150,000.00  | 6,200,669.90  |  |
| 0.375 T-NOTE 270930 | 7,300,000.00  | 6,303,949.22  |  |
| 0.5 T-NOTE 250331   | 6,500,000.00  | 6,026,845.69  |  |
| 0.5 T-NOTE 260228   | 7,900,000.00  | 7,141,167.94  |  |
| 0.5 T-NOTE 270430   | 7,780,000.00  | 6,830,900.76  |  |
| 0.5 T-NOTE 270531   | 4,280,000.00  | 3,748,510.92  |  |
| 0.5 T-NOTE 270630   | 4,700,000.00  | 4,109,195.33  |  |
| 0.5 T-NOTE 270831   | 4,950,000.00  | 4,308,820.31  |  |
| 0.5 T-NOTE 271031   | 5,900,000.00  | 5,111,796.87  |  |
| 0.625 T-NOTE 241015 | 7,400,000.00  | 6,953,109.41  |  |
| 0.625 T-NOTE 260731 | 7,930,000.00  | 7,125,228.86  |  |
| 0.625 T-NOTE 270331 | 1,800,000.00  | 1,593,140.61  |  |
| 0.625 T-NOTE 271130 | 7,550,000.00  | 6,567,910.18  |  |
| 0.625 T-NOTE 271231 | 7,630,000.00  | 6,624,687.90  |  |
| 0.625 T-NOTE 300515 | 11,390,000.00 | 9,355,817.18  |  |
| 0.625 T-NOTE 300815 | 15,160,000.00 | 12,393,892.13 |  |
| 0.75 T-NOTE 241115  | 6,700,000.00  | 6,293,812.50  |  |
| 0.75 T-NOTE 260331  | 13,100,000.00 | 11,923,302.71 |  |
| 0.75 T-NOTE 260430  | 7,000,000.00  | 6,354,414.08  |  |
| 0.75 T-NOTE 260531  | 8,200,000.00  | 7,429,007.79  |  |
| 0.75 T-NOTE 260831  | 7,600,000.00  | 6,847,125.00  |  |
| 0.75 T-NOTE 280131  | 8,050,000.00  | 7,021,109.37  |  |
| 0.875 T-NOTE 260630 | 8,300,000.00  | 7,541,003.92  |  |
| 0.875 T-NOTE 260930 | 10,000,000.00 | 9,033,203.10  |  |
| 0.875 T-NOTE 301115 | 16,180,000.00 | 13,432,560.11 |  |
| 1 T-NOTE 241215     | 8,000,000.00  | 7,538,124.96  |  |
| 1 T-NOTE 280731     | 9,150,000.00  | 7,990,880.83  |  |
| 1.125 T-BOND 400515 | 6,320,000.00  | 4,243,040.63  |  |
| 1.125 T-BOND 400815 | 7,250,000.00  | 4,840,224.62  |  |
| 1.125 T-NOTE 250115 | 6,000,000.00  | 5,657,109.36  |  |
|                     |               |               |  |

|                     |               |               |
|---------------------|---------------|---------------|
| 1.125 T-NOTE 250228 | 4,150,000.00  | 3,904,566.42  |
| 1.125 T-NOTE 261031 | 7,600,000.00  | 6,918,968.70  |
| 1.125 T-NOTE 270228 | 2,950,000.00  | 2,673,322.27  |
| 1.125 T-NOTE 280229 | 7,160,000.00  | 6,356,737.50  |
| 1.125 T-NOTE 280831 | 11,300,000.00 | 9,919,722.61  |
| 1.125 T-NOTE 310215 | 17,460,000.00 | 14,759,156.25 |
| 1.25 T-BOND 500515  | 8,580,000.00  | 5,055,664.43  |
| 1.25 T-NOTE 240831  | 9,500,000.00  | 9,042,812.50  |
| 1.25 T-NOTE 261130  | 7,300,000.00  | 6,667,523.47  |
| 1.25 T-NOTE 261231  | 8,200,000.00  | 7,478,976.54  |
| 1.25 T-NOTE 280331  | 9,950,000.00  | 8,872,990.20  |
| 1.25 T-NOTE 280430  | 8,150,000.00  | 7,255,728.53  |
| 1.25 T-NOTE 280531  | 11,250,000.00 | 9,994,043.02  |
| 1.25 T-NOTE 280630  | 8,480,000.00  | 7,524,343.77  |
| 1.25 T-NOTE 280930  | 8,000,000.00  | 7,061,875.04  |
| 1.25 T-NOTE 310815  | 16,020,000.00 | 13,501,230.50 |
| 1.375 T-BOND 401115 | 8,100,000.00  | 5,645,003.88  |
| 1.375 T-BOND 500815 | 9,880,000.00  | 6,009,046.81  |
| 1.375 T-NOTE 250131 | 5,320,000.00  | 5,037,167.20  |
| 1.375 T-NOTE 260831 | 2,000,000.00  | 1,843,125.00  |
| 1.375 T-NOTE 281031 | 6,950,000.00  | 6,169,210.93  |
| 1.375 T-NOTE 281231 | 7,400,000.00  | 6,555,937.50  |
| 1.375 T-NOTE 311115 | 16,700,000.00 | 14,137,593.75 |
| 1.5 T-NOTE 240930   | 6,000,000.00  | 5,727,187.50  |
| 1.5 T-NOTE 241031   | 4,100,000.00  | 3,906,531.25  |
| 1.5 T-NOTE 241130   | 3,930,000.00  | 3,740,561.73  |
| 1.5 T-NOTE 250215   | 6,300,000.00  | 5,974,664.09  |
| 1.5 T-NOTE 260815   | 9,740,000.00  | 9,021,675.00  |
| 1.5 T-NOTE 270131   | 9,540,000.00  | 8,776,986.30  |
| 1.5 T-NOTE 281130   | 7,650,000.00  | 6,832,406.25  |
| 1.5 T-NOTE 300215   | 8,740,000.00  | 7,698,710.97  |
| 1.625 T-BOND 501115 | 10,140,000.00 | 6,585,850.80  |
| 1.625 T-NOTE 260215 | 9,760,000.00  | 9,143,137.54  |
| 1.625 T-NOTE 260515 | 10,170,000.00 | 9,499,018.38  |
| 1.625 T-NOTE 260930 | 2,100,000.00  | 1,951,769.52  |
| 1.625 T-NOTE 261031 | 2,450,000.00  | 2,273,236.32  |
| 1.625 T-NOTE 261130 | 3,400,000.00  | 3,153,167.95  |
| 1.625 T-NOTE 290815 | 8,450,000.00  | 7,551,527.38  |
| 1.625 T-NOTE 310515 | 15,460,000.00 | 13,502,136.01 |
| 1.75 T-BOND 410815  | 11,870,000.00 | 8,714,944.72  |
| 1.75 T-NOTE 240731  | 5,150,000.00  | 4,948,224.59  |
| 1.75 T-NOTE 241231  | 3,350,000.00  | 3,201,082.04  |
| 1.75 T-NOTE 250315  | 9,030,000.00  | 8,600,722.28  |

|                     |               |               |  |
|---------------------|---------------|---------------|--|
| 1.75 T-NOTE 261231  | 4,300,000.00  | 4,005,970.68  |  |
| 1.75 T-NOTE 290131  | 6,000,000.00  | 5,424,140.64  |  |
| 1.75 T-NOTE 291115  | 5,150,000.00  | 4,633,390.62  |  |
| 1.875 T-BOND 410215 | 9,900,000.00  | 7,488,808.56  |  |
| 1.875 T-BOND 510215 | 10,510,000.00 | 7,270,579.84  |  |
| 1.875 T-BOND 511115 | 9,650,000.00  | 6,649,076.19  |  |
| 1.875 T-NOTE 260630 | 3,500,000.00  | 3,294,511.71  |  |
| 1.875 T-NOTE 260731 | 2,500,000.00  | 2,349,121.10  |  |
| 1.875 T-NOTE 270228 | 7,700,000.00  | 7,182,957.01  |  |
| 1.875 T-NOTE 290228 | 5,800,000.00  | 5,275,960.95  |  |
| 1.875 T-NOTE 320215 | 17,060,000.00 | 15,024,128.85 |  |
| 2 T-BOND 411115     | 9,100,000.00  | 6,964,699.19  |  |
| 2 T-BOND 500215     | 7,640,000.00  | 5,476,328.15  |  |
| 2 T-BOND 510815     | 10,840,000.00 | 7,716,513.28  |  |
| 2 T-NOTE 240430     | 5,200,000.00  | 5,034,656.22  |  |
| 2 T-NOTE 240531     | 11,730,000.00 | 11,339,610.93 |  |
| 2 T-NOTE 240630     | 7,000,000.00  | 6,756,367.17  |  |
| 2 T-NOTE 250215     | 8,110,000.00  | 7,768,809.78  |  |
| 2 T-NOTE 250815     | 7,690,000.00  | 7,324,424.62  |  |
| 2 T-NOTE 261115     | 10,450,000.00 | 9,824,836.90  |  |
| 2.125 T-NOTE 240229 | 7,550,000.00  | 7,345,914.06  |  |
| 2.125 T-NOTE 240331 | 10,160,000.00 | 9,869,884.34  |  |
| 2.125 T-NOTE 240731 | 3,450,000.00  | 3,333,427.74  |  |
| 2.125 T-NOTE 240930 | 6,800,000.00  | 6,559,343.78  |  |
| 2.125 T-NOTE 241130 | 1,900,000.00  | 1,829,269.53  |  |
| 2.125 T-NOTE 250515 | 6,970,000.00  | 6,677,314.43  |  |
| 2.125 T-NOTE 260531 | 5,000,000.00  | 4,745,117.20  |  |
| 2.25 T-BOND 410515  | 8,390,000.00  | 6,738,874.17  |  |
| 2.25 T-BOND 460815  | 4,740,000.00  | 3,632,395.28  |  |
| 2.25 T-BOND 490815  | 5,930,000.00  | 4,504,946.87  |  |
| 2.25 T-BOND 520215  | 9,250,000.00  | 6,977,607.43  |  |
| 2.25 T-NOTE 231231  | 4,190,000.00  | 4,095,746.15  |  |
| 2.25 T-NOTE 240131  | 2,650,000.00  | 2,585,222.94  |  |
| 2.25 T-NOTE 240430  | 7,600,000.00  | 7,380,906.28  |  |
| 2.25 T-NOTE 241031  | 9,380,000.00  | 9,056,096.87  |  |
| 2.25 T-NOTE 241115  | 6,450,000.00  | 6,228,281.25  |  |
| 2.25 T-NOTE 241231  | 6,900,000.00  | 6,653,109.37  |  |
| 2.25 T-NOTE 251115  | 10,290,000.00 | 9,845,841.82  |  |
| 2.25 T-NOTE 270215  | 4,010,000.00  | 3,801,198.05  |  |
| 2.25 T-NOTE 270815  | 6,190,000.00  | 5,844,834.95  |  |
| 2.25 T-NOTE 271115  | 5,790,000.00  | 5,453,456.25  |  |
| 2.375 T-BOND 420215 | 7,330,000.00  | 5,968,509.72  |  |
|                     |               |               |  |

|                     |               |               |
|---------------------|---------------|---------------|
| 2.375 T-BOND 491115 | 6,600,000.00  | 5,149,804.70  |
| 2.375 T-BOND 510515 | 11,520,000.00 | 8,955,449.96  |
| 2.375 T-NOTE 240229 | 3,750,000.00  | 3,658,959.97  |
| 2.375 T-NOTE 240815 | 7,590,000.00  | 7,355,925.61  |
| 2.375 T-NOTE 270515 | 7,070,000.00  | 6,718,571.29  |
| 2.375 T-NOTE 290331 | 5,600,000.00  | 5,240,156.26  |
| 2.375 T-NOTE 290515 | 9,180,000.00  | 8,585,092.94  |
| 2.5 T-BOND 450215   | 4,650,000.00  | 3,775,854.48  |
| 2.5 T-BOND 460215   | 4,030,000.00  | 3,251,548.83  |
| 2.5 T-BOND 460515   | 3,830,000.00  | 3,088,685.53  |
| 2.5 T-NOTE 240131   | 8,100,000.00  | 7,922,885.88  |
| 2.5 T-NOTE 240430   | 8,000,000.00  | 7,793,281.28  |
| 2.5 T-NOTE 240515   | 11,950,000.00 | 11,635,612.34 |
| 2.5 T-NOTE 240531   | 6,000,000.00  | 5,839,687.50  |
| 2.5 T-NOTE 250131   | 3,350,000.00  | 3,244,134.77  |
| 2.5 T-NOTE 260228   | 3,450,000.00  | 3,317,525.38  |
| 2.5 T-NOTE 270331   | 9,200,000.00  | 8,794,625.00  |
| 2.625 T-NOTE 250331 | 1,960,000.00  | 1,902,042.19  |
| 2.625 T-NOTE 250415 | 4,000,000.00  | 3,878,125.00  |
| 2.625 T-NOTE 251231 | 2,300,000.00  | 2,224,441.41  |
| 2.625 T-NOTE 260131 | 3,900,000.00  | 3,769,136.70  |
| 2.625 T-NOTE 270531 | 7,900,000.00  | 7,586,314.46  |
| 2.625 T-NOTE 290215 | 10,420,000.00 | 9,901,035.11  |
| 2.625 T-NOTE 290731 | 4,500,000.00  | 4,266,914.04  |
| 2.75 T-BOND 420815  | 1,720,000.00  | 1,482,693.75  |
| 2.75 T-BOND 421115  | 3,100,000.00  | 2,667,210.92  |
| 2.75 T-BOND 470815  | 4,560,000.00  | 3,844,471.88  |
| 2.75 T-BOND 471115  | 5,110,000.00  | 4,307,769.90  |
| 2.75 T-NOTE 240215  | 9,260,000.00  | 9,073,817.05  |
| 2.75 T-NOTE 250228  | 3,440,000.00  | 3,346,743.73  |
| 2.75 T-NOTE 250515  | 6,400,000.00  | 6,219,500.03  |
| 2.75 T-NOTE 250630  | 2,370,000.00  | 2,303,158.60  |
| 2.75 T-NOTE 250831  | 8,250,000.00  | 8,005,400.37  |
| 2.75 T-NOTE 270430  | 5,300,000.00  | 5,115,742.21  |
| 2.75 T-NOTE 270731  | 7,650,000.00  | 7,380,307.58  |
| 2.75 T-NOTE 280215  | 9,990,000.00  | 9,614,204.26  |
| 2.75 T-NOTE 290531  | 4,600,000.00  | 4,397,132.82  |
| 2.75 T-NOTE 320815  | 15,810,000.00 | 14,930,568.75 |
| 2.875 T-BOND 430515 | 4,330,000.00  | 3,792,132.81  |
| 2.875 T-BOND 450815 | 3,500,000.00  | 3,029,414.07  |
| 2.875 T-BOND 461115 | 2,340,000.00  | 2,021,540.62  |
| 2.875 T-BOND 490515 | 7,270,000.00  | 6,293,803.73  |
| 2.875 T-BOND 520515 | 8,920,000.00  | 7,717,193.75  |

|                     |               |               |  |
|---------------------|---------------|---------------|--|
| 2.875 T-NOTE 250430 | 6,000,000.00  | 5,846,718.72  |  |
| 2.875 T-NOTE 250531 | 4,230,000.00  | 4,121,936.69  |  |
| 2.875 T-NOTE 250615 | 7,800,000.00  | 7,602,867.16  |  |
| 2.875 T-NOTE 250731 | 6,100,000.00  | 5,945,117.21  |  |
| 2.875 T-NOTE 251130 | 3,800,000.00  | 3,697,578.14  |  |
| 2.875 T-NOTE 280515 | 7,490,000.00  | 7,239,260.56  |  |
| 2.875 T-NOTE 280815 | 9,110,000.00  | 8,795,954.06  |  |
| 2.875 T-NOTE 290430 | 7,000,000.00  | 6,740,781.25  |  |
| 2.875 T-NOTE 320515 | 13,830,000.00 | 13,220,615.62 |  |
| 3 T-BOND 420515     | 1,170,000.00  | 1,052,405.86  |  |
| 3 T-BOND 441115     | 3,560,000.00  | 3,160,195.29  |  |
| 3 T-BOND 450515     | 1,490,000.00  | 1,318,999.22  |  |
| 3 T-BOND 451115     | 1,700,000.00  | 1,502,707.02  |  |
| 3 T-BOND 470215     | 4,210,000.00  | 3,717,298.42  |  |
| 3 T-BOND 470515     | 3,790,000.00  | 3,346,007.41  |  |
| 3 T-BOND 480215     | 5,050,000.00  | 4,459,978.48  |  |
| 3 T-BOND 480815     | 6,260,000.00  | 5,533,497.63  |  |
| 3 T-BOND 490215     | 6,690,000.00  | 5,929,273.80  |  |
| 3 T-BOND 520815     | 8,170,000.00  | 7,257,896.09  |  |
| 3 T-NOTE 240630     | 4,100,000.00  | 4,014,156.25  |  |
| 3 T-NOTE 240731     | 6,000,000.00  | 5,873,906.28  |  |
| 3 T-NOTE 250715     | 6,700,000.00  | 6,546,109.37  |  |
| 3 T-NOTE 250930     | 5,400,000.00  | 5,273,226.57  |  |
| 3 T-NOTE 251031     | 6,800,000.00  | 6,638,765.60  |  |
| 3.125 T-BOND 411115 | 1,990,000.00  | 1,835,969.34  |  |
| 3.125 T-BOND 420215 | 2,500,000.00  | 2,299,218.75  |  |
| 3.125 T-BOND 430215 | 2,850,000.00  | 2,602,740.22  |  |
| 3.125 T-BOND 440815 | 4,130,000.00  | 3,746,119.70  |  |
| 3.125 T-BOND 480515 | 6,010,000.00  | 5,433,180.86  |  |
| 3.125 T-NOTE 250815 | 5,000,000.00  | 4,899,023.44  |  |
| 3.125 T-NOTE 270831 | 7,300,000.00  | 7,158,134.77  |  |
| 3.125 T-NOTE 281115 | 10,280,000.00 | 10,053,518.75 |  |
| 3.125 T-NOTE 290831 | 5,900,000.00  | 5,762,640.62  |  |
| 3.25 T-BOND 420515  | 6,580,000.00  | 6,143,046.87  |  |
| 3.25 T-NOTE 240831  | 7,400,000.00  | 7,270,210.95  |  |
| 3.25 T-NOTE 270630  | 5,500,000.00  | 5,418,251.96  |  |
| 3.25 T-NOTE 290630  | 6,700,000.00  | 6,591,648.40  |  |
| 3.375 T-BOND 420815 | 6,300,000.00  | 5,992,875.00  |  |
| 3.375 T-BOND 440515 | 3,160,000.00  | 2,984,718.75  |  |
| 3.375 T-BOND 481115 | 6,620,000.00  | 6,270,122.67  |  |
| 3.5 T-BOND 390215   | 760,000.00    | 756,764.05    |  |
| 3.5 T-NOTE 250915   | 5,100,000.00  | 5,045,812.50  |  |
|                     |               |               |  |



|          |      |                      |                  |                                       |  |
|----------|------|----------------------|------------------|---------------------------------------|--|
|          |      | 3.625 T-BOND 430815  | 3,800,000.00     | 3,738,992.17                          |  |
|          |      | 3.625 T-BOND 440215  | 3,770,000.00     | 3,700,637.86                          |  |
|          |      | 3.75 T-BOND 410815   | 1,560,000.00     | 1,578,890.63                          |  |
|          |      | 3.75 T-BOND 431115   | 3,030,000.00     | 3,032,840.62                          |  |
|          |      | 3.875 T-BOND 400815  | 1,610,000.00     | 1,668,551.17                          |  |
|          |      | 3.875 T-NOTE 271130  | 6,900,000.00     | 6,997,839.86                          |  |
|          |      | 3.875 T-NOTE 290930  | 4,300,000.00     | 4,389,863.28                          |  |
|          |      | 3.875 T-NOTE 291130  | 5,100,000.00     | 5,210,765.62                          |  |
|          |      | 4 T-BOND 421115      | 2,170,000.00     | 2,255,613.26                          |  |
|          |      | 4 T-BOND 521115      | 5,700,000.00     | 6,113,695.28                          |  |
|          |      | 4 T-NOTE 251215      | 5,700,000.00     | 5,722,933.60                          |  |
|          |      | 4 T-NOTE 291031      | 5,500,000.00     | 5,658,125.00                          |  |
|          |      | 4.125 T-NOTE 270930  | 5,900,000.00     | 6,034,478.52                          |  |
|          |      | 4.125 T-NOTE 271031  | 6,500,000.00     | 6,651,582.01                          |  |
|          |      | 4.125 T-NOTE 321115  | 7,800,000.00     | 8,235,093.74                          |  |
|          |      | 4.25 T-BOND 390515   | 1,770,000.00     | 1,928,781.44                          |  |
|          |      | 4.25 T-BOND 401115   | 2,180,000.00     | 2,365,725.77                          |  |
|          |      | 4.25 T-NOTE 251015   | 6,000,000.00     | 6,050,156.28                          |  |
|          |      | 4.375 T-BOND 380215  | 1,000,000.00     | 1,103,476.56                          |  |
|          |      | 4.375 T-BOND 391115  | 1,930,000.00     | 2,131,292.97                          |  |
|          |      | 4.375 T-BOND 400515  | 2,080,000.00     | 2,293,118.75                          |  |
|          |      | 4.375 T-BOND 410515  | 1,510,000.00     | 1,665,305.85                          |  |
|          |      | 4.375 T-NOTE 241031  | 4,000,000.00     | 4,004,375.00                          |  |
|          |      | 4.5 T-BOND 360215    | 1,160,000.00     | 1,295,416.40                          |  |
|          |      | 4.5 T-BOND 380515    | 1,530,000.00     | 1,711,089.84                          |  |
|          |      | 4.5 T-BOND 390815    | 1,880,000.00     | 2,108,610.93                          |  |
|          |      | 4.5 T-NOTE 241130    | 9,000,000.00     | 9,037,617.21                          |  |
|          |      | 4.5 T-NOTE 251115    | 8,700,000.00     | 8,836,617.14                          |  |
|          |      | 4.625 T-BOND 400215  | 1,670,000.00     | 1,901,842.96                          |  |
|          |      | 4.75 T-BOND 410215   | 2,310,000.00     | 2,667,869.53                          |  |
|          |      | 5 T-BOND 370515      | 1,270,000.00     | 1,487,735.53                          |  |
|          |      | 5.25 T-BOND 281115   | 2,690,000.00     | 2,926,320.69                          |  |
|          |      | 6 T-BOND 260215      | 2,900,000.00     | 3,080,683.60                          |  |
|          |      | 6.125 T-BOND 271115  | 3,860,000.00     | 4,288,520.29                          |  |
|          |      | 6.25 T-BOND 300515   | 1,150,000.00     | 1,351,699.21                          |  |
| アメリカドル合計 |      |                      | 1,624,650,000.00 | 1,478,845,281.06<br>(191,170,329,482) |  |
| カナダドル    | 国債証券 | 0.25 CAN GOVT 240401 | 3,850,000.00     | 3,680,854.10                          |  |
|          |      | 0.25 CAN GOVT 260301 | 2,200,000.00     | 2,012,656.80                          |  |
|          |      | 0.5 CAN GOVT 250901  | 2,900,000.00     | 2,697,783.00                          |  |
|          |      | 0.5 CAN GOVT 301201  | 6,800,000.00     | 5,721,452.00                          |  |
|          |      | 0.75 CAN GOVT 241001 | 3,500,000.00     | 3,330,887.00                          |  |

|                       |              |                          |              |                       |               |                                  |  |
|-----------------------|--------------|--------------------------|--------------|-----------------------|---------------|----------------------------------|--|
|                       |              | 1 CAN GOVT 270601        | 1,930,000.00 | 1,787,577.58          |               |                                  |  |
|                       |              | 1.25 CAN GOVT 250301     | 2,100,000.00 | 2,005,913.70          |               |                                  |  |
|                       |              | 1.25 CAN GOVT 270301     | 2,500,000.00 | 2,339,400.00          |               |                                  |  |
|                       |              | 1.25 CAN GOVT 300601     | 3,510,000.00 | 3,162,004.56          |               |                                  |  |
|                       |              | 1.5 CAN GOVT 240901      | 2,000,000.00 | 1,930,262.00          |               |                                  |  |
|                       |              | 1.5 CAN GOVT 250401      | 1,000,000.00 | 958,881.00            |               |                                  |  |
|                       |              | 1.5 CAN GOVT 260601      | 4,070,000.00 | 3,873,769.02          |               |                                  |  |
|                       |              | 1.5 CAN GOVT 310601      | 4,400,000.00 | 3,983,196.80          |               |                                  |  |
|                       |              | 1.5 CAN GOVT 311201      | 4,270,000.00 | 3,841,454.26          |               |                                  |  |
|                       |              | 1.75 CAN GOVT 531201     | 4,100,000.00 | 3,122,268.90          |               |                                  |  |
|                       |              | 2 CAN GOVT 280601        | 670,000.00   | 644,679.36            |               |                                  |  |
|                       |              | 2 CAN GOVT 320601        | 3,750,000.00 | 3,506,070.00          |               |                                  |  |
|                       |              | 2 CAN GOVT 511201        | 6,060,000.00 | 4,951,353.30          |               |                                  |  |
|                       |              | 2.25 CAN GOVT 240301     | 2,250,000.00 | 2,203,701.75          |               |                                  |  |
|                       |              | 2.25 CAN GOVT 250601     | 4,360,000.00 | 4,255,155.08          |               |                                  |  |
|                       |              | 2.25 CAN GOVT 290601     | 2,210,000.00 | 2,146,721.07          |               |                                  |  |
|                       |              | 2.25 CAN GOVT 291201     | 1,000,000.00 | 969,707.00            |               |                                  |  |
|                       |              | 2.5 CAN GOVT 240601      | 4,000,000.00 | 3,924,008.00          |               |                                  |  |
|                       |              | 2.5 CAN GOVT 321201      | 2,800,000.00 | 2,727,538.80          |               |                                  |  |
|                       |              | 2.75 CAN GOVT 270901     | 1,000,000.00 | 993,924.00            |               |                                  |  |
|                       |              | 2.75 CAN GOVT 481201     | 1,380,000.00 | 1,331,424.00          |               |                                  |  |
|                       |              | 2.75 CANADA GOVER 641201 | 1,150,000.00 | 1,098,957.25          |               |                                  |  |
|                       |              | 3 CAN GOVT 251001        | 3,000,000.00 | 2,976,567.00          |               |                                  |  |
|                       |              | 3.5 CAN GOVT 451201      | 1,650,000.00 | 1,796,986.95          |               |                                  |  |
|                       |              | 4 CAN GOVT 410601        | 1,200,000.00 | 1,374,704.40          |               |                                  |  |
|                       |              | 5 CAN GOVT 370601        | 830,000.00   | 1,027,652.05          |               |                                  |  |
|                       |              | 5.75 CAN GOVT 290601     | 950,000.00   | 1,113,550.10          |               |                                  |  |
|                       |              | 5.75 CAN GOVT 330601     | 930,000.00   | 1,168,404.57          |               |                                  |  |
|                       |              | カナダドル合計                  |              |                       | 88,320,000.00 | 82,659,465.40<br>(7,977,465,005) |  |
|                       |              | オーストラリアドル                | 国債証券         | 0.25 AUST GOVT 241121 | 600,000.00    | 569,818.81                       |  |
| 0.25 AUST GOVT 251121 | 5,450,000.00 |                          |              | 5,031,656.96          |               |                                  |  |
| 0.5 AUST GOVT 260921  | 2,100,000.00 |                          |              | 1,908,502.44          |               |                                  |  |
| 1 AUST GOVT 301221    | 3,010,000.00 |                          |              | 2,507,726.44          |               |                                  |  |
| 1 AUST GOVT 311121    | 4,250,000.00 |                          |              | 3,456,308.37          |               |                                  |  |
| 1.25 AUST GOVT 320521 | 4,530,000.00 |                          |              | 3,729,153.57          |               |                                  |  |
| 1.5 AUST GOVT 310621  | 3,290,000.00 |                          |              | 2,823,940.44          |               |                                  |  |
| 1.75 AUST GOVT 321121 | 3,380,000.00 |                          |              | 2,891,199.44          |               |                                  |  |
| 1.75 AUST GOVT 510621 | 2,680,000.00 |                          |              | 1,699,346.27          |               |                                  |  |
| 2.25 AUST GOVT 280521 | 1,900,000.00 |                          |              | 1,808,949.54          |               |                                  |  |
| 2.5 AUST GOVT 300521  | 3,940,000.00 |                          |              | 3,716,663.14          |               |                                  |  |
| 2.75 AUST GOVT 240421 | 200,000.00   |                          |              | 198,885.33            |               |                                  |  |

|             |      |                       |               |                                  |  |
|-------------|------|-----------------------|---------------|----------------------------------|--|
|             |      | 2.75 AUST GOVT 271121 | 2,490,000.00  | 2,438,743.84                     |  |
|             |      | 2.75 AUST GOVT 281121 | 1,940,000.00  | 1,887,101.78                     |  |
|             |      | 2.75 AUST GOVT 291121 | 2,980,000.00  | 2,872,397.32                     |  |
|             |      | 2.75 AUST GOVT 350621 | 1,520,000.00  | 1,385,164.37                     |  |
|             |      | 2.75 AUST GOVT 410521 | 1,370,000.00  | 1,165,320.46                     |  |
|             |      | 3 AUST GOVT 331121    | 2,800,000.00  | 2,665,347.35                     |  |
|             |      | 3 AUST GOVT 470321    | 2,020,000.00  | 1,729,319.61                     |  |
|             |      | 3.25 AUST GOVT 250421 | 5,460,000.00  | 5,479,553.89                     |  |
|             |      | 3.25 AUST GOVT 290421 | 2,660,000.00  | 2,652,640.06                     |  |
|             |      | 3.25 AUST GOVT 390621 | 2,130,000.00  | 1,978,625.73                     |  |
|             |      | 3.75 AUST GOVT 340521 | 1,700,000.00  | 1,730,326.13                     |  |
|             |      | 3.75 AUST GOVT 370421 | 2,150,000.00  | 2,153,135.56                     |  |
|             |      | 4.25 AUST GOVT 260421 | 4,490,000.00  | 4,642,042.16                     |  |
|             |      | 4.5 AUST GOVT 330421  | 3,100,000.00  | 3,363,456.27                     |  |
|             |      | 4.75 AUST GOVT 270421 | 3,050,000.00  | 3,237,644.84                     |  |
|             |      | オーストラリアドル合計           | 75,190,000.00 | 69,722,970.12<br>(6,405,449,264) |  |
| イギリス<br>ポンド | 国債証券 | 0.125 GILT 240131     | 2,000,000.00  | 1,933,627.20                     |  |
|             |      | 0.125 GILT 260130     | 2,600,000.00  | 2,382,120.00                     |  |
|             |      | 0.125 GILT 280131     | 2,300,000.00  | 1,975,884.00                     |  |
|             |      | 0.25 GILT 250131      | 4,100,000.00  | 3,843,340.00                     |  |
|             |      | 0.25 GILT 310731      | 3,460,000.00  | 2,690,842.00                     |  |
|             |      | 0.375 GILT 261022     | 3,750,000.00  | 3,379,852.50                     |  |
|             |      | 0.375 GILT 301022     | 1,790,000.00  | 1,444,888.00                     |  |
|             |      | 0.5 GILT 290131       | 3,250,000.00  | 2,763,637.50                     |  |
|             |      | 0.5 GILT 611022       | 2,550,000.00  | 982,387.50                       |  |
|             |      | 0.625 GILT 250607     | 2,880,000.00  | 2,716,272.00                     |  |
|             |      | 0.625 GILT 350731     | 2,730,000.00  | 1,940,729.70                     |  |
|             |      | 0.625 GILT 501022     | 1,590,000.00  | 768,062.22                       |  |
|             |      | 0.875 GILT 291022     | 1,820,000.00  | 1,568,203.00                     |  |
|             |      | 0.875 GILT 330731     | 2,350,000.00  | 1,829,921.50                     |  |
|             |      | 0.875 GILT 460131     | 2,020,000.00  | 1,145,946.00                     |  |
|             |      | 1 GILT 240422         | 1,700,000.00  | 1,651,346.00                     |  |
|             |      | 1 GILT 320131         | 5,800,000.00  | 4,763,642.08                     |  |
|             |      | 1.125 GILT 390131     | 2,650,000.00  | 1,841,962.00                     |  |
|             |      | 1.125 GILT 731022     | 1,500,000.00  | 710,835.84                       |  |
|             |      | 1.25 GILT 270722      | 2,100,000.00  | 1,935,473.40                     |  |
|             |      | 1.25 GILT 411022      | 3,750,000.00  | 2,526,499.50                     |  |
|             |      | 1.25 GILT 510731      | 3,480,000.00  | 2,025,488.76                     |  |
|             |      | 1.5 GILT 260722       | 2,490,000.00  | 2,355,739.20                     |  |
|             |      | 1.5 GILT 470722       | 2,360,000.00  | 1,536,360.00                     |  |
|             |      | 1.5 GILT 530731       | 1,250,000.00  | 766,500.00                       |  |

|                  |      |                          |                |                                    |  |
|------------------|------|--------------------------|----------------|------------------------------------|--|
|                  |      | 1.625 GILT 281022        | 1,790,000.00   | 1,648,590.00                       |  |
|                  |      | 1.625 GILT 541022        | 2,060,000.00   | 1,298,644.60                       |  |
|                  |      | 1.625 GILT 711022        | 1,730,000.00   | 1,025,284.50                       |  |
|                  |      | 1.75 GILT 370907         | 3,340,000.00   | 2,639,268.00                       |  |
|                  |      | 1.75 GILT 490122         | 1,780,000.00   | 1,216,986.00                       |  |
|                  |      | 1.75 GILT 570722         | 2,830,000.00   | 1,831,010.00                       |  |
|                  |      | 2 GILT 250907            | 2,100,000.00   | 2,039,205.00                       |  |
|                  |      | 2.5 GILT 650722          | 2,480,000.00   | 1,956,816.22                       |  |
|                  |      | 2.75 GILT 240907         | 4,400,000.00   | 4,355,530.96                       |  |
|                  |      | 3.25 GILT 440122         | 2,760,000.00   | 2,577,381.84                       |  |
|                  |      | 3.5 GILT 450122          | 3,190,000.00   | 3,090,472.00                       |  |
|                  |      | 3.5 GILT 680722          | 2,250,000.00   | 2,266,515.00                       |  |
|                  |      | 3.75 GILT 380129         | 750,000.00     | 758,677.50                         |  |
|                  |      | 3.75 GILT 520722         | 2,160,000.00   | 2,204,608.32                       |  |
|                  |      | 4 GILT 600122            | 1,980,000.00   | 2,169,189.00                       |  |
|                  |      | 4.125 GILT 270129        | 1,000,000.00   | 1,028,100.00                       |  |
|                  |      | 4.25 GILT 271207         | 2,450,000.00   | 2,567,693.10                       |  |
|                  |      | 4.25 GILT 320607         | 2,770,000.00   | 2,989,799.50                       |  |
|                  |      | 4.25 GILT 360307         | 2,410,000.00   | 2,590,424.65                       |  |
|                  |      | 4.25 GILT 390907         | 1,720,000.00   | 1,842,928.40                       |  |
|                  |      | 4.25 GILT 401207         | 2,120,000.00   | 2,273,806.00                       |  |
|                  |      | 4.25 GILT 461207         | 2,430,000.00   | 2,636,037.27                       |  |
|                  |      | 4.25 GILT 491207         | 1,860,000.00   | 2,037,704.40                       |  |
|                  |      | 4.25 GILT 551207         | 2,360,000.00   | 2,649,991.13                       |  |
|                  |      | 4.5 GILT 340907          | 1,990,000.00   | 2,195,925.20                       |  |
|                  |      | 4.5 GILT 421207          | 2,540,000.00   | 2,827,058.10                       |  |
|                  |      | 4.75 GILT 301207         | 3,050,000.00   | 3,376,807.50                       |  |
|                  |      | 4.75 GILT 381207         | 2,360,000.00   | 2,675,768.00                       |  |
|                  |      | 5 GILT 250307            | 2,490,000.00   | 2,582,493.54                       |  |
|                  |      | 6 GILT 281207            | 1,890,000.00   | 2,164,125.60                       |  |
| イギリスポンド合計        |      |                          | 135,310,000.00 | 118,996,401.23<br>(19,087,022,757) |  |
| シンガ<br>ポールド<br>ル | 国債証券 | 1.25 SINGAPORGOVT 261101 | 700,000.00     | 662,550.00                         |  |
|                  |      | 1.625 SINGAPORGOV 310701 | 1,050,000.00   | 958,408.37                         |  |
|                  |      | 1.875 SINGAPORGOV 500301 | 700,000.00     | 599,200.00                         |  |
|                  |      | 1.875 SINGAPORGOV 511001 | 950,000.00     | 824,082.25                         |  |
|                  |      | 2.125 SINGAPORGOV 260601 | 1,530,000.00   | 1,494,657.00                       |  |
|                  |      | 2.25 SINGAPORGOVT 360801 | 1,300,000.00   | 1,215,799.00                       |  |
|                  |      | 2.375 SINGAPORGOV 250601 | 1,560,000.00   | 1,539,408.00                       |  |
|                  |      | 2.375 SINGAPORGOV 390701 | 380,000.00     | 361,190.00                         |  |
|                  |      | 2.625 SINGAPORGOV 280501 | 800,000.00     | 794,000.00                         |  |
|                  |      | 2.625 SINGAPORGOV 320801 | 100,000.00     | 98,546.41                          |  |

|                    |      |                          |               |                                  |               |
|--------------------|------|--------------------------|---------------|----------------------------------|---------------|
|                    |      | 2.75 SINGAPORGOVT 420401 | 980,000.00    | 987,276.50                       |               |
|                    |      | 2.75 SINGAPORGOVT 460301 | 1,140,000.00  | 1,154,820.00                     |               |
|                    |      | 2.875 SINGAPORGOV 270901 | 1,000,000.00  | 1,005,452.40                     |               |
|                    |      | 2.875 SINGAPORGOV 290701 | 920,000.00    | 923,680.00                       |               |
|                    |      | 2.875SINGAPORGOVT 300901 | 1,340,000.00  | 1,345,360.00                     |               |
|                    |      | 3 SINGAPORGOVT 240901    | 1,500,000.00  | 1,497,832.50                     |               |
|                    |      | 3 SINGAPORGOVT 720801    | 280,000.00    | 312,054.48                       |               |
|                    |      | 3.375 SINGAPORGOV 330901 | 780,000.00    | 821,730.00                       |               |
|                    |      | 3.5 SINGAPORGOVT 270301  | 1,000,000.00  | 1,026,800.00                     |               |
| シンガポールドル合計         |      |                          | 18,010,000.00 | 17,622,846.91<br>(1,735,321,735) |               |
| マレーシア<br>リン<br>ギット | 国債証券 | 2.632 MALAYSIAGOV 310415 | 2,800,000.00  | 2,585,922.08                     |               |
|                    |      | 3.478 MALAYSIAGOV 240614 | 1,300,000.00  | 1,306,360.64                     |               |
|                    |      | 3.502MALAYSIAGOV 270531  | 3,000,000.00  | 3,002,577.90                     |               |
|                    |      | 3.582 MALAYSIAGOV 320715 | 1,000,000.00  | 987,484.97                       |               |
|                    |      | 3.733 MALAYSIAGO 280615  | 2,800,000.00  | 2,822,184.12                     |               |
|                    |      | 3.757 MALAYSIAGOV 400522 | 3,230,000.00  | 3,078,025.23                     |               |
|                    |      | 3.828 MALAYSIAGOV 340705 | 2,300,000.00  | 2,281,931.29                     |               |
|                    |      | 3.844 MALAYSIAGOV 330415 | 2,400,000.00  | 2,389,734.52                     |               |
|                    |      | 3.882 MALAYSIAGOV 250314 | 2,410,000.00  | 2,437,558.83                     |               |
|                    |      | 3.885 MALAYSIAGOV 290815 | 3,600,000.00  | 3,639,665.16                     |               |
|                    |      | 3.892 MALAYSIAGOV 270315 | 1,500,000.00  | 1,523,830.95                     |               |
|                    |      | 3.899 MALAYSIAGOV 271116 | 3,040,000.00  | 3,094,425.42                     |               |
|                    |      | 3.9 MALAYSIAGOV 261130   | 1,100,000.00  | 1,116,890.61                     |               |
|                    |      | 3.906 MALAYSIAGOV 260715 | 1,400,000.00  | 1,423,962.68                     |               |
|                    |      | 3.955 MALAYSIAGOV 250915 | 4,270,000.00  | 4,332,438.07                     |               |
|                    |      | 4.059 MALAYSIAGOV 240930 | 2,000,000.00  | 2,028,419.40                     |               |
|                    |      | 4.065 MALAYSIAGOV 500615 | 4,050,000.00  | 3,888,087.15                     |               |
|                    |      | 4.181 MALAYSIAGOV 240715 | 2,500,000.00  | 2,537,353.00                     |               |
|                    |      | 4.232MALAYSIAGOV 310630  | 3,050,000.00  | 3,161,174.02                     |               |
|                    |      | 4.254 MALAYSIAGOV 350531 | 2,150,000.00  | 2,217,993.32                     |               |
|                    |      | 4.392 MALAYSIAGOV 260415 | 900,000.00    | 927,613.17                       |               |
|                    |      | 4.498 MALAYSIAGOV 300415 | 2,240,000.00  | 2,351,487.48                     |               |
|                    |      | 4.504 MALAYSIAGOV 290430 | 1,500,000.00  | 1,567,617.75                     |               |
|                    |      | 4.642 MALAYSIAGOV 331107 | 1,200,000.00  | 1,277,295.72                     |               |
|                    |      | 4.696 MALAYSIAGOV 421015 | 1,100,000.00  | 1,179,494.91                     |               |
|                    |      | 4.736 MALAYSIAGOV 460315 | 1,650,000.00  | 1,754,464.96                     |               |
|                    |      | 4.762 MALAYSIAGOV 370407 | 4,440,000.00  | 4,825,541.62                     |               |
|                    |      | 4.893 MALAYSIAGOV 380608 | 2,750,000.00  | 3,038,074.60                     |               |
|                    |      | 4.921 MALAYSIAGOV 480706 | 2,020,000.00  | 2,210,421.15                     |               |
|                    |      | 4.935 MALAYSIAGOV 430930 | 1,000,000.00  | 1,087,371.40                     |               |
|                    |      |                          |               |                                  | 68,700,000.00 |

|              |      |                         |               |                 |                 |
|--------------|------|-------------------------|---------------|-----------------|-----------------|
| マレーシアリングット合計 |      |                         |               | (2,127,608,336) |                 |
| ニュージーランドドル   | 国債証券 | 1.75 NZ GOVT 410515     | 600,000.00    | 403,023.55      |                 |
|              |      | 2 NZ GOVT 320515        | 1,600,000.00  | 1,349,644.72    |                 |
|              |      | 2.75 NZ GOVT 250415     | 2,000,000.00  | 1,928,908.12    |                 |
|              |      | 2.75 NZ GOVT 370415     | 1,450,000.00  | 1,214,345.69    |                 |
|              |      | 2.75 NZ GOVT 510515     | 680,000.00    | 507,890.20      |                 |
|              |      | 3 NZ GOVT 290420        | 1,700,000.00  | 1,605,902.68    |                 |
|              |      | 3.5 NZ GOVT 330414      | 800,000.00    | 761,171.23      |                 |
|              |      | 4.5 NZ GOVT 270415      | 1,800,000.00  | 1,829,623.32    |                 |
| ニュージーランドドル合計 |      |                         | 10,630,000.00 | 9,600,509.51    | (804,330,686)   |
| スウェーデンクローネ   | 国債証券 | 0.125 SWD GOVT 310512   | 9,450,000.00  | 8,126,121.15    |                 |
|              |      | 0.75 SWD GOVT 280512    | 8,000,000.00  | 7,461,605.51    |                 |
|              |      | 0.75 SWD GOVT 291112    | 12,200,000.00 | 11,239,727.50   |                 |
|              |      | 1 SWD GOVT 261112       | 11,960,000.00 | 11,430,755.88   |                 |
|              |      | 2.25 SWD GOVT 320601    | 6,750,000.00  | 6,928,875.00    |                 |
|              |      | 2.5 SWD GOVT 250512     | 8,840,000.00  | 8,838,942.46    |                 |
|              |      | 3.5 SWD GOVT 390330     | 6,470,000.00  | 7,979,167.61    |                 |
| スウェーデンクローネ合計 |      |                         | 63,670,000.00 | 62,005,195.11   | (785,605,822)   |
| ノルウェークローネ    | 国債証券 | 1.25 NORWE GOVT 310917  | 4,700,000.00  | 4,148,088.40    |                 |
|              |      | 1.375 NORWE GOVT 300819 | 8,770,000.00  | 7,947,505.55    |                 |
|              |      | 1.5 NORWE GOVT 260219   | 6,040,000.00  | 5,814,798.60    |                 |
|              |      | 1.75 NORWE GOVT 250313  | 10,200,000.00 | 9,953,486.40    |                 |
|              |      | 1.75 NORWE GOVT 270217  | 5,120,000.00  | 4,928,583.68    |                 |
|              |      | 1.75 NORWE GOVT 290906  | 4,600,000.00  | 4,326,629.36    |                 |
|              |      | 2 NORWE GOVT 280426     | 6,900,000.00  | 6,656,016.00    |                 |
|              |      | 2.125 NORWE GOVT 320518 | 5,500,000.00  | 5,191,167.30    |                 |
|              |      | 3 NORWE GOVT 240314     | 6,300,000.00  | 6,289,276.39    |                 |
| ノルウェークローネ合計  |      |                         | 58,130,000.00 | 55,255,551.68   | (721,637,504)   |
| デンマーククローネ    | 国債証券 | 0 DMK GOVT 241115       | 4,800,000.00  | 4,577,928.00    |                 |
|              |      | 0 DMK GOVT 311115       | 14,550,000.00 | 11,828,012.19   |                 |
|              |      | 0.25 DMK GOVT 521115    | 8,900,000.00  | 5,153,914.35    |                 |
|              |      | 0.5 DMK GOVT 271115     | 10,200,000.00 | 9,335,333.76    |                 |
|              |      | 0.5 DMK GOVT 291115     | 10,550,000.00 | 9,322,752.26    |                 |
|              |      | 1.75 DMK GOVT 251115    | 7,490,000.00  | 7,333,778.07    |                 |
|              |      | 4.5 DMK GOVT 391115     | 15,650,000.00 | 20,079,795.10   |                 |
| デンマーククローネ合計  |      |                         | 72,140,000.00 | 67,631,513.73   | (1,282,293,500) |
| メキシコペソ       | 国債証券 | 10 MEXICAN BONOS 241205 | 58,650,000.00 | 58,954,156.55   |                 |
|              |      | 10 MEXICAN BONOS 361120 | 12,350,000.00 | 13,753,454.00   |                 |

|               |      |                          |                |                                   |  |
|---------------|------|--------------------------|----------------|-----------------------------------|--|
|               |      | 5 MEXICAN BONOS 250306   | 14,000,000.00  | 12,730,060.00                     |  |
|               |      | 5.5 MEXICAN BONOS 270304 | 16,000,000.00  | 14,130,240.00                     |  |
|               |      | 5.75 MEXICAN BONO 260305 | 65,500,000.00  | 59,568,652.73                     |  |
|               |      | 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 48,750,000.00  | 46,529,925.00                     |  |
|               |      | 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 68,050,000.00  | 64,734,604.00                     |  |
|               |      | 7.75 MEXICAN BONO 341123 | 13,400,000.00  | 12,571,210.00                     |  |
|               |      | 7.75 MEXICAN BONO 421113 | 35,190,000.00  | 31,989,117.60                     |  |
|               |      | 8 MEXICAN BONOS 240905   | 12,000,000.00  | 11,607,095.64                     |  |
|               |      | 8 MEXICAN BONOS 471107   | 39,100,000.00  | 36,235,534.00                     |  |
|               |      | 8 MEXICAN BONOS 530731   | 13,000,000.00  | 12,062,909.30                     |  |
|               |      | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 39,150,000.00  | 38,978,914.50                     |  |
|               |      | 8.5 MEXICAN BONOS 381118 | 39,700,000.00  | 39,197,795.00                     |  |
| メキシコペソ合計      |      |                          | 474,840,000.00 | 453,043,668.32<br>(3,115,445,393) |  |
| イスラエル<br>シェケル | 国債証券 | 0.5 ISRAEL FIXED 250430  | 6,500,000.00   | 6,096,350.00                      |  |
|               |      | 1 ISRAEL FIXED BO 300331 | 3,370,000.00   | 2,906,793.50                      |  |
|               |      | 1.3 ISRAEL FIXED 320430  | 1,300,000.00   | 1,107,665.00                      |  |
|               |      | 1.5 ISRAEL FIXED 370531  | 2,400,000.00   | 1,909,320.00                      |  |
|               |      | 2.25 ISRAEL FIXED 280928 | 3,080,000.00   | 2,943,556.00                      |  |
|               |      | 3.75 ISRAEL FIXED 240331 | 6,250,000.00   | 6,443,125.00                      |  |
|               |      | 3.75 ISRAEL FIXED 470331 | 3,790,000.00   | 4,046,014.50                      |  |
|               |      | 5.5 ISRAEL FIXED 420131  | 3,130,000.00   | 4,004,052.50                      |  |
|               |      | 6.25 ISRAEL FIXED 261030 | 5,000,000.00   | 5,563,250.00                      |  |
| イスラエルシェケル合計   |      |                          | 34,820,000.00  | 35,020,126.50<br>(1,342,142,846)  |  |
| ポーランド<br>ズロチ  | 国債証券 | 0.25 POLAND 261025       | 3,000,000.00   | 2,443,410.00                      |  |
|               |      | 0.75 POLAND 250425       | 3,500,000.00   | 3,137,575.00                      |  |
|               |      | 1.25 POLAND 301025       | 5,890,000.00   | 4,236,735.90                      |  |
|               |      | 1.75 POLAND 320425       | 4,000,000.00   | 2,843,400.00                      |  |
|               |      | 2.25 POLAND 241025       | 4,000,000.00   | 3,761,144.00                      |  |
|               |      | 2.5 POLAND 240425        | 2,600,000.00   | 2,495,246.00                      |  |
|               |      | 2.5 POLAND 260725        | 7,840,000.00   | 7,006,576.64                      |  |
|               |      | 2.5 POLAND 270725        | 6,110,000.00   | 5,325,781.50                      |  |
|               |      | 2.75 POLAND 280425       | 5,760,000.00   | 4,965,307.77                      |  |
|               |      | 2.75 POLAND 291025       | 7,900,000.00   | 6,587,612.50                      |  |
|               |      | 3.25 POLAND 250725       | 8,700,000.00   | 8,165,472.00                      |  |
|               |      | 3.75 POLAND 270525       | 4,000,000.00   | 3,674,920.00                      |  |
|               |      | 5.75 POLAND 290425       | 1,450,000.00   | 1,451,667.50                      |  |
| ポーランドズロチ合計    |      |                          | 64,750,000.00  | 56,094,848.81<br>(1,678,419,580)  |  |
| 中国元           | 国債証券 | 1.99 CHINA GOVT 240915   | 14,000,000.00  | 13,922,088.88                     |  |
|               |      | 1.99 CHINA GOVT 250409   | 20,000,000.00  | 19,812,703.00                     |  |

|                        |               |               |  |
|------------------------|---------------|---------------|--|
| 2.18 CHINA GOVT 240625 | 4,000,000.00  | 3,993,763.80  |  |
| 2.18 CHINA GOVT 250825 | 16,000,000.00 | 15,884,554.24 |  |
| 2.24 CHINA GOVT 250525 | 9,000,000.00  | 8,958,898.89  |  |
| 2.26 CHINA GOVT 250224 | 14,000,000.00 | 13,944,696.64 |  |
| 2.28 CHINA GOVT 240317 | 15,000,000.00 | 15,012,219.00 |  |
| 2.28 CHINA GOVT 251125 | 8,000,000.00  | 7,946,758.32  |  |
| 2.37 CHINA GOVT 270120 | 13,000,000.00 | 12,843,944.62 |  |
| 2.44 CHINA GOVT 271015 | 15,000,000.00 | 14,805,660.00 |  |
| 2.47 CHINA GOVT 240902 | 16,000,000.00 | 16,015,910.40 |  |
| 2.48 CHINA GOVT 270415 | 13,000,000.00 | 12,876,373.38 |  |
| 2.5 CHINA GOVT 270725  | 17,000,000.00 | 16,830,348.33 |  |
| 2.6 CHINA GOVT 320901  | 17,000,000.00 | 16,552,397.14 |  |
| 2.62 CHINA GOVT 290925 | 14,000,000.00 | 13,779,662.12 |  |
| 2.68 CHINA GOVT 300521 | 21,000,000.00 | 20,727,435.33 |  |
| 2.69 CHINA GOVT 260812 | 24,000,000.00 | 24,041,258.40 |  |
| 2.69 CHINA GOVT 320815 | 10,000,000.00 | 9,794,689.40  |  |
| 2.74 CHINA GOVT 260804 | 5,000,000.00  | 5,028,603.50  |  |
| 2.75 CHINA GOVT 290615 | 9,000,000.00  | 8,946,626.94  |  |
| 2.75 CHINA GOVT 320217 | 11,000,000.00 | 10,822,672.19 |  |
| 2.76 CHINA GOVT 320515 | 12,000,000.00 | 11,827,877.16 |  |
| 2.79 CHINA GOVT 291215 | 9,000,000.00  | 8,960,103.36  |  |
| 2.8 CHINA GOVT 290324  | 14,000,000.00 | 13,982,177.02 |  |
| 2.8 CHINA GOVT 321115  | 9,000,000.00  | 8,916,987.06  |  |
| 2.84 CHINA GOVT 240408 | 15,000,000.00 | 15,114,711.00 |  |
| 2.85 CHINA GOVT 270604 | 17,000,000.00 | 17,093,676.80 |  |
| 2.89 CHINA GOVT 311118 | 11,000,000.00 | 10,995,241.40 |  |
| 2.9 CHINA GOVT 260505  | 6,000,000.00  | 6,056,355.60  |  |
| 2.91 CHINA GOVT 281014 | 16,000,000.00 | 16,112,883.20 |  |
| 2.94 CHINA GOVT 241017 | 10,000,000.00 | 10,107,109.00 |  |
| 2.99 CHINA GOVT 251015 | 9,000,000.00  | 9,119,050.20  |  |
| 3.01 CHINA GOVT 280513 | 13,000,000.00 | 13,171,810.60 |  |
| 3.02 CHINA GOVT 251022 | 22,000,000.00 | 22,322,172.40 |  |
| 3.02 CHINA GOVT 310527 | 21,000,000.00 | 21,248,562.30 |  |
| 3.03 CHINA GOVT 260311 | 16,000,000.00 | 16,241,200.00 |  |
| 3.12 CHINA GOVT 261205 | 17,000,000.00 | 17,323,795.60 |  |
| 3.12 CHINA GOVT 521025 | 3,000,000.00  | 2,915,763.00  |  |
| 3.13 CHINA GOVT 291121 | 12,000,000.00 | 12,279,454.80 |  |
| 3.19 CHINA GOVT 240411 | 10,000,000.00 | 10,124,492.00 |  |
| 3.22 CHINA GOVT 251206 | 13,000,000.00 | 13,278,809.70 |  |
| 3.25 CHINA GOVT 260606 | 18,000,000.00 | 18,406,882.80 |  |
| 3.25 CHINA GOVT 281122 | 8,000,000.00  | 8,233,023.20  |  |
| 3.27 CHINA GOVT 301119 | 21,000,000.00 | 21,764,213.10 |  |
|                        |               |               |  |



|     |      |                        |               |               |                |
|-----|------|------------------------|---------------|---------------|----------------|
|     |      | 3.28 CHINA GOVT 271203 | 15,000,000.00 | 15,451,134.00 |                |
|     |      | 3.29 CHINA GOVT 290523 | 18,000,000.00 | 18,636,163.20 |                |
|     |      | 3.32 CHINA GOVT 520415 | 9,000,000.00  | 9,078,118.20  |                |
|     |      | 3.39 CHINA GOVT 500316 | 16,000,000.00 | 16,227,868.80 |                |
|     |      | 3.52 CHINA GOVT 270504 | 6,000,000.00  | 6,246,100.20  |                |
|     |      | 3.53 CHINA GOVT 511018 | 8,000,000.00  | 8,329,821.60  |                |
|     |      | 3.54 CHINA GOVT 280816 | 4,000,000.00  | 4,183,848.40  |                |
|     |      | 3.57 CHINA GOVT 240622 | 10,000,000.00 | 10,200,744.00 |                |
|     |      | 3.59 CHINA GOVT 270803 | 7,000,000.00  | 7,327,231.10  |                |
|     |      | 3.6 CHINA GOVT 250906  | 8,000,000.00  | 8,264,170.40  |                |
|     |      | 3.61 CHINA GOVT 250607 | 10,000,000.00 | 10,303,911.00 |                |
|     |      | 3.69 CHINA GOVT 240921 | 6,000,000.00  | 6,151,832.40  |                |
|     |      | 3.69 CHINA GOVT 280517 | 18,000,000.00 | 18,987,091.20 |                |
|     |      | 3.72 CHINA GOVT 510412 | 10,000,000.00 | 10,754,274.00 |                |
|     |      | 3.77 CHINA GOVT 250308 | 11,000,000.00 | 11,360,379.80 |                |
|     |      | 3.81 CHINA GOVT 500914 | 19,000,000.00 | 20,747,667.50 |                |
|     |      | 3.86 CHINA GOVT 490722 | 14,000,000.00 | 15,367,611.00 |                |
|     |      | 4.08 CHINA GOVT 481022 | 11,000,000.00 | 12,523,449.40 |                |
|     |      | 中国元合計                  |               |               | 787,000,000.00 |
| ユーロ | 国債証券 | 0 AUSTRIA GOVT 250420  | 800,000.00    | 755,807.20    |                |
|     |      | 0 AUSTRIA GOVT 281020  | 900,000.00    | 778,013.10    |                |
|     |      | 0 AUSTRIA GOVT 300220  | 1,450,000.00  | 1,208,306.75  |                |
|     |      | 0 AUSTRIA GOVT 310220  | 2,130,000.00  | 1,724,448.00  |                |
|     |      | 0 AUSTRIA GOVT 401020  | 810,000.00    | 494,359.20    |                |
|     |      | 0 BEL GOVT 271022      | 1,800,000.00  | 1,603,173.60  |                |
|     |      | 0 BEL GOVT 311022      | 1,700,000.00  | 1,355,920.00  |                |
|     |      | 0 BUND 260815          | 5,930,000.00  | 5,488,031.17  |                |
|     |      | 0 BUND 271115          | 3,100,000.00  | 2,800,075.00  |                |
|     |      | 0 BUND 281115          | 4,400,000.00  | 3,900,248.00  |                |
|     |      | 0 BUND 290815          | 3,940,000.00  | 3,441,373.30  |                |
|     |      | 0 BUND 300215          | 2,120,000.00  | 1,834,923.60  |                |
|     |      | 0 BUND 300815          | 4,960,000.00  | 4,250,551.36  |                |
|     |      | 0 BUND 310215          | 3,700,000.00  | 3,137,847.53  |                |
|     |      | 0 BUND 310815          | 6,150,000.00  | 5,159,991.45  |                |
|     |      | 0 BUND 310815          | 600,000.00    | 503,917.80    |                |
|     |      | 0 BUND 320215          | 4,690,000.00  | 3,886,814.05  |                |
|     |      | 0 BUND 350515          | 3,330,000.00  | 2,541,545.91  |                |
|     |      | 0 BUND 360515          | 3,600,000.00  | 2,683,461.60  |                |
|     |      | 0 BUND 500815          | 5,090,000.00  | 2,906,313.65  |                |
|     |      | 0 BUND 500815          | 1,560,000.00  | 894,151.44    |                |
|     |      | 0 BUND 520815          | 2,750,000.00  | 1,511,796.00  |                |

|                          |               |               |  |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| 0 FINNISH GOVT 240915    | 850,000.00    | 816,255.00    |  |
| 0 FINNISH GOVT 300915    | 750,000.00    | 616,518.75    |  |
| 0 IRISH GOVT 311018      | 1,350,000.00  | 1,084,252.50  |  |
| 0 ITALY GOVT 240815      | 2,500,000.00  | 2,387,937.50  |  |
| 0 ITALY GOVT 241215      | 2,000,000.00  | 1,892,450.00  |  |
| 0 ITALY GOVT 260401      | 3,300,000.00  | 2,986,665.00  |  |
| 0 ITALY GOVT 260801      | 2,500,000.00  | 2,239,365.00  |  |
| 0 NETH GOVT 240115       | 2,540,000.00  | 2,476,571.62  |  |
| 0 NETH GOVT 270115       | 1,950,000.00  | 1,780,077.00  |  |
| 0 NETH GOVT 290115       | 500,000.00    | 435,560.50    |  |
| 0 NETH GOVT 300715       | 2,650,000.00  | 2,233,202.70  |  |
| 0 NETH GOVT 310715       | 1,620,000.00  | 1,329,971.40  |  |
| 0 NETH GOVT 380115       | 1,140,000.00  | 790,172.53    |  |
| 0 NETH GOVT 520115       | 1,930,000.00  | 1,025,895.36  |  |
| 0 O.A.T 240325           | 10,800,000.00 | 10,477,674.00 |  |
| 0 O.A.T 250225           | 3,200,000.00  | 3,031,513.60  |  |
| 0 O.A.T 250325           | 7,380,000.00  | 6,978,085.20  |  |
| 0 O.A.T 260225           | 6,600,000.00  | 6,116,741.40  |  |
| 0 O.A.T 270225           | 6,130,000.00  | 5,559,205.05  |  |
| 0 O.A.T 291125           | 6,980,000.00  | 5,924,457.87  |  |
| 0 O.A.T 301125           | 7,790,000.00  | 6,444,978.60  |  |
| 0 O.A.T 311125           | 6,500,000.00  | 5,222,873.50  |  |
| 0 O.A.T 320525           | 4,980,000.00  | 3,934,090.44  |  |
| 0 OBL 241018             | 4,400,000.00  | 4,215,882.00  |  |
| 0 OBL 250411             | 1,100,000.00  | 1,043,614.91  |  |
| 0 OBL 251010             | 2,500,000.00  | 2,348,660.00  |  |
| 0 OBL 251010             | 1,000,000.00  | 941,872.59    |  |
| 0 OBL 260410             | 1,700,000.00  | 1,583,106.30  |  |
| 0 OBL 261009             | 2,900,000.00  | 2,672,808.20  |  |
| 0 OBL 270416             | 3,050,000.00  | 2,782,365.55  |  |
| 0 SPAIN GOVT 240531      | 1,600,000.00  | 1,544,625.60  |  |
| 0 SPAIN GOVT 250131      | 3,630,000.00  | 3,442,198.32  |  |
| 0 SPAIN GOVT 250531      | 5,000,000.00  | 4,693,565.00  |  |
| 0 SPAIN GOVT 260131      | 3,000,000.00  | 2,768,085.00  |  |
| 0 SPAIN GOVT 270131      | 2,800,000.00  | 2,514,256.64  |  |
| 0 SPAIN GOVT 280131      | 2,800,000.00  | 2,442,943.44  |  |
| 0.1 BEL GOVT 300622      | 1,500,000.00  | 1,259,696.40  |  |
| 0.1 SPAIN GOVT 310430    | 4,360,000.00  | 3,464,918.16  |  |
| 0.125 FINNISH GOV 310915 | 570,000.00    | 460,883.76    |  |
| 0.125 FINNISH GOV 360415 | 510,000.00    | 361,781.58    |  |
| 0.125 FINNISH GOV 520415 | 550,000.00    | 282,678.55    |  |
| 0.2 IRISH GOVT 270515    | 500,000.00    | 455,514.00    |  |
|                          |               |               |  |

|                          |              |              |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 0.2 IRISH GOVT 301018    | 620,000.00   | 522,334.50   |
| 0.2 SCHATS 240614        | 3,800,000.00 | 3,680,748.40 |
| 0.25 AUSTRIA GOVT 361020 | 700,000.00   | 498,701.00   |
| 0.25 BUND 270215         | 4,490,000.00 | 4,159,392.32 |
| 0.25 BUND 280815         | 4,170,000.00 | 3,768,620.82 |
| 0.25 BUND 290215         | 4,050,000.00 | 3,630,472.65 |
| 0.25 FINNISH GOVT 400915 | 540,000.00   | 350,011.26   |
| 0.25 ITALY GOVT 280315   | 1,700,000.00 | 1,449,505.00 |
| 0.25 NETH GOVT 250715    | 1,930,000.00 | 1,830,147.68 |
| 0.25 NETH GOVT 290715    | 2,950,000.00 | 2,587,737.05 |
| 0.25 O.A.T 261125        | 6,680,000.00 | 6,153,756.28 |
| 0.25 SPAIN GOVT 240730   | 2,700,000.00 | 2,605,829.40 |
| 0.35 BEL GOVT 320622     | 3,050,000.00 | 2,464,951.31 |
| 0.35 IRISH GOVT 321018   | 400,000.00   | 324,373.60   |
| 0.35 ITALY GOVT 250201   | 3,060,000.00 | 2,903,178.06 |
| 0.4 BEL GOVT 400622      | 1,300,000.00 | 845,748.80   |
| 0.4 IRISH GOVT 350515    | 700,000.00   | 528,734.50   |
| 0.45 ITALY GOVT 290215   | 2,300,000.00 | 1,915,934.50 |
| 0.5 AUSTRIA GOVT 270420  | 1,500,000.00 | 1,384,059.00 |
| 0.5 AUSTRIA GOVT 290220  | 2,050,000.00 | 1,814,696.90 |
| 0.5 BEL GOVT 241022      | 2,190,000.00 | 2,116,312.19 |
| 0.5 BUND 250215          | 7,110,000.00 | 6,839,293.86 |
| 0.5 BUND 260215          | 6,660,000.00 | 6,317,236.44 |
| 0.5 BUND 270815          | 5,120,000.00 | 4,758,784.00 |
| 0.5 BUND 280215          | 4,280,000.00 | 3,950,341.56 |
| 0.5 FINNISH GOVT 260415  | 1,670,000.00 | 1,575,289.29 |
| 0.5 FINNISH GOVT 270915  | 700,000.00   | 639,253.30   |
| 0.5 FINNISH GOVT 280915  | 580,000.00   | 518,596.56   |
| 0.5 FINNISH GOVT 290915  | 720,000.00   | 630,318.09   |
| 0.5 FINNISH GOVT 430415  | 480,000.00   | 315,052.32   |
| 0.5 ITALY GOVT 260201    | 2,450,000.00 | 2,266,270.28 |
| 0.5 ITALY GOVT 280715    | 2,400,000.00 | 2,051,894.40 |
| 0.5 NETH GOVT 260715     | 3,970,000.00 | 3,726,869.26 |
| 0.5 NETH GOVT 320715     | 2,300,000.00 | 1,930,849.08 |
| 0.5 NETH GOVT 400115     | 2,630,000.00 | 1,922,948.17 |
| 0.5 O.A.T 250525         | 4,990,000.00 | 4,759,791.34 |
| 0.5 O.A.T 260525         | 7,530,000.00 | 7,065,011.95 |
| 0.5 O.A.T 290525         | 7,320,000.00 | 6,501,404.40 |
| 0.5 O.A.T 400525         | 3,730,000.00 | 2,516,966.70 |
| 0.5 O.A.T 440625         | 2,430,000.00 | 1,517,887.35 |
| 0.5 O.A.T 720525         | 1,500,000.00 | 634,599.00   |
| 0.5 SPAIN GOVT 300430    | 3,580,000.00 | 3,035,968.88 |
| 0.5 SPAIN GOVT 311031    | 2,490,000.00 | 2,018,321.39 |

|                          |              |              |  |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| 0.55 IRISH GOVT 410422   | 450,000.00   | 300,354.30   |  |
| 0.6 ITALY GOVT 310801    | 3,100,000.00 | 2,392,645.10 |  |
| 0.6 SPAIN GOVT 291031    | 3,180,000.00 | 2,753,015.04 |  |
| 0.65 BEL GOVT 710622     | 910,000.00   | 419,250.65   |  |
| 0.7 AUSTRIA GOVT 710420  | 130,000.00   | 64,716.08    |  |
| 0.7 SPAIN GOVT 320430    | 3,800,000.00 | 3,089,939.60 |  |
| 0.75 AUSTRIA GOVT 261020 | 2,480,000.00 | 2,331,703.44 |  |
| 0.75 AUSTRIA GOVT 280220 | 1,690,000.00 | 1,550,199.82 |  |
| 0.75 AUSTRIA GOVT 510320 | 1,180,000.00 | 735,637.96   |  |
| 0.75 FINNISH GOVT 310415 | 1,050,000.00 | 906,274.95   |  |
| 0.75 NETH GOVT 270715    | 2,670,000.00 | 2,497,958.55 |  |
| 0.75 NETH GOVT 280715    | 3,020,000.00 | 2,781,794.48 |  |
| 0.75 O.A.T 280225        | 4,900,000.00 | 4,504,908.10 |  |
| 0.75 O.A.T 280525        | 8,050,000.00 | 7,377,245.40 |  |
| 0.75 O.A.T 281125        | 8,360,000.00 | 7,606,222.27 |  |
| 0.75 O.A.T 520525        | 4,710,000.00 | 2,759,942.25 |  |
| 0.75 O.A.T 530525        | 4,360,000.00 | 2,492,328.60 |  |
| 0.8 BEL GOVT 250622      | 2,970,000.00 | 2,855,214.54 |  |
| 0.8 BEL GOVT 270622      | 1,930,000.00 | 1,798,511.03 |  |
| 0.8 BEL GOVT 280622      | 2,250,000.00 | 2,065,862.70 |  |
| 0.8 SPAIN GOVT 270730    | 3,300,000.00 | 3,036,069.30 |  |
| 0.8 SPAIN GOVT 290730    | 1,880,000.00 | 1,652,174.08 |  |
| 0.85 AUSTRIA GOVT 200630 | 650,000.00   | 304,979.10   |  |
| 0.85 ITALY GOVT 270115   | 3,060,000.00 | 2,796,500.34 |  |
| 0.85 SPAIN GOVT 370730   | 1,850,000.00 | 1,310,416.05 |  |
| 0.875 FINNISH GOV 250915 | 630,000.00   | 604,963.17   |  |
| 0.9 AUSTRIA GOVT 320220  | 2,120,000.00 | 1,816,693.72 |  |
| 0.9 BEL GOVT 290622      | 3,090,000.00 | 2,807,624.67 |  |
| 0.9 IRISH GOVT 280515    | 1,640,000.00 | 1,518,026.30 |  |
| 0.9 ITALY GOVT 310401    | 2,830,000.00 | 2,269,127.96 |  |
| 0.95 ITALY GOVT 270915   | 4,000,000.00 | 3,603,960.00 |  |
| 0.95 ITALY GOVT 300801   | 2,500,000.00 | 2,052,875.00 |  |
| 0.95 ITALY GOVT 311201   | 2,050,000.00 | 1,614,194.60 |  |
| 0.95 ITALY GOVT 320601   | 2,600,000.00 | 2,018,627.00 |  |
| 0.95 ITALY GOVT 370301   | 2,860,000.00 | 1,923,650.30 |  |
| 1 BEL GOVT 260622        | 2,760,000.00 | 2,633,106.24 |  |
| 1 BEL GOVT 310622        | 2,850,000.00 | 2,513,127.15 |  |
| 1 BUND 240815            | 3,600,000.00 | 3,519,172.80 |  |
| 1 BUND 250815            | 5,580,000.00 | 5,392,115.82 |  |
| 1 BUND 380515            | 1,300,000.00 | 1,091,521.60 |  |
| 1 IRISH GOVT 260515      | 1,850,000.00 | 1,772,149.40 |  |
| 1 O.A.T 251125           | 7,380,000.00 | 7,084,246.50 |  |
|                          |              |              |  |

|                          |              |              |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 1 0.A.T 270525           | 5,460,000.00 | 5,142,228.00 |
| 1 SPAIN GOVT 420730      | 950,000.00   | 623,902.05   |
| 1 SPAIN GOVT 501031      | 3,350,000.00 | 1,897,352.90 |
| 1.1 IRISH GOVT 290515    | 1,610,000.00 | 1,484,800.76 |
| 1.1 ITALY GOVT 270401    | 1,800,000.00 | 1,651,055.40 |
| 1.125 FINNISH GOV 340415 | 730,000.00   | 616,447.77   |
| 1.2 AUSTRIA GOVT 251020  | 2,710,000.00 | 2,626,762.35 |
| 1.2 ITALY GOVT 250815    | 2,100,000.00 | 2,004,559.20 |
| 1.2 SPAIN GOVT 401031    | 2,730,000.00 | 1,917,358.17 |
| 1.25 BEL GOVT 330422     | 1,770,000.00 | 1,543,910.82 |
| 1.25 BUND 480815         | 5,140,000.00 | 4,285,449.30 |
| 1.25 ITALY GOVT 261201   | 2,680,000.00 | 2,496,076.96 |
| 1.25 0.A.T 340525        | 5,990,000.00 | 5,131,273.60 |
| 1.25 0.A.T 360525        | 7,070,000.00 | 5,842,082.40 |
| 1.25 0.A.T 380525        | 650,000.00   | 518,610.95   |
| 1.25 SPAIN GOVT 301031   | 3,230,000.00 | 2,866,715.44 |
| 1.3 IRISH GOVT 330515    | 860,000.00   | 756,757.00   |
| 1.3 OBL 271015           | 4,050,000.00 | 3,893,670.00 |
| 1.3 OBL 271015           | 1,300,000.00 | 1,253,127.33 |
| 1.3 SPAIN GOVT 261031    | 3,650,000.00 | 3,478,406.20 |
| 1.35 IRISH GOVT 310318   | 1,070,000.00 | 986,667.97   |
| 1.35 ITALY GOVT 300401   | 3,610,000.00 | 3,093,665.31 |
| 1.375 FINNISH GOV 270415 | 800,000.00   | 764,420.00   |
| 1.375 FINNISH GOV 470415 | 840,000.00   | 659,947.68   |
| 1.4 BEL GOVT 530622      | 1,520,000.00 | 1,038,169.12 |
| 1.4 SPAIN GOVT 280430    | 3,740,000.00 | 3,494,214.68 |
| 1.4 SPAIN GOVT 280730    | 4,040,000.00 | 3,763,219.60 |
| 1.45 BEL GOVT 370622     | 720,000.00   | 595,429.92   |
| 1.45 ITALY GOVT 241115   | 2,400,000.00 | 2,337,172.60 |
| 1.45 ITALY GOVT 250515   | 2,300,000.00 | 2,225,181.00 |
| 1.45 ITALY GOVT 360301   | 2,140,000.00 | 1,579,797.22 |
| 1.45 SPAIN GOVT 271031   | 3,330,000.00 | 3,143,976.21 |
| 1.45 SPAIN GOVT 290430   | 3,300,000.00 | 3,051,308.70 |
| 1.45 SPAIN GOVT 711031   | 750,000.00   | 387,228.95   |
| 1.5 AUSTRIA GOVT 470220  | 1,430,000.00 | 1,110,133.31 |
| 1.5 AUSTRIA GOVT 861102  | 460,000.00   | 307,326.00   |
| 1.5 BUND 240515          | 5,460,000.00 | 5,388,856.20 |
| 1.5 FINNISH GOVT 320915  | 750,000.00   | 675,712.50   |
| 1.5 IRISH GOVT 500515    | 1,160,000.00 | 868,229.84   |
| 1.5 ITALY GOVT 250601    | 3,300,000.00 | 3,190,595.10 |
| 1.5 ITALY GOVT 450430    | 2,110,000.00 | 1,319,045.40 |
| 1.5 0.A.T 310525         | 9,560,000.00 | 8,892,004.56 |
| 1.5 0.A.T 500525         | 5,180,000.00 | 3,824,114.28 |

|                          |              |              |  |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| 1.5 SPAIN GOVT 270430    | 3,290,000.00 | 3,137,578.28 |  |
| 1.6 BEL GOVT 470622      | 1,570,000.00 | 1,188,581.06 |  |
| 1.6 ITALY GOVT 260601    | 2,620,000.00 | 2,492,432.20 |  |
| 1.6 SPAIN GOVT 250430    | 3,510,000.00 | 3,429,642.06 |  |
| 1.65 AUSTRIA GOVT 241021 | 2,510,000.00 | 2,471,807.84 |  |
| 1.65 ITALY GOVT 301201   | 3,870,000.00 | 3,327,816.87 |  |
| 1.65 ITALY GOVT 320301   | 4,950,000.00 | 4,140,308.70 |  |
| 1.7 BEL GOVT 500622      | 1,740,000.00 | 1,314,705.72 |  |
| 1.7 BUND 320815          | 3,250,000.00 | 3,134,196.00 |  |
| 1.7 IRISH GOVT 370515    | 1,190,000.00 | 1,029,733.18 |  |
| 1.7 ITALY GOVT 510901    | 2,390,000.00 | 1,466,348.65 |  |
| 1.75 BUND 240215         | 7,000,000.00 | 6,940,927.00 |  |
| 1.75 ITALY GOVT 240701   | 3,000,000.00 | 2,947,983.00 |  |
| 1.75 O.A.T 241125        | 6,520,000.00 | 6,421,746.86 |  |
| 1.75 O.A.T 390625        | 4,250,000.00 | 3,651,209.00 |  |
| 1.75 O.A.T 660525        | 2,140,000.00 | 1,591,633.56 |  |
| 1.8 BUND 530815          | 750,000.00   | 695,501.25   |  |
| 1.8 ITALY GOVT 410301    | 2,240,000.00 | 1,583,406.72 |  |
| 1.85 AUSTRIA GOVT 490523 | 490,000.00   | 409,009.86   |  |
| 1.85 ITALY GOVT 240515   | 4,370,000.00 | 4,306,329.44 |  |
| 1.85 ITALY GOVT 250701   | 2,400,000.00 | 2,333,640.00 |  |
| 1.85 SPAIN GOVT 350730   | 3,200,000.00 | 2,739,836.80 |  |
| 1.9 BEL GOVT 380622      | 1,360,000.00 | 1,183,429.84 |  |
| 1.9 SPAIN GOVT 521031    | 1,400,000.00 | 975,093.00   |  |
| 1.95 SPAIN GOVT 260430   | 2,320,000.00 | 2,269,168.80 |  |
| 1.95 SPAIN GOVT 300730   | 3,790,000.00 | 3,556,748.24 |  |
| 2 FINNISH GOVT 240415    | 1,620,000.00 | 1,609,434.36 |  |
| 2 IRISH GOVT 450218      | 1,640,000.00 | 1,391,318.60 |  |
| 2 ITALY GOVT 251201      | 3,530,000.00 | 3,427,291.12 |  |
| 2 ITALY GOVT 280201      | 4,580,000.00 | 4,299,246.00 |  |
| 2 NETH GOVT 240715       | 2,900,000.00 | 2,878,278.42 |  |
| 2 NETH GOVT 540115       | 700,000.00   | 651,009.94   |  |
| 2 O.A.T 321125           | 4,400,000.00 | 4,174,357.44 |  |
| 2 O.A.T 480525           | 4,650,000.00 | 3,897,583.50 |  |
| 2.05 ITALY GOVT 270801   | 3,650,000.00 | 3,466,350.25 |  |
| 2.1 AUSTRIA GOVT 170920  | 810,000.00   | 664,753.23   |  |
| 2.1 BUND 291115          | 1,100,000.00 | 1,098,150.90 |  |
| 2.1 ITALY GOVT 260715    | 2,350,000.00 | 2,268,746.40 |  |
| 2.15 BEL GOVT 660622     | 1,270,000.00 | 1,046,925.77 |  |
| 2.15 ITALY GOVT 520901   | 1,150,000.00 | 769,461.32   |  |
| 2.15 ITALY GOVT 720301   | 550,000.00   | 341,868.45   |  |
| 2.15 SPAIN GOVT 251031   | 4,040,000.00 | 3,990,118.12 |  |
|                          |              |              |  |

|                          |              |              |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 2.2 ITALY GOVT 270601    | 2,000,000.00 | 1,919,084.00 |
| 2.25 BEL GOVT 570622     | 1,020,000.00 | 864,880.44   |
| 2.25 ITALY GOVT 360901   | 2,720,000.00 | 2,211,101.60 |
| 2.25 O.A.T 240525        | 6,190,000.00 | 6,159,328.55 |
| 2.35 SPAIN GOVT 330730   | 3,110,000.00 | 2,893,422.71 |
| 2.4 AUSTRIA GOVT 340523  | 1,300,000.00 | 1,255,225.40 |
| 2.4 IRISH GOVT 300515    | 2,090,000.00 | 2,085,034.16 |
| 2.45 ITALY GOVT 330901   | 2,870,000.00 | 2,480,345.84 |
| 2.45 ITALY GOVT 500901   | 2,490,000.00 | 1,828,800.42 |
| 2.5 BUND 440704          | 4,580,000.00 | 4,835,806.74 |
| 2.5 BUND 460815          | 4,350,000.00 | 4,641,645.75 |
| 2.5 ITALY GOVT 241201    | 3,360,000.00 | 3,334,910.20 |
| 2.5 ITALY GOVT 251115    | 2,330,000.00 | 2,295,436.78 |
| 2.5 ITALY GOVT 321201    | 2,350,000.00 | 2,080,177.70 |
| 2.5 NETH GOVT 330115     | 2,250,000.00 | 2,258,309.25 |
| 2.5 O.A.T 300525         | 7,950,000.00 | 7,995,354.75 |
| 2.5 O.A.T 430525         | 650,000.00   | 606,308.30   |
| 2.55 SPAIN GOVT 321031   | 2,690,000.00 | 2,564,791.79 |
| 2.6 BEL GOVT 240622      | 2,180,000.00 | 2,179,288.77 |
| 2.625 FINNISH GOV 420704 | 940,000.00   | 925,741.14   |
| 2.65 ITALY GOVT 271201   | 2,800,000.00 | 2,709,840.00 |
| 2.7 ITALY GOVT 470301    | 2,630,000.00 | 2,085,332.26 |
| 2.7 SPAIN GOVT 481031    | 2,210,000.00 | 1,922,779.56 |
| 2.75 BEL GOVT 390422     | 950,000.00   | 920,776.10   |
| 2.75 FINNISH GOVT 280704 | 1,110,000.00 | 1,125,315.78 |
| 2.75 NETH GOVT 470115    | 3,100,000.00 | 3,326,408.50 |
| 2.75 O.A.T 271025        | 7,490,000.00 | 7,598,200.54 |
| 2.75 SPAIN GOVT 241031   | 2,900,000.00 | 2,905,582.50 |
| 2.8 ITALY GOVT 281201    | 2,880,000.00 | 2,787,347.52 |
| 2.8 ITALY GOVT 290615    | 3,800,000.00 | 3,628,441.40 |
| 2.8 ITALY GOVT 670301    | 1,620,000.00 | 1,195,835.40 |
| 2.9 SPAIN GOVT 461031    | 2,690,000.00 | 2,460,755.51 |
| 2.95 ITALY GOVT 380901   | 2,080,000.00 | 1,801,261.28 |
| 3 BEL GOVT 340622        | 1,230,000.00 | 1,249,922.31 |
| 3 ITALY GOVT 290801      | 3,400,000.00 | 3,297,809.60 |
| 3.1 ITALY GOVT 400301    | 1,890,000.00 | 1,643,421.15 |
| 3.15 AUSTRIA GOVT 440620 | 1,250,000.00 | 1,313,128.75 |
| 3.25 BUND 420704         | 2,880,000.00 | 3,347,352.00 |
| 3.25 ITALY GOVT 380301   | 1,340,000.00 | 1,201,705.30 |
| 3.25 ITALY GOVT 460901   | 2,740,000.00 | 2,387,920.96 |
| 3.25 O.A.T 450525        | 4,340,000.00 | 4,568,587.80 |
| 3.35 ITALY GOVT 350301   | 2,080,000.00 | 1,925,605.76 |
| 3.4 IRISH GOVT 240318    | 820,000.00   | 828,341.04   |

|                          |              |              |  |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| 3.45 ITALY GOVT 480301   | 2,620,000.00 | 2,356,268.18 |  |
| 3.45 SPAIN GOVT 430730   | 720,000.00   | 711,158.40   |  |
| 3.45 SPAIN GOVT 660730   | 2,230,000.00 | 2,161,561.30 |  |
| 3.5 ITALY GOVT 260115    | 1,300,000.00 | 1,312,018.50 |  |
| 3.5 ITALY GOVT 300301    | 3,670,000.00 | 3,653,154.70 |  |
| 3.5 O.A.T 260425         | 6,690,000.00 | 6,903,076.50 |  |
| 3.75 BEL GOVT 450622     | 1,320,000.00 | 1,473,787.92 |  |
| 3.75 ITALY GOVT 240901   | 4,230,000.00 | 4,279,689.81 |  |
| 3.75 NETH GOVT 420115    | 2,690,000.00 | 3,206,517.66 |  |
| 3.8 AUSTRIA GOVT 620126  | 700,000.00   | 864,855.52   |  |
| 3.85 ITALY GOVT 291215   | 1,200,000.00 | 1,211,526.00 |  |
| 3.85 ITALY GOVT 490901   | 1,950,000.00 | 1,858,311.00 |  |
| 4 BEL GOVT 320328        | 1,250,000.00 | 1,382,255.00 |  |
| 4 BUND 370104            | 4,040,000.00 | 4,895,627.56 |  |
| 4 FINNISH GOVT 250704    | 1,440,000.00 | 1,495,192.32 |  |
| 4 ITALY GOVT 350430      | 1,150,000.00 | 1,136,365.33 |  |
| 4 ITALY GOVT 370201      | 3,970,000.00 | 3,941,713.75 |  |
| 4 NETH GOVT 370115       | 2,400,000.00 | 2,821,852.80 |  |
| 4 O.A.T 381025           | 4,020,000.00 | 4,566,655.68 |  |
| 4 O.A.T 550425           | 2,740,000.00 | 3,323,033.64 |  |
| 4 O.A.T 600425           | 2,490,000.00 | 3,087,231.48 |  |
| 4.15 AUSTRIA GOVT 370315 | 2,190,000.00 | 2,528,044.02 |  |
| 4.2 SPAIN GOVT 370131    | 3,460,000.00 | 3,797,865.54 |  |
| 4.25 BEL GOVT 410328     | 2,430,000.00 | 2,844,018.54 |  |
| 4.25 BUND 390704         | 2,710,000.00 | 3,460,073.80 |  |
| 4.4 ITALY GOVT 330501    | 900,000.00   | 925,742.70   |  |
| 4.5 BEL GOVT 260328      | 1,610,000.00 | 1,709,575.28 |  |
| 4.5 ITALY GOVT 240301    | 7,470,000.00 | 7,589,180.11 |  |
| 4.5 ITALY GOVT 260301    | 3,640,000.00 | 3,785,567.24 |  |
| 4.5 O.A.T 410425         | 5,880,000.00 | 7,168,331.52 |  |
| 4.65 SPAIN GOVT 250730   | 2,890,000.00 | 3,027,757.63 |  |
| 4.7 SPAIN GOVT 410730    | 3,200,000.00 | 3,760,672.00 |  |
| 4.75 BUND 280704         | 2,340,000.00 | 2,651,620.36 |  |
| 4.75 BUND 340704         | 3,550,000.00 | 4,475,861.30 |  |
| 4.75 BUND 400704         | 3,110,000.00 | 4,223,989.56 |  |
| 4.75 ITALY GOVT 280901   | 3,930,000.00 | 4,195,589.40 |  |
| 4.75 ITALY GOVT 440901   | 2,650,000.00 | 2,854,996.05 |  |
| 4.75 O.A.T 350425        | 4,150,000.00 | 4,980,655.70 |  |
| 4.8 SPAIN GOVT 240131    | 1,000,000.00 | 1,020,065.00 |  |
| 4.85 AUSTRIA GOVT 260315 | 1,370,000.00 | 1,476,510.65 |  |
| 4.9 SPAIN GOVT 400730    | 2,930,000.00 | 3,509,905.60 |  |
| 5 BEL GOVT 350328        | 2,950,000.00 | 3,594,572.05 |  |
|                          |              |              |  |



|       |                          |                |                                      |  |
|-------|--------------------------|----------------|--------------------------------------|--|
|       | 5 ITALY GOVT 250301      | 4,280,000.00   | 4,453,682.40                         |  |
|       | 5 ITALY GOVT 340801      | 3,850,000.00   | 4,167,182.25                         |  |
|       | 5 ITALY GOVT 390801      | 3,730,000.00   | 4,095,092.40                         |  |
|       | 5 ITALY GOVT 400901      | 3,600,000.00   | 3,964,500.00                         |  |
|       | 5.15 SPAIN GOVT 281031   | 2,500,000.00   | 2,810,045.00                         |  |
|       | 5.15 SPAIN GOVT 441031   | 2,390,000.00   | 3,014,093.53                         |  |
|       | 5.25 ITALY GOVT 291101   | 4,110,000.00   | 4,549,539.84                         |  |
|       | 5.4 IRISH GOVT 250313    | 2,100,000.00   | 2,225,405.70                         |  |
|       | 5.5 BEL GOVT 280328      | 2,380,000.00   | 2,727,791.78                         |  |
|       | 5.5 BUND 310104          | 4,830,000.00   | 6,014,244.03                         |  |
|       | 5.5 NETH GOVT 280115     | 1,480,000.00   | 1,697,789.40                         |  |
|       | 5.5 O.A.T 290425         | 5,820,000.00   | 6,840,897.84                         |  |
|       | 5.625 BUND 280104        | 2,540,000.00   | 2,951,584.14                         |  |
|       | 5.75 ITALY GOVT 330201   | 3,120,000.00   | 3,563,866.80                         |  |
|       | 5.75 O.A.T 321025        | 5,090,000.00   | 6,472,678.14                         |  |
|       | 5.75 SPAIN GOVT 320730   | 3,480,000.00   | 4,278,155.40                         |  |
|       | 5.9 SPAIN GOVT 260730    | 5,650,000.00   | 6,264,448.80                         |  |
|       | 6 ITALY GOVT 310501      | 5,230,000.00   | 6,090,627.88                         |  |
|       | 6 O.A.T 251025           | 5,460,000.00   | 5,959,491.72                         |  |
|       | 6 SPAIN GOVT 290131      | 4,230,000.00   | 4,989,039.66                         |  |
|       | 6.25 AUSTRIA GOVT 270715 | 1,630,000.00   | 1,887,319.95                         |  |
|       | 6.25 BUND 300104         | 3,500,000.00   | 4,430,737.50                         |  |
|       | 6.5 BUND 270704          | 1,750,000.00   | 2,067,273.07                         |  |
|       | 6.5 ITALY GOVT 271101    | 3,900,000.00   | 4,455,921.60                         |  |
|       | 7.25 ITALY GOVT 261101   | 2,300,000.00   | 2,636,812.00                         |  |
| ユーロ合計 |                          | 996,650,000.00 | 935,490,282.77<br>(131,988,323,996)  |  |
| 合計    |                          |                | 385,399,953,248<br>(385,399,953,248) |  |

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

## 外貨建有価証券の内訳

| 種類         | 銘柄数        | 組入債券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|------------|------------|--------------|-------------------------|
| アメリカドル     | 国債証券 251銘柄 | 100.00%      | 49.60%                  |
| カナダドル      | 国債証券 33銘柄  | 100.00%      | 2.07%                   |
| オーストラリアドル  | 国債証券 27銘柄  | 100.00%      | 1.66%                   |
| イギリスポンド    | 国債証券 55銘柄  | 100.00%      | 4.95%                   |
| シンガポールドル   | 国債証券 19銘柄  | 100.00%      | 0.45%                   |
| マレーシアリングット | 国債証券 30銘柄  | 100.00%      | 0.55%                   |

|            |      |       |         |        |
|------------|------|-------|---------|--------|
| ニュージーランドドル | 国債証券 | 8銘柄   | 100.00% | 0.21%  |
| スウェーデンクローネ | 国債証券 | 7銘柄   | 100.00% | 0.20%  |
| ノルウェークローネ  | 国債証券 | 9銘柄   | 100.00% | 0.19%  |
| デンマーククローネ  | 国債証券 | 7銘柄   | 100.00% | 0.33%  |
| メキシコペソ     | 国債証券 | 14銘柄  | 100.00% | 0.81%  |
| イスラエルシェケル  | 国債証券 | 9銘柄   | 100.00% | 0.35%  |
| ポーランドズロチ   | 国債証券 | 13銘柄  | 100.00% | 0.44%  |
| 中国元        | 国債証券 | 62銘柄  | 100.00% | 3.94%  |
| ユーロ        | 国債証券 | 344銘柄 | 100.00% | 34.25% |

## 第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

## 新興国債券インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

| (単位：円)          |                |
|-----------------|----------------|
| [令和 5年 1月26日現在] |                |
| 資産の部            |                |
| 流動資産            |                |
| 預金              | 824,829,815    |
| コール・ローン         | 79,045,544     |
| 国債証券            | 62,885,512,860 |
| 派生商品評価勘定        | 559,759        |
| 未収入金            | 41,407,130     |
| 未収利息            | 889,586,096    |
| 前払費用            | 81,745,818     |
| 流動資産合計          | 64,802,687,022 |
| 資産合計            | 64,802,687,022 |
| 負債の部            |                |
| 流動負債            |                |
| 派生商品評価勘定        | 733,600        |
| 前受収益            | 145,620        |
| 未払金             | 23,280,678     |
| 未払解約金           | 23,037,441     |
| 未払利息            | 35             |
| 流動負債合計          | 47,197,374     |
| 負債合計            | 47,197,374     |
| 純資産の部           |                |
| 元本等             |                |
| 元本              | 43,842,059,667 |
| 剰余金             |                |
| 剰余金又は欠損金（△）     | 20,913,429,981 |
| 元本等合計           | 64,755,489,648 |
| 純資産合計           | 64,755,489,648 |

[令和 5年 1月26日現在]

負債純資産合計

64,802,687,022

## 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<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。 |

(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 5年 1月26日現在] |
|-----------------------------|-----------------|
| 1. 期首                       | 令和 4年 1月27日     |
| 期首元本額                       | 36,997,686,845円 |
| 期中追加設定元本額                   | 8,676,925,462円  |
| 期中一部解約元本額                   | 1,832,552,640円  |
| 元本の内訳※                      |                 |
| eMAXIS バランス（8資産均等型）         | 3,563,187,092円  |
| eMAXIS バランス（波乗り型）           | 356,969,818円    |
| 三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金） | 1,126,420,368円  |
| コアバランス                      | 1,149,064円      |
| 海外債券セレクション（ラップ向け）           | 520,244,134円    |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）    | 14,726,003,007円 |
| つみたて8資産均等バランス               | 6,826,516,752円  |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s       | 1,612,745円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s       | 3,622,812円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s       | 800,026円        |
| ラップ向けインデックスf 新興国債券          | 1,960,403,585円  |
| eMAXIS 新興国債券インデックス          | 3,120,871,292円  |
| 三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド     | 10,546,062,588円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）   | 83,597,555円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）  | 475,504,903円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）     | 365,022,368円    |

|                                   | [令和 5年 1月26日現在] |
|-----------------------------------|-----------------|
| eMAX I S 最適化バランス（マイストライカー）        | 111,616,987円    |
| アドバンスト・バランスⅠ（F O F s用）（適格機関投資家限定） | 7,863,232円      |
| アドバンスト・バランスⅡ（F O F s用）（適格機関投資家限定） | 10,364,781円     |
| 世界8資産バランスファンドV L（適格機関投資家限定）       | 34,226,558円     |
| 合計                                | 43,842,059,667円 |
| 2. 受益権の総数                         | 43,842,059,667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 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>                                                                                                                                                                                                                         |

### 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                  | [令和 5年 1月26日現在]                                                |
|---------------------|----------------------------------------------------------------|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。                                         |
| 2.時価の算定方法           | <p>（1）有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> |

| 区分 | [令和 5年 1月26日現在]                                                                                                                                                                                                                               |
|----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    | (2) デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。<br>(3) 上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。<br>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 5年 1月26日現在]    |
|------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | △1,296,841,735     |
| 合計   | △1,296,841,735     |

(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 5年 1月26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     | 41,821,255  | —     | 41,181,224  | △640,031 |
|           | インドネシアルピア  | 23,923,199  | —     | 23,860,120  | △63,079  |
|           | メキシコペソ     | 3,465,450   | —     | 3,437,250   | △28,200  |
|           | ハンガリーフォリント | 2,551,255   | —     | 2,554,664   | 3,409    |
|           | オフショア元     | 18,957,800  | —     | 19,084,200  | 126,400  |
|           | ルーマニアレイ    | 2,881,800   | —     | 2,879,510   | △2,290   |
|           | 売建         |             |       |             |          |
|           | チリペソ       | 41,821,255  | —     | 41,407,130  | 414,125  |
|           | トルコリラ      | 1,733,025   | —     | 1,717,200   | 15,825   |
| 合計        |            | 137,155,039 | —     | 136,121,298 | △173,841 |

（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 5年 1月26日現在] |
| 1口当たり純資産額    | 1.4770円         |
| (1万口当たり純資産額) | (14,770円)       |

附属明細表

第1 有価証券明細表  
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

| 通貨                 | 種 類  | 銘 柄                      | 券面総額          | 評価額           | 備考 |
|--------------------|------|--------------------------|---------------|---------------|----|
| マレーシア<br>リン<br>ギット | 国債証券 | 2.632 MALAYSIAGOV 310415 | 13,800,000.00 | 12,744,901.68 |    |
|                    |      | 3.502MALAYSIAGOV 270531  | 14,600,000.00 | 14,612,545.78 |    |
|                    |      | 3.582 MALAYSIAGOV 320715 | 8,700,000.00  | 8,591,119.23  |    |
|                    |      | 3.733 MALAYSIAGO 280615  | 8,850,000.00  | 8,920,117.66  |    |
|                    |      | 3.757 MALAYSIAGOV 400522 | 13,700,000.00 | 13,055,401.16 |    |
|                    |      | 3.8 MALAYSIAGOV 230817   | 4,700,000.00  | 4,722,497.49  |    |
|                    |      | 3.828 MALAYSIAGOV 340705 | 11,570,000.00 | 11,479,106.54 |    |
|                    |      | 3.882 MALAYSIAGOV 250314 | 1,200,000.00  | 1,213,722.24  |    |
|                    |      | 3.885 MALAYSIAGOV 290815 | 14,450,000.00 | 14,609,211.54 |    |
|                    |      | 3.899 MALAYSIAGOV 271116 | 11,500,000.00 | 11,705,885.65 |    |
|                    |      | 3.9 MALAYSIAGOV 261130   | 12,720,000.00 | 12,915,316.87 |    |
|                    |      | 3.906 MALAYSIAGOV 260715 | 1,200,000.00  | 1,220,539.44  |    |

有価証券分報告書（内国投資信託）

|              |      |                          |                   |                                     |  |
|--------------|------|--------------------------|-------------------|-------------------------------------|--|
|              |      | 3.955 MALAYSIAGOV 250915 | 20,500,000.00     | 20,799,761.25                       |  |
|              |      | 4.059 MALAYSIAGOV 240930 | 14,400,000.00     | 14,604,619.68                       |  |
|              |      | 4.065 MALAYSIAGOV 500615 | 9,100,000.00      | 8,736,195.83                        |  |
|              |      | 4.181 MALAYSIAGOV 240715 | 12,450,000.00     | 12,636,017.94                       |  |
|              |      | 4.254 MALAYSIAGOV 350531 | 9,550,000.00      | 9,852,016.84                        |  |
|              |      | 4.369 MALAYSIA IN 281031 | 12,800,000.00     | 13,247,690.24                       |  |
|              |      | 4.696 MALAYSIAGOV 421015 | 4,340,000.00      | 4,653,643.55                        |  |
|              |      | 4.762 MALAYSIAGOV 370407 | 9,000,000.00      | 9,781,503.30                        |  |
| マレーシアリングット合計 |      |                          | 209,130,000.00    | 210,101,813.91<br>(6,379,048,243)   |  |
| タイバーツ        | 国債証券 | 0.75 THAILAND 240617     | 88,800,000.00     | 87,861,728.54                       |  |
|              |      | 0.75 THAILAND 240917     | 91,300,000.00     | 90,095,450.77                       |  |
|              |      | 0.95 THAILAND 250617     | 91,400,000.00     | 89,888,758.58                       |  |
|              |      | 1 THAILAND 270617        | 108,700,000.00    | 104,582,982.06                      |  |
|              |      | 1.45 THAILAND 241217     | 87,600,000.00     | 87,286,225.56                       |  |
|              |      | 1.585 THAILAND 351217    | 80,900,000.00     | 71,135,416.92                       |  |
|              |      | 1.6 THAILAND 291217      | 74,500,000.00     | 71,803,576.05                       |  |
|              |      | 1.6 THAILAND 350617      | 38,200,000.00     | 33,967,954.93                       |  |
|              |      | 2 THAILAND 311217        | 127,100,000.00    | 123,481,370.21                      |  |
|              |      | 2 THAILAND 420617        | 53,500,000.00     | 45,713,316.82                       |  |
|              |      | 2.125 THAILAND 261217    | 87,300,000.00     | 88,256,834.19                       |  |
|              |      | 2.35 THAILAND 260617     | 5,000,000.00      | 5,093,195.00                        |  |
|              |      | 2.4 THAILAND 231217      | 58,900,000.00     | 59,546,286.14                       |  |
|              |      | 2.65 THAILAND 280617     | 30,700,000.00     | 31,748,374.30                       |  |
|              |      | 2.875 THAILAND 281217    | 84,400,000.00     | 88,276,643.92                       |  |
|              |      | 2.875 THAILAND 460617    | 64,200,000.00     | 61,017,479.52                       |  |
|              |      | 3.3 THAILAND 380617      | 96,000,000.00     | 100,724,995.20                      |  |
|              |      | 3.39 THAILAND 370617     | 2,000,000.00      | 2,138,664.60                        |  |
|              |      | 3.4 THAILAND 360617      | 68,000,000.00     | 72,603,681.60                       |  |
|              |      | 3.65 THAILAND 310620     | 70,100,000.00     | 77,081,665.58                       |  |
|              |      | 3.775 THAILAND 320625    | 88,600,000.00     | 98,620,668.86                       |  |
|              |      | 3.85 THAILAND 251212     | 81,700,000.00     | 86,523,796.76                       |  |
|              |      | 4.875 THAILAND 290622    | 76,300,000.00     | 88,977,595.98                       |  |
| タイバーツ合計      |      |                          | 1,655,200,000.00  | 1,666,426,662.09<br>(6,582,385,315) |  |
| フィリピンペソ      | 国債証券 | 6.25 PHILIPPI(GL) 360114 | 20,000,000.00     | 18,445,533.00                       |  |
| フィリピンペソ合計    |      |                          | 20,000,000.00     | 18,445,533.00<br>(43,625,530)       |  |
| インドネシアルピア    | 国債証券 | 10.5 INDONESIA 300815    | 7,050,000,000.00  | 8,635,560,510.00                    |  |
|              |      | 11 INDONESIA 250915      | 5,250,000,000.00  | 5,853,619,275.00                    |  |
|              |      | 5.125 INDONESIA 270415   | 28,800,000,000.00 | 27,755,712,000.00                   |  |
|              |      | 5.5 INDONESIA 260415     | 29,900,000,000.00 | 29,373,760,000.00                   |  |

|                          |                |                        |                   |                         |                    |                                       |  |
|--------------------------|----------------|------------------------|-------------------|-------------------------|--------------------|---------------------------------------|--|
|                          |                | 6.125 INDONESIA 280515 | 29,000,000,000.00 | 28,499,750,000.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 6.25 INDONESIA 360615  | 6,000,000,000.00  | 5,685,000,000.00        |                    |                                       |  |
|                          |                | 6.375 INDONESIA 280815 | 5,000,000,000.00  | 5,011,300,000.00        |                    |                                       |  |
|                          |                | 6.375 INDONESIA 320415 | 37,600,000,000.00 | 37,035,248,000.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 6.375 INDONESIA 370715 | 4,000,000,000.00  | 3,858,780,000.00        |                    |                                       |  |
|                          |                | 6.5 INDONESIA 250615   | 41,900,000,000.00 | 42,302,240,000.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 6.5 INDONESIA 310215   | 35,900,000,000.00 | 35,505,100,000.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 6.625 INDONESIA 330515 | 20,400,000,000.00 | 20,285,760,000.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 7 INDONESIA 270515     | 23,450,000,000.00 | 24,098,861,500.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 7 INDONESIA 300915     | 46,700,000,000.00 | 47,563,950,000.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 7 INDONESIA 330215     | 8,600,000,000.00  | 8,844,928,000.00        |                    |                                       |  |
|                          |                | 7.125 INDONESIA 420615 | 24,600,000,000.00 | 25,060,020,000.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 7.125 INDONESIA 430615 | 4,000,000,000.00  | 4,120,240,000.00        |                    |                                       |  |
|                          |                | 7.5 INDONESIA 320815   | 5,400,000,000.00  | 5,700,780,000.00        |                    |                                       |  |
|                          |                | 7.5 INDONESIA 350615   | 32,300,000,000.00 | 34,233,155,000.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 7.5 INDONESIA 380515   | 23,200,000,000.00 | 24,360,000,000.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 7.5 INDONESIA 400415   | 11,300,000,000.00 | 11,903,420,000.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 8.125 INDONESIA 240515 | 27,600,000,000.00 | 28,383,840,000.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 8.25 INDONESIA 290515  | 24,500,000,000.00 | 26,558,000,000.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 8.25 INDONESIA 320615  | 19,000,000,000.00 | 20,930,563,400.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 8.25 INDONESIA 360515  | 29,200,000,000.00 | 32,704,000,000.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 8.375 INDONESIA 240315 | 35,600,000,000.00 | 36,632,400,000.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 8.375 INDONESIA 260915 | 35,930,000,000.00 | 38,427,135,000.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 8.375 INDONESIA 340315 | 35,700,000,000.00 | 39,998,280,000.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 8.375 INDONESIA 390415 | 23,200,000,000.00 | 26,403,920,000.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 8.75 INDONESIA 310515  | 15,400,000,000.00 | 17,428,180,000.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 9 INDONESIA 290315     | 18,800,000,000.00 | 21,116,160,000.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | 9.5 INDONESIA 310715   | 12,200,000,000.00 | 14,234,037,680.00       |                    |                                       |  |
|                          |                | インドネシアルピア合計            |                   |                         | 707,480,000,000.00 | 738,503,700,365.00<br>(6,424,982,193) |  |
|                          |                | メキシコ<br>ペソ             | 国債証券              | 10 MEXICAN BONOS 241205 | 73,700,000.00      | 74,082,205.25                         |  |
|                          |                |                        |                   | 10 MEXICAN BONOS 361120 | 20,200,000.00      | 22,495,528.00                         |  |
|                          |                |                        |                   | 5 MEXICAN BONOS 250306  | 49,000,000.00      | 44,555,210.00                         |  |
| 5.5 MEXICAN BONOS 270304 | 39,700,000.00  |                        |                   | 35,060,658.00           |                    |                                       |  |
| 5.75 MEXICAN BONO 260305 | 118,200,000.00 |                        |                   | 107,496,408.45          |                    |                                       |  |
| 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 93,200,000.00  |                        |                   | 88,955,672.00           |                    |                                       |  |
| 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 119,800,000.00 |                        |                   | 113,963,344.00          |                    |                                       |  |
| 7.75 MEXICAN BONO 341123 | 22,400,000.00  |                        |                   | 21,014,560.00           |                    |                                       |  |
| 7.75 MEXICAN BONO 421113 | 72,600,000.00  |                        |                   | 65,996,304.00           |                    |                                       |  |
| 8 MEXICAN BONOS 231207   | 11,300,000.00  |                        |                   | 11,046,545.40           |                    |                                       |  |
| 8 MEXICAN BONOS 240905   | 103,000,000.00 |                        |                   | 99,627,570.91           |                    |                                       |  |
| 8 MEXICAN BONOS 471107   | 69,400,000.00  |                        |                   | 64,315,756.00           |                    |                                       |  |



|             |      |                          |                  |                                     |  |
|-------------|------|--------------------------|------------------|-------------------------------------|--|
|             |      | 8 MEXICAN BONOS 530731   | 22,400,000.00    | 20,785,320.64                       |  |
|             |      | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 79,000,000.00    | 78,654,770.00                       |  |
|             |      | 8.5 MEXICAN BONOS 381118 | 62,400,000.00    | 61,610,640.00                       |  |
| メキシコペソ合計    |      |                          | 956,300,000.00   | 909,660,492.65<br>(6,255,462,309)   |  |
| ブラジル<br>リアル | 国債証券 | 10 (IN)BRAZIL NT 270101  | 36,270,000.00    | 33,676,293.85                       |  |
|             |      | 10 (IN)BRAZIL NTN 250101 | 29,100,000.00    | 28,047,896.19                       |  |
|             |      | 10 (IN)BRAZIL NTN 310101 | 12,100,000.00    | 10,526,427.06                       |  |
|             |      | 10 (IN)BRAZIL NTN 330101 | 4,600,000.00     | 3,890,090.46                        |  |
|             |      | 10(IN) BRAZIL NTN 290101 | 24,700,000.00    | 22,115,006.92                       |  |
|             |      | BRAZIL-LTN 240101        | 71,400,000.00    | 63,557,112.61                       |  |
|             |      | BRAZIL-LTN 240701        | 37,200,000.00    | 31,241,498.53                       |  |
|             |      | BRAZIL-LTN 250701        | 30,500,000.00    | 22,900,201.23                       |  |
|             |      | BRAZIL-LTN 260101        | 46,400,000.00    | 32,674,006.26                       |  |
| ブラジルリアル合計   |      |                          | 292,270,000.00   | 248,628,533.11<br>(6,326,402,750)   |  |
| チリペソ        | 国債証券 | 2.3 BONOS TESORER 281001 | 480,000,000.00   | 413,160,000.00                      |  |
|             |      | 2.5 BONOS TESORER 250301 | 1,940,000,000.00 | 1,812,445,000.00                    |  |
|             |      | 4.5 BONOS TESORER 260301 | 1,420,000,000.00 | 1,397,635,000.00                    |  |
|             |      | 4.7 BONOS TESORER 300901 | 1,520,000,000.00 | 1,489,676,000.00                    |  |
|             |      | 5 BONOS TESORERIA 281001 | 660,000,000.00   | 660,113,718.00                      |  |
|             |      | 5 BONOS TESORERIA 350301 | 1,440,000,000.00 | 1,430,740,814.00                    |  |
|             |      | 6 BONOS TESORERIA 430101 | 1,315,000,000.00 | 1,432,758,250.00                    |  |
|             |      | 7 BONOS TESORERIA 340501 | 350,000,000.00   | 405,465,798.00                      |  |
| チリペソ合計      |      |                          | 9,125,000,000.00 | 9,041,994,580.00<br>(1,455,571,245) |  |
| チェココ<br>ルナ  | 国債証券 | 0.05 CZECH REPUBL 291129 | 58,000,000.00    | 43,015,004.00                       |  |
|             |      | 0.25 CZECH REPUBL 270210 | 143,500,000.00   | 120,186,129.00                      |  |
|             |      | 0.45 CZECH REPUBL 231025 | 34,500,000.00    | 33,002,562.00                       |  |
|             |      | 1.5 CZECH REPUBLI 400424 | 15,500,000.00    | 9,993,625.00                        |  |
|             |      | 1.75 CZECH REPUBL 320623 | 121,200,000.00   | 97,081,200.00                       |  |
|             |      | 3.5 CZECH REPUBLI 350530 | 83,500,000.00    | 76,861,750.00                       |  |
|             |      | 5 CZECH REPUBLIC 300930  | 19,000,000.00    | 19,674,500.00                       |  |
|             |      | 5.5 CZECH REPUBLI 281212 | 37,000,000.00    | 38,794,500.00                       |  |
|             |      | 6 CZECH REPUBLIC 260226  | 71,500,000.00    | 73,672,170.00                       |  |
|             |      | CZECH REPUBLIC 241212    | 86,000,000.00    | 77,868,700.00                       |  |
| チェココルナ合計    |      |                          | 669,700,000.00   | 590,150,140.00<br>(3,502,186,990)   |  |
| エジプト<br>ポンド | 国債証券 | 13.536 EGYPT GOVE 250114 | 7,000,000.00     | 6,052,937.31                        |  |
|             |      | 14.06 EGYPT GOVER 260112 | 27,000,000.00    | 22,423,692.24                       |  |
|             |      | 14.292 EGYPT GOVE 280105 | 10,000,000.00    | 8,040,836.40                        |  |
|             |      | 14.369 EGYPT GOVE 251020 | 17,000,000.00    | 14,347,932.51                       |  |

|            |      |                          |                    |                                      |  |
|------------|------|--------------------------|--------------------|--------------------------------------|--|
|            |      | 14.4 EGYPT GOVERN 290910 | 9,000,000.00       | 7,117,738.83                         |  |
|            |      | 14.483 EGYPT GOVE 260406 | 23,000,000.00      | 19,139,436.43                        |  |
|            |      | 14.531 EGYPT GOVE 240914 | 20,000,000.00      | 18,052,753.60                        |  |
|            |      | 14.556 EGYPT GOVE 271013 | 15,000,000.00      | 12,183,416.25                        |  |
|            |      | 14.563 EGYPT GOVE 260706 | 6,500,000.00       | 5,423,135.44                         |  |
|            |      | 14.664 EGYPT GOVE 301006 | 7,000,000.00       | 5,520,052.86                         |  |
|            |      | 16.1 EGYPT GOVERN 290507 | 4,500,000.00       | 3,831,391.62                         |  |
| エジプトボンド合計  |      |                          | 146,000,000.00     | 122,133,323.49<br>(527,799,157)      |  |
| コロンビアペソ    | 国債証券 | 10 TITULOS DE TES 240724 | 7,700,000,000.00   | 7,523,936,959.00                     |  |
|            |      | 5.75 TITULOS DE T 271103 | 5,900,000,000.00   | 4,624,304,183.00                     |  |
|            |      | 6 TITULOS DE TESO 280428 | 11,980,000,000.00  | 9,301,441,636.80                     |  |
|            |      | 6.25 TITULOS DE T 251126 | 7,690,000,000.00   | 6,693,596,318.50                     |  |
|            |      | 6.25 TITULOS DE T 360709 | 5,500,000,000.00   | 3,419,517,310.00                     |  |
|            |      | 7 TITULOS DE TESO 310326 | 9,900,000,000.00   | 7,396,611,057.00                     |  |
|            |      | 7 TITULOS DE TESO 320630 | 11,700,000,000.00  | 8,475,600,276.00                     |  |
|            |      | 7.25 TITULOS DE T 341018 | 10,000,000,000.00  | 6,962,632,400.00                     |  |
|            |      | 7.25 TITULOS DE T 501026 | 6,800,000,000.00   | 4,167,924,680.00                     |  |
|            |      | 7.5 TITULOS DE TE 260826 | 13,770,000,000.00  | 12,058,653,521.70                    |  |
|            |      | 7.75 TITULOS DE T 300918 | 9,460,000,000.00   | 7,498,829,615.20                     |  |
|            |      | 9.25 TITULOS DE T 420528 | 7,400,000,000.00   | 5,859,996,804.00                     |  |
|            |      | 9.85 COLOMBI (GL) 270628 | 1,290,000,000.00   | 1,176,183,300.00                     |  |
| コロンビアペソ合計  |      |                          | 109,090,000,000.00 | 85,159,228,061.20<br>(2,425,930,929) |  |
| ハンガリーフォリント | 国債証券 | 1 HUNGARY 251126         | 327,000,000.00     | 257,705,266.50                       |  |
|            |      | 1.5 HUNGARY 260422       | 760,000,000.00     | 597,778,000.00                       |  |
|            |      | 1.5 HUNGARY 260826       | 360,000,000.00     | 276,480,000.00                       |  |
|            |      | 2 HUNGARY 290523         | 430,000,000.00     | 311,707,000.00                       |  |
|            |      | 2.25 HUNGARY 330420      | 540,000,000.00     | 348,975,000.00                       |  |
|            |      | 2.25 HUNGARY 340622      | 150,000,000.00     | 92,775,000.00                        |  |
|            |      | 2.5 HUNGARY 241024       | 390,000,000.00     | 334,893,000.00                       |  |
|            |      | 2.75 HUNGARY 261222      | 373,000,000.00     | 296,612,807.80                       |  |
|            |      | 3 HUNGARY 240626         | 359,000,000.00     | 319,163,565.00                       |  |
|            |      | 3 HUNGARY 271027         | 521,000,000.00     | 410,600,100.00                       |  |
|            |      | 3 HUNGARY 300821         | 498,000,000.00     | 375,994,980.00                       |  |
|            |      | 3 HUNGARY 381027         | 292,000,000.00     | 177,054,200.00                       |  |
|            |      | 3 HUNGARY 410425         | 240,000,000.00     | 140,172,000.00                       |  |
|            |      | 3.25 HUNGARY 311022      | 618,000,000.00     | 456,207,600.00                       |  |
|            |      | 4.5 HUNGARY 280323       | 250,000,000.00     | 211,975,250.00                       |  |
|            |      | 4.75 HUNGARY 321124      | 150,000,000.00     | 122,562,340.50                       |  |
|            |      | 5.5 HUNGARY 250624       | 492,000,000.00     | 437,691,564.00                       |  |
|            |      | 6 HUNGARY 231124         | 243,000,000.00     | 229,114,980.00                       |  |

|              |      |                          |                  |                                     |  |
|--------------|------|--------------------------|------------------|-------------------------------------|--|
|              |      | 6.75 HUNGARY 281022      | 182,000,000.00   | 171,310,321.00                      |  |
| ハンガリーフォリント合計 |      |                          | 7,175,000,000.00 | 5,568,772,974.80<br>(2,033,331,645) |  |
| ペルーヌ<br>エボソル | 国債証券 | 5.35 PERU 400812         | 3,250,000.00     | 2,404,569.24                        |  |
|              |      | 5.4 PERU 340812          | 4,400,000.00     | 3,518,319.77                        |  |
|              |      | 5.7 PERU 240812          | 2,050,000.00     | 2,007,247.88                        |  |
|              |      | 5.94 PERU 290212         | 6,600,000.00     | 6,012,692.79                        |  |
|              |      | 6.15 PERU 320812         | 7,400,000.00     | 6,477,823.39                        |  |
|              |      | 6.35 PERU 280812         | 5,800,000.00     | 5,453,100.72                        |  |
|              |      | 6.9 PERU 370812          | 5,400,000.00     | 4,824,386.02                        |  |
|              |      | 6.95 PERU 310812         | 5,300,000.00     | 4,974,036.27                        |  |
|              |      | 8.2 PERU 260812          | 5,000,000.00     | 5,181,935.40                        |  |
| ペルーヌエボソル合計   |      |                          | 45,200,000.00    | 40,854,111.48<br>(1,356,483,148)    |  |
| ポーランド<br>ズロチ | 国債証券 | 0.25 POLAND 261025       | 14,200,000.00    | 11,565,474.00                       |  |
|              |      | 0.75 POLAND 250425       | 12,500,000.00    | 11,205,625.00                       |  |
|              |      | 1.25 POLAND 301025       | 13,900,000.00    | 9,998,409.00                        |  |
|              |      | 1.75 POLAND 320425       | 13,600,000.00    | 9,667,560.00                        |  |
|              |      | 2.25 POLAND 241025       | 13,500,000.00    | 12,693,861.00                       |  |
|              |      | 2.5 POLAND 240425        | 10,100,000.00    | 9,693,071.00                        |  |
|              |      | 2.5 POLAND 260725        | 15,500,000.00    | 13,852,288.00                       |  |
|              |      | 2.5 POLAND 270725        | 10,900,000.00    | 9,500,985.00                        |  |
|              |      | 2.75 POLAND 280425       | 13,250,000.00    | 11,421,931.95                       |  |
|              |      | 2.75 POLAND 291025       | 19,200,000.00    | 16,010,400.00                       |  |
|              |      | 3.25 POLAND 250725       | 14,500,000.00    | 13,609,120.00                       |  |
|              |      | 3.75 POLAND 270525       | 13,800,000.00    | 12,678,474.00                       |  |
|              |      | 4 POLAND 231025          | 9,500,000.00     | 9,375,835.00                        |  |
| ポーランドズロチ合計   |      |                          | 174,450,000.00   | 151,273,033.95<br>(4,526,255,576)   |  |
| 南アフリ<br>カランド | 国債証券 | 10.5 SOUTH AFRICA 261221 | 97,500,000.00    | 105,042,112.50                      |  |
|              |      | 6.25 SOUTH AFRICA 360331 | 36,800,000.00    | 25,128,880.00                       |  |
|              |      | 6.5 SOUTH AFRICA 410228  | 37,300,000.00    | 24,097,665.00                       |  |
|              |      | 7 SOUTH AFRICA 310228    | 60,000,000.00    | 49,971,000.00                       |  |
|              |      | 8 SOUTH AFRICA 300131    | 132,000,000.00   | 121,143,000.00                      |  |
|              |      | 8.25 SOUTH AFRICA 320331 | 99,400,000.00    | 87,640,980.00                       |  |
|              |      | 8.5 SOUTH AFRICA 370131  | 90,000,000.00    | 73,975,500.00                       |  |
|              |      | 8.75 SOUTH AFRICA 440131 | 79,600,000.00    | 63,819,300.00                       |  |
|              |      | 8.75 SOUTH AFRICA 480228 | 127,900,000.00   | 102,486,270.00                      |  |
|              |      | 8.875 SOUTH AFRIC 350228 | 96,000,000.00    | 83,764,800.00                       |  |
|              |      | 9 SOUTH AFRICA 400131    | 65,000,000.00    | 54,353,000.00                       |  |
| 南アフリカランド合計   |      |                          | 921,500,000.00   | 791,422,507.50<br>(5,975,239,931)   |  |

|           |      |                        |               |                               |  |
|-----------|------|------------------------|---------------|-------------------------------|--|
| ウルグアイペソ   | 国債証券 | 8.25 URUGUAY 310521    | 17,000,000.00 | 15,327,880.00                 |  |
|           |      | 8.5 URUGUAY(GL) 280315 | 7,000,000.00  | 6,580,000.00                  |  |
| ウルグアイペソ合計 |      |                        | 24,000,000.00 | 21,907,880.00<br>(72,436,214) |  |
| 中国元       | 国債証券 | 1.99 CHINA GOVT 250409 | 14,000,000.00 | 13,868,892.10                 |  |
|           |      | 2.18 CHINA GOVT 250825 | 3,000,000.00  | 2,978,353.92                  |  |
|           |      | 2.24 CHINA GOVT 250525 | 3,000,000.00  | 2,986,299.63                  |  |
|           |      | 2.26 CHINA GOVT 250224 | 3,000,000.00  | 2,988,149.28                  |  |
|           |      | 2.37 CHINA GOVT 270120 | 5,000,000.00  | 4,939,978.70                  |  |
|           |      | 2.44 CHINA GOVT 271015 | 2,000,000.00  | 1,974,088.00                  |  |
|           |      | 2.47 CHINA GOVT 240902 | 3,000,000.00  | 3,002,983.20                  |  |
|           |      | 2.48 CHINA GOVT 270415 | 5,000,000.00  | 4,952,451.30                  |  |
|           |      | 2.5 CHINA GOVT 270725  | 7,000,000.00  | 6,930,143.43                  |  |
|           |      | 2.6 CHINA GOVT 320901  | 5,000,000.00  | 4,868,352.10                  |  |
|           |      | 2.62 CHINA GOVT 290925 | 2,000,000.00  | 1,968,523.16                  |  |
|           |      | 2.68 CHINA GOVT 300521 | 18,000,000.00 | 17,766,373.14                 |  |
|           |      | 2.69 CHINA GOVT 260812 | 10,000,000.00 | 10,017,191.00                 |  |
|           |      | 2.69 CHINA GOVT 320815 | 8,000,000.00  | 7,835,751.52                  |  |
|           |      | 2.75 CHINA GOVT 290615 | 3,000,000.00  | 2,982,208.98                  |  |
|           |      | 2.75 CHINA GOVT 320217 | 4,000,000.00  | 3,935,517.16                  |  |
|           |      | 2.76 CHINA GOVT 320515 | 5,000,000.00  | 4,928,282.15                  |  |
|           |      | 2.8 CHINA GOVT 290324  | 2,000,000.00  | 1,997,453.86                  |  |
|           |      | 2.8 CHINA GOVT 321115  | 4,000,000.00  | 3,963,105.36                  |  |
|           |      | 2.84 CHINA GOVT 240408 | 2,000,000.00  | 2,015,294.80                  |  |
|           |      | 2.85 CHINA GOVT 270604 | 12,000,000.00 | 12,066,124.80                 |  |
|           |      | 2.88 CHINA GOVT 231105 | 7,000,000.00  | 7,044,345.00                  |  |
|           |      | 2.89 CHINA GOVT 311118 | 3,000,000.00  | 2,998,702.20                  |  |
|           |      | 2.91 CHINA GOVT 281014 | 2,000,000.00  | 2,014,110.40                  |  |
|           |      | 2.94 CHINA GOVT 241017 | 16,000,000.00 | 16,171,374.40                 |  |
|           |      | 3.01 CHINA GOVT 280513 | 12,000,000.00 | 12,158,594.40                 |  |
|           |      | 3.02 CHINA GOVT 251022 | 15,000,000.00 | 15,219,663.00                 |  |
|           |      | 3.02 CHINA GOVT 310527 | 7,000,000.00  | 7,082,854.10                  |  |
|           |      | 3.03 CHINA GOVT 260311 | 5,000,000.00  | 5,075,375.00                  |  |
|           |      | 3.12 CHINA GOVT 261205 | 7,000,000.00  | 7,133,327.60                  |  |
|           |      | 3.13 CHINA GOVT 291121 | 18,000,000.00 | 18,419,182.20                 |  |
|           |      | 3.19 CHINA GOVT 240411 | 17,000,000.00 | 17,211,636.40                 |  |
|           |      | 3.22 CHINA GOVT 251206 | 9,000,000.00  | 9,193,022.10                  |  |
|           |      | 3.25 CHINA GOVT 260606 | 15,200,000.00 | 15,543,589.92                 |  |
|           |      | 3.25 CHINA GOVT 281122 | 10,000,000.00 | 10,291,279.00                 |  |
|           |      | 3.27 CHINA GOVT 301119 | 8,000,000.00  | 8,291,128.80                  |  |
|           |      | 3.28 CHINA GOVT 271203 | 11,000,000.00 | 11,330,831.60                 |  |
|           |      | 3.29 CHINA GOVT 290523 | 15,000,000.00 | 15,530,136.00                 |  |

|               |      |                             |                |                                   |  |
|---------------|------|-----------------------------|----------------|-----------------------------------|--|
|               |      | 3.32 CHINA GOVT 520415      | 4,000,000.00   | 4,034,719.20                      |  |
|               |      | 3.53 CHINA GOVT 511018      | 3,000,000.00   | 3,123,683.10                      |  |
|               |      | 3.72 CHINA GOVT 510412      | 5,000,000.00   | 5,377,137.00                      |  |
|               |      | 3.81 CHINA GOVT 500914      | 12,000,000.00  | 13,103,790.00                     |  |
| 中国元合計         |      |                             | 321,200,000.00 | 325,313,999.01<br>(6,185,552,908) |  |
| ドミニカ<br>ペソ    | 国債証券 | 9.75 DOMINICAN 260605       | 16,000,000.00  | 15,496,000.00                     |  |
| ドミニカペソ合計      |      |                             | 16,000,000.00  | 15,496,000.00<br>(35,330,880)     |  |
| セルビア<br>ディナール | 国債証券 | 4.5 SERBIA TREASU 260111    | 61,000,000.00  | 58,420,191.05                     |  |
|               |      | 4.5 SERBIA TREASU 320820    | 59,000,000.00  | 49,215,385.13                     |  |
|               |      | 5.875 SERBIA TREA 280208    | 50,000,000.00  | 48,987,030.00                     |  |
| セルビアディナール合計   |      |                             | 170,000,000.00 | 156,622,606.18<br>(188,196,783)   |  |
| ルーマニア<br>レイ   | 国債証券 | 2.5 ROMANIA GOVER 271025    | 3,000,000.00   | 2,441,920.26                      |  |
|               |      | 3.25 ROMANIA GOVE 240429    | 4,400,000.00   | 4,223,428.00                      |  |
|               |      | 3.25 ROMANIA GOVE 260624    | 3,200,000.00   | 2,829,508.35                      |  |
|               |      | 3.65 ROMANIA GOVE 250728    | 4,000,000.00   | 3,709,253.56                      |  |
|               |      | 3.65 ROMANIA GOVE 310924    | 5,500,000.00   | 4,271,080.00                      |  |
|               |      | 3.7 ROMANIA GOVER 241125    | 4,600,000.00   | 4,367,473.63                      |  |
|               |      | 4.15 ROMANIA GOVE 280126    | 5,200,000.00   | 4,534,942.92                      |  |
|               |      | 4.15 ROMANIA GOVE 301024    | 5,000,000.00   | 4,096,319.50                      |  |
|               |      | 4.5 ROMANIA GOVER 240617    | 9,200,000.00   | 8,939,410.00                      |  |
|               |      | 4.75 ROMANIA GOVE 250224    | 6,900,000.00   | 6,611,028.00                      |  |
|               |      | 4.75 ROMANIA GOVE 341011    | 4,200,000.00   | 3,358,005.00                      |  |
|               |      | 4.85 ROMANIA GOVE 260422    | 4,900,000.00   | 4,570,548.50                      |  |
|               |      | 4.85 ROMANIA GOVE 290725    | 3,700,000.00   | 3,220,369.00                      |  |
|               |      | 5 ROMANIA GOVERNMENT 290212 | 3,960,000.00   | 3,513,153.60                      |  |
|               |      | 5.8 ROMANIA GOV 270726      | 6,800,000.00   | 6,422,328.00                      |  |
|               |      | 6.7 ROMANIA GOVER 320225    | 4,000,000.00   | 3,841,306.68                      |  |
| ルーマニアレイ合計     |      |                             | 78,560,000.00  | 70,950,075.00<br>(2,044,639,261)  |  |
| トルコリ<br>ラ     | 国債証券 | 10.5 TURKEY GOVT 270811     | 7,400,000.00   | 7,692,300.00                      |  |
|               |      | 10.6 TURKEY GOVT 260211     | 9,600,000.00   | 10,008,000.00                     |  |
|               |      | 11 TURKEY GOVT 270224       | 4,500,000.00   | 4,824,000.00                      |  |
|               |      | 11.7 TURKEY GOVT 301113     | 14,100,000.00  | 18,012,750.00                     |  |
|               |      | 12.4 TURKEY GOVT 280308     | 4,100,000.00   | 4,969,200.00                      |  |
|               |      | 12.6 TURKEY GOVT 251001     | 16,600,000.00  | 18,272,450.00                     |  |
|               |      | 8 TURKEY GOVT 250312        | 7,300,000.00   | 7,219,700.00                      |  |
|               |      | 9 TURKEY GOVT 240724        | 8,300,000.00   | 8,250,200.00                      |  |
| トルコリラ合計       |      |                             | 71,900,000.00  | 79,248,600.00<br>(544,651,853)    |  |

|    |  |                                    |  |
|----|--|------------------------------------|--|
| 合計 |  | 62,885,512,860<br>(62,885,512,860) |  |
|----|--|------------------------------------|--|

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

## 外貨建有価証券の内訳

| 種類         | 銘柄数       | 組入債券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|------------|-----------|--------------|-------------------------|
| マレーシアリングット | 国債証券 20銘柄 | 100.00%      | 10.14%                  |
| タイバーツ      | 国債証券 23銘柄 | 100.00%      | 10.47%                  |
| フィリピンペソ    | 国債証券 1銘柄  | 100.00%      | 0.07%                   |
| インドネシアルピア  | 国債証券 32銘柄 | 100.00%      | 10.22%                  |
| メキシコペソ     | 国債証券 15銘柄 | 100.00%      | 9.95%                   |
| ブラジルリアル    | 国債証券 9銘柄  | 100.00%      | 10.06%                  |
| チリペソ       | 国債証券 8銘柄  | 100.00%      | 2.31%                   |
| チェココルナ     | 国債証券 10銘柄 | 100.00%      | 5.57%                   |
| エジプトポンド    | 国債証券 11銘柄 | 100.00%      | 0.84%                   |
| コロンビアペソ    | 国債証券 13銘柄 | 100.00%      | 3.86%                   |
| ハンガリーフォリント | 国債証券 19銘柄 | 100.00%      | 3.23%                   |
| ベルーヌエボソル   | 国債証券 9銘柄  | 100.00%      | 2.16%                   |
| ポーランドズロチ   | 国債証券 13銘柄 | 100.00%      | 7.20%                   |
| 南アフリカランド   | 国債証券 11銘柄 | 100.00%      | 9.50%                   |
| ウルグアイペソ    | 国債証券 2銘柄  | 100.00%      | 0.12%                   |
| 中国元        | 国債証券 42銘柄 | 100.00%      | 9.84%                   |
| ドミニカペソ     | 国債証券 1銘柄  | 100.00%      | 0.06%                   |
| セルビアディナール  | 国債証券 3銘柄  | 100.00%      | 0.30%                   |
| ルーマニアレイ    | 国債証券 16銘柄 | 100.00%      | 3.25%                   |
| トルコリラ      | 国債証券 8銘柄  | 100.00%      | 0.87%                   |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

## 東証REIT指数マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

[令和 5年 1月26日現在]

|                |                |
|----------------|----------------|
| 資産の部           |                |
| 流動資産           |                |
| コール・ローン        | 10,488,043,309 |
| 投資証券           | 76,412,934,920 |
| 派生商品評価勘定       | 2,439,000      |
| 未収配当金          | 459,019,346    |
| 未収利息           | 162,930        |
| 前払金            | 40,853,900     |
| その他未収収益        | 235,552        |
| 差入委託証拠金        | 90,965,000     |
| 流動資産合計         | 87,494,653,957 |
| 資産合計           |                |
| 87,494,653,957 |                |
| 負債の部           |                |
| 流動負債           |                |
| 派生商品評価勘定       | 48,169,870     |
| 未払金            | 28,583,880     |
| 未払解約金          | 7,371,356      |
| 未払利息           | 4,715          |
| 受入担保金          | 9,513,569,415  |
| 流動負債合計         | 9,597,699,236  |
| 負債合計           |                |
| 9,597,699,236  |                |
| 純資産の部          |                |
| 元本等            |                |
| 元本             | 22,777,413,306 |
| 剰余金            |                |
| 剰余金又は欠損金（△）    | 55,119,541,415 |
| 元本等合計          | 77,896,954,721 |
| 純資産合計          |                |
| 77,896,954,721 |                |
| 負債純資産合計        |                |
| 87,494,653,957 |                |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(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 5年 1月26日現在] |
| 1. 期首     | 令和 4年 1月27日     |
| 期首元本額     | 18,179,611,266円 |
| 期中追加設定元本額 | 6,863,945,251円  |

|                                         | [令和 5年 1月26日現在] |
|-----------------------------------------|-----------------|
| 期中一部解約元本額                               | 2,266,143,211円  |
| 元本の内訳※                                  |                 |
| eMAXIS 国内リートインデックス                      | 4,208,838,142円  |
| eMAXIS バランス（8資産均等型）                     | 1,488,711,080円  |
| eMAXIS バランス（波乗り型）                       | 151,487,037円    |
| 三菱UFJ <DC>J-REITインデックスファンド              | 603,576,534円    |
| 三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）             | 343,532,294円    |
| J-REITインデックスファンド（ラップ向け）                 | 66,559,524円     |
| オルタナティブ資産セレクション（ラップ向け）                  | 858,564,722円    |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）                | 6,284,369,345円  |
| つみたて8資産均等バランス                           | 2,900,117,819円  |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s                   | 682,524円        |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s                   | 1,205,122円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s                   | 345,282円        |
| eMAXIS Slim 国内リートインデックス                 | 3,480,914,231円  |
| ラップ向けインデックスf 国内リート                      | 218,069,509円    |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）               | 86,065,093円     |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）               | 448,776,041円    |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）               | 105,236,888円    |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド                   | 1,284,800円      |
| 三菱UFJ 国内リートインデックスファンド                   | 15,846,563円     |
| アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）                 | 4,559,924円      |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）                  | 2,964,387円      |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）                | 22,277,579円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）               | 24,008,507円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）               | 35,670,793円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）              | 151,177,661円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）                 | 122,994,999円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）                | 48,039,012円     |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）              | 10,438,274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）              | 110,170円        |
| MUKAM 3資産インカムバランスファンド（適格機関投資家転売制限付）     | 357,470,418円    |
| 日本リートインデックスファンドS                        | 123,474,064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） | 36,872,615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） | 36,352,853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） | 36,383,347円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01（適格機関投資家限定） | 36,098,235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） | 36,247,289円     |



|                                                     | [令和 5年 1月26日現在] |
|-----------------------------------------------------|-----------------|
| 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）             | 36,375,423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）             | 35,735,992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）             | 35,712,758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）             | 36,183,882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）             | 36,150,033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）             | 41,025,580円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05（適格機関投資家限定）             | 40,524,225円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07（適格機関投資家限定）             | 41,189,187円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09（適格機関投資家限定）             | 40,129,598円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11（適格機関投資家限定）             | 41,380,171円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01（適格機関投資家限定）             | 43,683,780円     |
| 合計                                                  | 22,777,413,306円 |
| 2. 貸付有価証券<br>貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っております。<br>投資証券 | 8,984,167,000円  |
| 3. 受益権の総数                                           | 22,777,413,306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 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26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 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26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、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。<br>当ファンドは、運用の効率化を図るために、不動産投信指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。<br>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。<br>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。                                                                                |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                        | [令和 5年 1月26日現在]                                                                                                                                                                                         |
|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                                  |
| 2.時価の算定方法                 | (1) 有価証券<br>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。<br>(2) デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。<br>(3) 上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。                                                                                                                                         |

### （有価証券に関する注記）

#### 売買目的有価証券

| 種類   | [令和 5年 1月26日現在]    |
|------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 投資証券 | △3,412,161,972     |
| 合計   | △3,412,161,972     |

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

投資証券関連

〔令和 5年 1月26日現在〕

| 区分   | 種類          | 契約額等（円）       |       | 時価（円）         | 評価損益（円）     |
|------|-------------|---------------|-------|---------------|-------------|
|      |             |               | うち1年超 |               |             |
| 市場取引 | 不動産投信指数先物取引 |               |       |               |             |
|      | 買建          | 1,505,551,400 | —     | 1,459,867,500 | △45,683,900 |
| 合計   |             | 1,505,551,400 | —     | 1,459,867,500 | △45,683,900 |

（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 5年 1月26日現在〕 |
| 1口当たり純資産額    | 3.4199円         |
| (1万口当たり純資産額) | (34,199円)       |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

| 種 類  | 銘 柄             | 口数    | 評価額         | 備考 |
|------|-----------------|-------|-------------|----|
| 投資証券 | エスコンジャパンリート投資法人 | 1,512 | 182,800,800 |    |

|                         |        |               |                  |
|-------------------------|--------|---------------|------------------|
| サンケイリアルエステート投資法人        | 2,383  | 211,133,800   | 貸付有価証券<br>283口   |
| S O S i L A物流リート投資法人    | 3,700  | 478,410,000   | 貸付有価証券<br>258口   |
| 東海道リート投資法人              | 902    | 107,698,800   |                  |
| 日本アコモデーションファンド投資法人      | 2,568  | 1,489,440,000 | 貸付有価証券<br>384口   |
| 森ヒルズリート投資法人             | 8,747  | 1,326,045,200 |                  |
| 産業ファンド投資法人              | 11,116 | 1,630,717,200 |                  |
| アドバンス・レジデンス投資法人         | 7,437  | 2,413,306,500 |                  |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 5,455  | 1,074,635,000 |                  |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人      | 3,927  | 1,535,457,000 | 貸付有価証券<br>580口   |
| G L P投資法人               | 24,008 | 3,466,755,200 | 貸付有価証券<br>3,326口 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人      | 3,431  | 1,005,283,000 |                  |
| 日本プロロジスリート投資法人          | 12,538 | 3,656,080,800 | 貸付有価証券<br>1,750口 |
| 星野リゾート・リート投資法人          | 1,301  | 961,439,000   | 貸付有価証券<br>176口   |
| O n e リート投資法人           | 1,297  | 321,266,900   | 貸付有価証券<br>180口   |
| イオンリート投資法人              | 8,162  | 1,206,343,600 |                  |
| ヒューリックリート投資法人           | 6,959  | 1,071,686,000 | 貸付有価証券<br>931口   |
| 日本リート投資法人               | 2,416  | 800,904,000   | 貸付有価証券<br>376口   |
| 積水ハウス・リート投資法人           | 22,352 | 1,586,992,000 | 貸付有価証券<br>3,402口 |
| トーセイ・リート投資法人            | 1,650  | 215,325,000   | 貸付有価証券<br>256口   |
| ケネディクス商業リート投資法人         | 3,234  | 789,419,400   | 貸付有価証券<br>425口   |
| ヘルスケア&メディカル投資法人         | 1,834  | 304,627,400   |                  |
| サムティ・レジデンシャル投資法人        | 1,934  | 213,707,000   |                  |
| 野村不動産マスターファンド投資法人       | 24,054 | 3,665,829,600 | 貸付有価証券<br>3,740口 |
| いちごホテルリート投資法人           | 1,232  | 141,433,600   |                  |
| ラサールロジポート投資法人           | 9,106  | 1,416,893,600 | 貸付有価証券<br>1,081口 |
| スターアジア不動産投資法人           | 9,287  | 502,426,700   |                  |
| マリモ地方創生リート投資法人          | 1,136  | 142,568,000   | 貸付有価証券<br>108口   |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人     | 2,938  | 1,313,286,000 |                  |
| 大江戸温泉リート投資法人            | 1,201  | 73,741,400    | 貸付有価証券<br>187口   |

|                    |        |               |                  |
|--------------------|--------|---------------|------------------|
| 投資法人みらい            | 9,037  | 397,628,000   | 貸付有価証券<br>1,249口 |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人   | 1,705  | 227,276,500   | 貸付有価証券<br>250口   |
| 三菱地所物流リート投資法人      | 2,556  | 1,031,346,000 | 貸付有価証券<br>230口   |
| ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人 | 2,881  | 508,784,600   | 貸付有価証券<br>316口   |
| ザイマックス・リート投資法人     | 1,207  | 140,856,900   | 貸付有価証券<br>177口   |
| タカラレーベン不動産投資法人     | 3,258  | 316,677,600   | 貸付有価証券<br>347口   |
| アドバンス・ロジスティクス投資法人  | 3,242  | 450,313,800   | 貸付有価証券<br>365口   |
| 日本ビルファンド投資法人       | 8,678  | 4,937,782,000 | 貸付有価証券<br>1,120口 |
| ジャパンリアルエステイト投資法人   | 7,438  | 4,165,280,000 | 貸付有価証券<br>1,157口 |
| 日本都市ファンド投資法人       | 37,531 | 3,790,631,000 | 貸付有価証券<br>5,787口 |
| オリックス不動産投資法人       | 14,821 | 2,652,959,000 | 貸付有価証券<br>2,304口 |
| 日本プライムリアルティ投資法人    | 5,087  | 1,813,515,500 | 貸付有価証券<br>720口   |
| ＮＴＴ都市開発リート投資法人     | 7,150  | 963,820,000   | 貸付有価証券<br>1,045口 |
| 東急リアル・エステート投資法人    | 4,987  | 992,911,700   |                  |
| グローバル・ワン不動産投資法人    | 5,474  | 586,812,800   | 貸付有価証券<br>803口   |
| ユナイテッド・アーバン投資法人    | 16,639 | 2,487,530,500 | 貸付有価証券<br>2,473口 |
| 森トラスト総合リート投資法人     | 5,353  | 774,043,800   | 貸付有価証券<br>827口   |
| インヴィンシブル投資法人       | 32,740 | 1,823,618,000 | 貸付有価証券<br>4,836口 |
| フロンティア不動産投資法人      | 2,760  | 1,391,040,000 | 貸付有価証券<br>384口   |
| 平和不動産リート投資法人       | 5,084  | 771,242,800   | 貸付有価証券<br>720口   |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人  | 5,016  | 1,524,864,000 |                  |
| 福岡リート投資法人          | 3,847  | 638,602,000   | 貸付有価証券<br>598口   |
| ケネディクス・オフィス投資法人    | 4,328  | 1,348,172,000 | 貸付有価証券<br>716口   |
| いちごオフィスリート投資法人     | 6,095  | 519,294,000   | 貸付有価証券<br>959口   |
| 大和証券オフィス投資法人       | 1,541  | 952,338,000   | 貸付有価証券<br>247口   |
| 阪急阪神リート投資法人        | 3,360  | 482,160,000   | 貸付有価証券<br>522口   |
| スターツプロシード投資法人      | 1,289  | 288,993,800   | 貸付有価証券<br>180口   |

|                       |         |                |                  |
|-----------------------|---------|----------------|------------------|
| 大和ハウスリート投資法人          | 11,212  | 3,100,118,000  | 貸付有価証券<br>1,650口 |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人      | 23,988  | 2,005,396,800  | 貸付有価証券<br>3,726口 |
| 大和証券リビング投資法人          | 10,308  | 1,118,418,000  | 貸付有価証券<br>1,459口 |
| ジャパンエクセレント投資法人        | 6,824   | 852,317,600    | 貸付有価証券<br>1,073口 |
| 東海道リート投資法人（新）         | 251     | 29,166,200     |                  |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人（新） | 29      | 8,340,400      |                  |
| イオンリート投資法人（新）         | 104     | 15,031,120     |                  |
| 合計                    | 443,637 | 76,412,934,920 |                  |

## 第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

## MUAM G－REITマザーファンド

### 貸借対照表

| (単位：円)          |                |
|-----------------|----------------|
| [令和 5年 1月26日現在] |                |
| 資産の部            |                |
| 流動資産            |                |
| 預金              | 1,495,936,975  |
| コール・ローン         | 44,941,693     |
| 投資証券            | 88,995,810,970 |
| 派生商品評価勘定        | 115,466,115    |
| 未収配当金           | 104,620,002    |
| 差入委託証拠金         | 700,222,307    |
| 流動資産合計          | 91,456,998,062 |
| 資産合計            | 91,456,998,062 |
| 負債の部            |                |
| 流動負債            |                |
| 派生商品評価勘定        | 332,010        |
| 未払解約金           | 30,452,523     |
| 未払利息            | 20             |
| 流動負債合計          | 30,784,553     |
| 負債合計            | 30,784,553     |
| 純資産の部           |                |
| 元本等             |                |
| 元本              | 41,064,470,321 |
| 剰余金             |                |
| 剰余金又は欠損金（△）     | 50,361,743,188 |
| 元本等合計           | 91,426,213,509 |

[令和 5年 1月26日現在]

|         |                |
|---------|----------------|
| 純資産合計   | 91,426,213,509 |
| 負債純資産合計 | 91,456,998,062 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(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 5年 1月26日現在] |
|-----------------------------|-----------------|
| 1. 期首                       | 令和 4年 1月27日     |
| 期首元本額                       | 31,709,688,050円 |
| 期中追加設定元本額                   | 12,910,439,771円 |
| 期中一部解約元本額                   | 3,555,657,500円  |
| 元本の内訳※                      |                 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）   | 114,171,010円    |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）      | 98,467,794円     |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド（分配型）         | 33,146,149円     |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド（バランス型）       | 63,339,147円     |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド（株式重視型）       | 28,591,887円     |
| ファンド・マネジャー（海外リート）           | 440,984円        |
| eMAXIS 先進国リートインデックス         | 6,638,605,405円  |
| eMAXIS バランス（8資産均等型）         | 2,379,776,583円  |
| eMAXIS バランス（波乗り型）           | 240,919,896円    |
| 三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド | 3,562,681,635円  |
| 三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金） | 569,523,418円    |
| オルタナティブ資産セレクション（ラップ向け）      | 1,315,751,985円  |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）    | 9,922,548,719円  |
| つみたて8資産均等バランス               | 4,623,624,712円  |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s       | 1,513,894円      |

|                              | [令和 5年 1月26日現在] |
|------------------------------|-----------------|
| eMAXIS マイマネージャー 1980s        | 2,726,423円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s        | 810,066円        |
| eMAXIS Slim 先進国リートインデックス     | 9,194,350,431円  |
| 三菱UFJ 先進国リートインデックスファンド       | 95,445,228円     |
| ラップ向けインデックスf 先進国リート          | 692,125,229円    |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）    | 19,256,152円     |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）    | 168,050,825円    |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）    | 75,444,853円     |
| ラップ向けインデックスf 先進国リート（為替ヘッジあり） | 349,306円        |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）       | 3,944,730円      |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）     | 34,400,995円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）    | 57,106,285円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）    | 84,529,032円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）   | 359,980,526円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）      | 295,592,388円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）     | 112,696,490円    |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）   | 17,305,101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）   | 143,580円        |
| 海外リートインデックスファンドS             | 257,109,463円    |
| 合計                           | 41,064,470,321円 |
| 2. 受益権の総数                    | 41,064,470,321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 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、不動産投信指数先物取引を利用してしております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用してしております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |



| 区分               | 自 令和 4年 1月27日<br>至 令和 5年 1月26日                                                                                                                                                                           |
|------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                        | [令和 5年 1月26日現在]                                                                                                                                                                                                                    |
|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                                                             |
| 2.時価の算定方法                 | <p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価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 5年 1月26日現在]    |
|------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 投資証券 | 4,395,510,707      |
| 合計   | 4,395,510,707      |

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

### （デリバティブ取引に関する注記）

#### 取引の時価等に関する事項

#### 投資証券関連

[令和 5年 1月26日現在]

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

| 市場取引 | 不動産投信指数先物取引 |               |   |               |             |
|------|-------------|---------------|---|---------------|-------------|
|      | 買建          | 2,300,574,238 | — | 2,415,665,904 | 115,091,666 |
| 合計   |             | 2,300,574,238 | — | 2,415,665,904 | 115,091,666 |

## (注) 時価の算定方法

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

## 通貨関連

[令和 5年 1月26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        |            |       |            |         |
|           | オーストラリアドル | 4,125,460  | —     | 4,133,785  | 8,325   |
|           | 香港ドル      | 2,597,072  | —     | 2,575,310  | △21,762 |
|           | 売建        |            |       |            |         |
|           | アメリカドル    | 12,590,977 | —     | 12,535,101 | 55,876  |
| 合計        |           | 19,313,509 | —     | 19,244,196 | 42,439  |

## (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 5年 1月26日現在] |
| 1口当たり純資産額    | 2.2264円         |
| (1万口当たり純資産額) | (22,264円)       |

附属明細表

第1 有価証券明細表  
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 通貨         | 種 類  | 銘 柄                          | 口数      | 評価額           | 備考 |
|------------|------|------------------------------|---------|---------------|----|
| アメリカ<br>ドル | 投資証券 | ACADIA REALTY TRUST          | 48,131  | 721,483.69    |    |
|            |      | AGREE REALTY CORP            | 45,795  | 3,389,287.95  |    |
|            |      | ALEXANDER & BALDWIN INC      | 36,641  | 706,072.07    |    |
|            |      | ALEXANDER'S INC              | 1,131   | 270,388.17    |    |
|            |      | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 76,668  | 12,018,475.68 |    |
|            |      | ALPINE INCOME PROPERTY TRUST | 4,000   | 79,800.00     |    |
|            |      | AMERICAN ASSETS TRUST INC    | 26,190  | 709,487.10    |    |
|            |      | AMERICAN HOMES 4 RENT- A     | 157,342 | 5,198,579.68  |    |
|            |      | AMERICOLD REALTY TRUST INC   | 138,022 | 4,278,682.00  |    |
|            |      | APARTMENT INCOME REIT CO     | 75,785  | 2,804,802.85  |    |
|            |      | APARTMENT INVT & MGMT CO -A  | 76,367  | 578,861.86    |    |
|            |      | APPLE HOSPITALITY REIT INC   | 111,824 | 1,942,382.88  |    |
|            |      | ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN | 31,540  | 390,465.20    |    |
|            |      | ASHFORD HOSPITALITY TRUST    | 15,953  | 100,344.37    |    |
|            |      | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 71,608  | 12,413,962.88 |    |
|            |      | BLUEROCK HOMES TRUST INC     | 1,466   | 31,988.12     |    |
|            |      | BOSTON PROPERTIES INC        | 73,621  | 5,233,716.89  |    |
|            |      | BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 25,650  | 134,919.00    |    |
|            |      | BRANDYWINE REALTY TRUST      | 81,203  | 501,022.51    |    |
|            |      | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC   | 154,932 | 3,515,407.08  |    |
|            |      | BROADSTONE NET LEASE INC     | 90,416  | 1,564,196.80  |    |
|            |      | BRT APARTMENTS CORP          | 4,389   | 87,955.56     |    |
|            |      | CAMDEN PROPERTY TRUST        | 54,577  | 6,509,398.79  |    |
|            |      | CARETRUST REIT INC           | 48,329  | 936,616.02    |    |
|            |      | CBL & ASSOCIATES PROPERTIES  | 12,462  | 327,999.84    |    |
|            |      | CENTERSPACE                  | 7,811   | 504,746.82    |    |
|            |      | CHATHAM LODGING TRUST        | 22,821  | 310,593.81    |    |

|                              |         |               |  |
|------------------------------|---------|---------------|--|
| CITY OFFICE REIT INC         | 18,294  | 171,597.72    |  |
| CLIPPER REALTY INC           | 2,958   | 20,114.40     |  |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 11,059  | 457,842.60    |  |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES  | 56,378  | 1,583,658.02  |  |
| COUSINS PROPERTIES INC       | 79,260  | 2,073,441.60  |  |
| CTO REALTY GROWTH INC        | 9,484   | 180,006.32    |  |
| CUBESMART                    | 115,053 | 4,994,450.73  |  |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO   | 105,342 | 983,894.28    |  |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT | 177,000 | 107,085.00    |  |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 147,108 | 15,768,506.52 |  |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 94,336  | 67,733.24     |  |
| DOUGLAS EMMETT INC           | 87,370  | 1,338,508.40  |  |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST      | 202,000 | —             |  |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 45,586  | 719,347.08    |  |
| EASTGROUP PROPERTIES INC     | 22,333  | 3,667,301.93  |  |
| ELME COMMUNITIES             | 42,775  | 804,170.00    |  |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A  | 68,638  | 517,530.52    |  |
| EPR PROPERTIES               | 38,592  | 1,599,638.40  |  |
| EQUINIX INC                  | 47,332  | 34,068,153.64 |  |
| EQUITY COMMONWEALTH          | 54,878  | 1,403,779.24  |  |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 89,637  | 6,094,419.63  |  |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 174,120 | 10,819,816.80 |  |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY  | 74,146  | 1,803,972.18  |  |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 33,166  | 7,185,082.24  |  |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 68,540  | 10,399,574.20 |  |
| FARMLAND PARTNERS INC        | 22,280  | 289,194.40    |  |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 37,719  | 4,167,195.12  |  |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR   | 67,725  | 3,536,599.50  |  |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST  | 43,220  | 1,224,854.80  |  |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 34,251  | 101,040.45    |  |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 131,848 | 6,912,790.64  |  |
| GETTY REALTY CORP            | 21,208  | 757,549.76    |  |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP    | 18,723  | 310,614.57    |  |
| GLADSTONE LAND CORP          | 14,571  | 283,843.08    |  |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC      | 28,613  | 305,872.97    |  |
| GLOBAL NET LEASE INC         | 52,733  | 749,335.93    |  |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC  | 196,059 | 4,138,805.49  |  |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 275,996 | 7,473,971.68  |  |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST-A   | 12,629  | 115,807.93    |  |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC     | 55,401  | 1,617,155.19  |  |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 368,586 | 6,726,694.50  |  |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 65,609  | 668,555.71    |  |
|                              |         |               |  |

|                              |         |               |
|------------------------------|---------|---------------|
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 115,151 | 2,106,111.79  |
| INDUS REALTY TRUST INC       | 2,511   | 160,678.89    |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT | 28,183  | 112,168.34    |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 13,840  | 1,196,606.40  |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP   | 33,252  | 818,331.72    |
| INVITATION HOMES INC         | 297,406 | 9,540,784.48  |
| IRON MOUNTAIN INC            | 148,828 | 7,819,423.12  |
| ISTAR INC                    | 38,900  | 344,265.00    |
| JBG SMITH PROPERTIES         | 49,863  | 964,350.42    |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT   | 384,700 | 196,197.00    |
| KILROY REALTY CORP           | 54,969  | 2,147,089.14  |
| KIMCO REALTY CORP            | 317,921 | 7,022,874.89  |
| KITE REALTY GROUP TRUST      | 113,700 | 2,386,563.00  |
| LIFE STORAGE INC             | 43,552  | 4,507,632.00  |
| LTC PROPERTIES INC           | 20,072  | 732,427.28    |
| LXP INDUSTRIAL TRUST         | 141,728 | 1,598,691.84  |
| MACERICH CO/THE              | 105,293 | 1,370,914.86  |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV  | 822,720 | 255,043.20    |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 308,267 | 3,819,428.13  |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 59,123  | 9,605,713.81  |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | 92,166  | 4,348,391.88  |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES  | 42,408  | 1,639,493.28  |
| NATL HEALTH INVESTORS INC    | 22,039  | 1,242,338.43  |
| NECESSITY RETAIL REIT INC/TH | 62,478  | 409,855.68    |
| NETSTREIT CORP               | 25,586  | 498,927.00    |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES | 16,000  | 201,440.00    |
| NEXPOINT RESIDENTIAL         | 11,565  | 542,861.10    |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRU | 25,363  | 411,387.86    |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   | 120,772 | 3,408,185.84  |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC   | 9,253   | 215,594.90    |
| ORION OFFICE REIT INC        | 25,772  | 232,463.44    |
| PARAMOUNT GROUP INC          | 86,188  | 531,779.96    |
| PARK HOTELS & RESORTS INC    | 111,860 | 1,531,363.40  |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST      | 64,892  | 999,336.80    |
| PHILLIPS EDISON & COMPANY IN | 60,997  | 1,995,211.87  |
| PHYSICIANS REALTY TRUST      | 114,207 | 1,761,071.94  |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 63,392  | 647,232.32    |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 20,594  | 434,533.40    |
| POSTAL REALTY TRUST INC- A   | 8,862   | 135,322.74    |
| PRIME US REIT                | 348,400 | 167,232.00    |
| PROLOGIS INC                 | 472,084 | 59,336,237.96 |
| PUBLIC STORAGE               | 80,863  | 23,635,446.27 |
| REALTY INCOME CORP           | 321,253 | 21,623,539.43 |

|          |      |                              |            |                                    |  |
|----------|------|------------------------------|------------|------------------------------------|--|
|          |      | REGENCY CENTERS CORP         | 79,318     | 5,230,228.92                       |  |
|          |      | RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 61,168     | 956,055.84                         |  |
|          |      | REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 93,968     | 5,752,720.96                       |  |
|          |      | RLJ LODGING TRUST            | 80,665     | 964,753.40                         |  |
|          |      | RPT REALTY                   | 43,947     | 446,940.99                         |  |
|          |      | RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 28,798     | 2,551,214.82                       |  |
|          |      | SABRA HEALTH CARE REIT INC   | 120,377    | 1,582,957.55                       |  |
|          |      | SAFEHOLD INC                 | 12,820     | 431,649.40                         |  |
|          |      | SAUL CENTERS INC             | 6,193      | 256,885.64                         |  |
|          |      | SERVICE PROPERTIES TRUST     | 91,188     | 768,714.84                         |  |
|          |      | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 167,486    | 20,967,572.34                      |  |
|          |      | SITE CENTERS CORP            | 91,080     | 1,206,810.00                       |  |
|          |      | SL GREEN REALTY CORP         | 31,808     | 1,196,935.04                       |  |
|          |      | SPIRIT REALTY CAPITAL INC    | 72,309     | 3,031,916.37                       |  |
|          |      | STAG INDUSTRIAL INC          | 91,875     | 3,223,893.75                       |  |
|          |      | STORE CAPITAL CORP           | 136,834    | 4,400,581.44                       |  |
|          |      | SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC  | 61,291     | 500,747.47                         |  |
|          |      | SUN COMMUNITIES INC          | 63,433     | 9,395,695.96                       |  |
|          |      | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 104,576    | 1,115,825.92                       |  |
|          |      | TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 51,692     | 969,741.92                         |  |
|          |      | TERRENO REALTY CORP          | 34,362     | 2,148,999.48                       |  |
|          |      | UDR INC                      | 156,776    | 6,365,105.60                       |  |
|          |      | UMH PROPERTIES INC           | 27,440     | 463,736.00                         |  |
|          |      | UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 5,958      | 317,859.30                         |  |
|          |      | URBAN EDGE PROPERTIES        | 58,912     | 907,244.80                         |  |
|          |      | URSTADT BIDDLE - CLASS A     | 14,079     | 261,728.61                         |  |
|          |      | VENTAS INC                   | 205,027    | 10,417,421.87                      |  |
|          |      | VERIS RESIDENTIAL INC        | 39,901     | 645,199.17                         |  |
|          |      | VICI PROPERTIES INC          | 492,750    | 16,620,457.50                      |  |
|          |      | VORNADO REALTY TRUST         | 84,522     | 1,897,518.90                       |  |
|          |      | WELLTOWER INC                | 242,052    | 17,877,960.72                      |  |
|          |      | WHITESTONE REIT              | 19,500     | 197,730.00                         |  |
|          |      | WP CAREY INC                 | 106,770    | 9,037,012.80                       |  |
|          |      | XENIA HOTELS & RESORTS INC   | 56,748     | 823,980.96                         |  |
| アメリカドル合計 |      |                              | 13,149,826 | 527,059,485.12<br>(68,132,979,641) |  |
| カナダドル    | 投資証券 | ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 31,800     | 941,598.00                         |  |
|          |      | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 26,490     | 250,860.30                         |  |
|          |      | AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E | 7,600      | 93,556.00                          |  |
|          |      | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 12,410     | 673,490.70                         |  |
|          |      | BSR REAL ESTATE INVESTMENT T | 8,000      | 152,560.00                         |  |
|          |      | BTB REAL ESTATE INVESTMENT T | 17,900     | 69,273.00                          |  |

|           |      |                              |         |                                  |  |
|-----------|------|------------------------------|---------|----------------------------------|--|
|           |      | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 43,680  | 2,107,560.00                     |  |
|           |      | CHOICE PROPERTIES REIT       | 85,087  | 1,316,295.89                     |  |
|           |      | CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 25,030  | 420,003.40                       |  |
|           |      | CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 29,700  | 486,783.00                       |  |
|           |      | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 63,000  | 861,840.00                       |  |
|           |      | DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | 12,310  | 206,561.80                       |  |
|           |      | EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES | 16,200  | 57,186.00                        |  |
|           |      | FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 53,000  | 960,890.00                       |  |
|           |      | GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 15,900  | 1,265,322.00                     |  |
|           |      | H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 66,209  | 856,744.46                       |  |
|           |      | INOVALIS REAL ESTATE INVESTM | 7,700   | 35,189.00                        |  |
|           |      | INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 34,200  | 482,562.00                       |  |
|           |      | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 30,200  | 551,754.00                       |  |
|           |      | MINTO APARTMENT REAL ESTATE  | 12,300  | 206,763.00                       |  |
|           |      | MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 10,800  | 194,292.00                       |  |
|           |      | NEXUS INDUSTRIAL REIT        | 13,000  | 135,980.00                       |  |
|           |      | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 55,000  | 550,550.00                       |  |
|           |      | PRIMARIS REIT                | 25,577  | 389,026.17                       |  |
|           |      | PRO REAL ESTATE INVESTMENT T | 13,000  | 83,850.00                        |  |
|           |      | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 75,570  | 1,735,087.20                     |  |
|           |      | SLATE GROCERY REIT-CL U      | 14,400  | 224,784.00                       |  |
|           |      | SLATE OFFICE REIT            | 13,500  | 60,075.00                        |  |
|           |      | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 37,900  | 1,079,013.00                     |  |
|           |      | SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI | 46,500  | 1,062,060.00                     |  |
|           |      | TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | 29,800  | 185,952.00                       |  |
| カナダドル合計   |      |                              | 933,763 | 17,697,461.92<br>(1,707,982,049) |  |
| オーストラリアドル | 投資証券 | ABACUS PROPERTY GROUP        | 196,999 | 545,687.23                       |  |
|           |      | ARENA REIT                   | 193,872 | 723,142.56                       |  |
|           |      | BWP TRUST                    | 257,296 | 1,016,319.20                     |  |
|           |      | CENTURIA CAPITAL GROUP       | 358,597 | 668,783.40                       |  |
|           |      | CENTURIA INDUSTRIAL REIT     | 259,972 | 855,307.88                       |  |
|           |      | CENTURIA OFFICE REIT         | 223,021 | 360,178.91                       |  |
|           |      | CHARTER HALL GROUP           | 243,818 | 3,284,228.46                     |  |
|           |      | CHARTER HALL LONG WALE REIT  | 323,723 | 1,498,837.49                     |  |
|           |      | CHARTER HALL RETAIL REIT     | 256,998 | 1,030,561.98                     |  |
|           |      | CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR | 163,882 | 573,587.00                       |  |
|           |      | CROMWELL PROPERTY GROUP      | 651,542 | 472,367.95                       |  |
|           |      | DEXUS INDUSTRIA REIT         | 105,284 | 328,486.08                       |  |
|           |      | DEXUS/AU                     | 557,873 | 4,485,298.92                     |  |
|           |      | GDI PROPERTY GROUP           | 256,139 | 207,472.59                       |  |
|           |      | GOODMAN GROUP                | 879,207 | 17,065,407.87                    |  |

|             |      |                              |            |                                  |  |
|-------------|------|------------------------------|------------|----------------------------------|--|
|             |      | GPT GROUP                    | 985,040    | 4,521,333.60                     |  |
|             |      | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 156,679    | 507,639.96                       |  |
|             |      | HEALTHCO REIT                | 103,905    | 169,365.15                       |  |
|             |      | HMC CAPITAL LTD              | 99,318     | 467,787.78                       |  |
|             |      | HOMEEO DAILY NEEDS REIT      | 786,681    | 1,042,352.32                     |  |
|             |      | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS   | 115,529    | 421,680.85                       |  |
|             |      | INGENIA COMMUNITIES GROUP    | 185,569    | 868,462.92                       |  |
|             |      | MIRVAC GROUP                 | 2,028,632  | 4,604,994.64                     |  |
|             |      | NATIONAL STORAGE REIT        | 536,993    | 1,251,193.69                     |  |
|             |      | RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE | 140,944    | 108,526.88                       |  |
|             |      | REGION RE LTD                | 579,859    | 1,594,612.25                     |  |
|             |      | RURAL FUNDS GROUP            | 179,970    | 442,726.20                       |  |
|             |      | SCENTRE GROUP                | 2,668,841  | 8,220,030.28                     |  |
|             |      | STOCKLAND                    | 1,227,109  | 4,773,454.01                     |  |
|             |      | VICINITY CENTRES             | 1,999,960  | 4,179,916.40                     |  |
|             |      | WAYPOINT REIT                | 338,035    | 943,117.65                       |  |
| オーストラリアドル合計 |      |                              | 17,061,287 | 67,232,862.10<br>(6,176,683,041) |  |
| イギリス<br>ポンド | 投資証券 | ABRDN PROPERTY INCOME TRUST  | 168,370    | 111,966.05                       |  |
|             |      | AEW UK REIT PLC              | 55,249     | 57,458.96                        |  |
|             |      | ASSURA PLC                   | 1,479,375  | 825,491.25                       |  |
|             |      | BALANCED COMM PROPERTY TRUST | 418,813    | 346,777.16                       |  |
|             |      | BIG YELLOW GROUP PLC         | 91,661     | 1,094,432.34                     |  |
|             |      | BRITISH LAND CO PLC          | 486,350    | 2,120,972.35                     |  |
|             |      | CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE | 441,167    | 501,606.87                       |  |
|             |      | CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC   | 336,153    | 178,833.39                       |  |
|             |      | CLS HOLDINGS PLC             | 90,000     | 129,960.00                       |  |
|             |      | CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE | 219,819    | 203,992.03                       |  |
|             |      | DERWENT LONDON PLC           | 55,955     | 1,438,043.50                     |  |
|             |      | EDISTON PROPERTY INVESTMENT  | 100,700    | 63,239.60                        |  |
|             |      | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 306,040    | 268,091.04                       |  |
|             |      | GREAT PORTLAND ESTATES PLC   | 122,582    | 672,975.18                       |  |
|             |      | HAMMERSON PLC                | 2,022,376  | 547,052.70                       |  |
|             |      | HOME REIT PLC                | 398,800    | 151,743.40                       |  |
|             |      | IMPACT HEALTHCARE REIT PLC   | 184,851    | 194,832.95                       |  |
|             |      | LAND SECURITIES GROUP PLC    | 388,465    | 2,716,147.28                     |  |
|             |      | LONDONMETRIC PROPERTY PLC    | 499,320    | 943,714.80                       |  |
|             |      | LXI REIT PLC                 | 900,628    | 1,048,330.99                     |  |
|             |      | NEWRIVER REIT PLC            | 188,335    | 171,384.85                       |  |
|             |      | PICTON PROPERTY INCOME LTD   | 276,666    | 223,546.12                       |  |
|             |      | PRIMARY HEALTH PROPERTIES    | 671,281    | 755,862.40                       |  |
|             |      | PRS REIT PLC/THE             | 310,645    | 275,542.11                       |  |



|           |      |                              |            |                                  |  |
|-----------|------|------------------------------|------------|----------------------------------|--|
|           |      | REGIONAL REIT LTD            | 221,335    | 129,480.97                       |  |
|           |      | SAFESTORE HOLDINGS PLC       | 111,028    | 1,106,949.16                     |  |
|           |      | SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 308,300    | 153,225.10                       |  |
|           |      | SEGRO PLC                    | 621,717    | 5,080,671.32                     |  |
|           |      | SHAFTESBURY PLC              | 141,753    | 548,300.60                       |  |
|           |      | SUPERMARKET INCOME REIT PLC  | 603,770    | 597,732.30                       |  |
|           |      | TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING  | 175,846    | 87,571.30                        |  |
|           |      | TRITAX BIG BOX REIT PLC      | 973,748    | 1,493,729.43                     |  |
|           |      | UK COMMERCIAL PROPERTY REIT  | 464,477    | 277,757.24                       |  |
|           |      | UNITE GROUP PLC/THE          | 207,505    | 2,055,337.02                     |  |
|           |      | URBAN LOGISTICS REIT PLC     | 260,093    | 370,632.52                       |  |
|           |      | WAREHOUSE REIT PLC           | 197,400    | 213,586.80                       |  |
|           |      | WORKSPACE GROUP PLC          | 65,349     | 327,071.74                       |  |
| イギリスポンド合計 |      |                              | 14,565,922 | 27,484,042.82<br>(4,408,440,468) |  |
| 香港ドル      | 投資証券 | CHAMPION REIT                | 926,000    | 3,268,780.00                     |  |
|           |      | FORTUNE REIT                 | 795,000    | 5,326,500.00                     |  |
|           |      | LINK REIT                    | 1,083,400  | 68,850,070.00                    |  |
|           |      | PROSPERITY REIT              | 760,000    | 1,672,000.00                     |  |
|           |      | SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST  | 437,000    | 1,546,980.00                     |  |
|           |      | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN | 973,000    | 2,374,120.00                     |  |
| 香港ドル合計    |      |                              | 4,974,400  | 83,038,450.00<br>(1,370,964,809) |  |
| シンガポールドル  | 投資証券 | AIMS APAC REIT               | 243,700    | 328,995.00                       |  |
|           |      | CAPITALAND ASCENDAS REIT     | 1,730,100  | 4,965,387.00                     |  |
|           |      | CAPITALAND ASCOTT TRUST      | 1,083,774  | 1,170,475.92                     |  |
|           |      | CAPITALAND CHINA TRUST       | 591,500    | 739,375.00                       |  |
|           |      | CAPITALAND INTEGRATED COMMER | 2,591,432  | 5,493,835.84                     |  |
|           |      | CDL HOSPITALITY TRUSTS       | 380,900    | 502,788.00                       |  |
|           |      | DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST  | 246,000    | 157,440.00                       |  |
|           |      | EC WORLD REIT                | 199,400    | 87,736.00                        |  |
|           |      | ESR-LOGOS REIT               | 2,797,968  | 1,035,248.16                     |  |
|           |      | FAR EAST HOSPITALITY TRUST   | 549,800    | 362,868.00                       |  |
|           |      | FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | 758,400    | 204,768.00                       |  |
|           |      | FRASERS CENTREPOINT TRUST    | 527,800    | 1,150,604.00                     |  |
|           |      | FRASERS LOGISTICS & COMMERCI | 1,507,866  | 1,884,832.50                     |  |
|           |      | KEPPEL DC REIT               | 657,000    | 1,314,000.00                     |  |
|           |      | KEPPEL REIT                  | 988,600    | 894,683.00                       |  |
|           |      | LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL  | 1,007,000  | 714,970.00                       |  |
|           |      | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST   | 1,037,500  | 2,458,875.00                     |  |
|           |      | MAPLETREE LOGISTICS TRUST    | 1,667,900  | 2,818,751.00                     |  |
|           |      | MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST | 1,198,400  | 2,181,088.00                     |  |

|              |      |                              |            |                                   |  |
|--------------|------|------------------------------|------------|-----------------------------------|--|
|              |      | QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | 1,306,932  | 463,960.86                        |  |
|              |      | PARAGON REIT                 | 599,300    | 584,317.50                        |  |
|              |      | PARKWAYLIFE REAL ESTATE      | 207,700    | 814,184.00                        |  |
|              |      | SASSEUR REAL ESTATE INVESTME | 272,500    | 218,000.00                        |  |
|              |      | STARHILL GLOBAL REIT         | 683,400    | 399,789.00                        |  |
|              |      | SUNTEC REIT                  | 1,101,100  | 1,519,518.00                      |  |
| シンガポールドル合計   |      |                              | 23,935,972 | 32,466,489.78<br>(3,196,975,248)  |  |
| ニュージーランドドル   | 投資証券 | ARGOSY PROPERTY LTD          | 451,499    | 525,996.33                        |  |
|              |      | GOODMAN PROPERTY TRUST       | 512,182    | 1,080,704.02                      |  |
|              |      | KIWI PROPERTY GROUP LTD      | 876,670    | 845,986.55                        |  |
|              |      | PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | 672,561    | 854,152.47                        |  |
|              |      | STRIDE PROPERTY GROUP        | 293,324    | 413,586.84                        |  |
|              |      | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR | 224,655    | 536,925.45                        |  |
| ニュージーランドドル合計 |      |                              | 3,030,891  | 4,257,351.66<br>(356,680,922)     |  |
| 韓国ウォン        | 投資証券 | D&D PLATFORM REIT CO LTD     | 21,100     | 81,446,000.00                     |  |
|              |      | E KOCREF CR-REIT CO LTD      | 12,700     | 69,342,000.00                     |  |
|              |      | ESR KENDALL SQUARE REIT CO L | 74,117     | 324,632,460.00                    |  |
|              |      | IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD  | 30,932     | 157,443,880.00                    |  |
|              |      | JR REIT XXVII                | 64,186     | 300,069,550.00                    |  |
|              |      | KORAMCO ENERGY PLUS REIT     | 18,324     | 98,216,640.00                     |  |
|              |      | LOTTE REIT CO LTD            | 57,019     | 240,905,275.00                    |  |
|              |      | MIRAE ASIA PAC REAL EST-1    | 36,775     | 157,764,750.00                    |  |
|              |      | NH ALL-ONE REIT CO LTD       | 32,547     | 124,980,480.00                    |  |
|              |      | SHINHAN ALPHA REIT CO LTD    | 28,895     | 207,466,100.00                    |  |
|              |      | SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT | 18,100     | 76,020,000.00                     |  |
|              |      | SK REITS CO LTD              | 35,300     | 195,209,000.00                    |  |
| 韓国ウォン合計      |      |                              | 429,995    | 2,033,496,135.00<br>(213,720,443) |  |
| イスラエルシェケル    | 投資証券 | MENIVIM- THE NEW REIT LTD    | 305,200    | 512,736.00                        |  |
|              |      | REIT 1 LTD                   | 90,223     | 1,602,360.48                      |  |
|              |      | SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT | 113,370    | 952,308.00                        |  |
| イスラエルシェケル合計  |      |                              | 508,793    | 3,067,404.48<br>(117,557,969)     |  |
| ユーロ          | 投資証券 | AEDIFICA                     | 20,488     | 1,673,869.60                      |  |
|              |      | ALSTRIA OFFICE REIT-AG       | 5,778      | 44,721.72                         |  |
|              |      | ALTAREA                      | 2,126      | 267,025.60                        |  |
|              |      | CARE PROPERTY INVEST         | 12,657     | 185,298.48                        |  |
|              |      | CARMILA                      | 28,394     | 398,083.88                        |  |
|              |      | COFINIMMO                    | 15,435     | 1,291,137.75                      |  |
|              |      | COVIVIO                      | 23,981     | 1,506,006.80                      |  |

|       |                              |           |                                    |  |
|-------|------------------------------|-----------|------------------------------------|--|
|       | CROMWELL REIT EUR            | 163,000   | 249,390.00                         |  |
|       | EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 21,835    | 484,300.30                         |  |
|       | GECINA SA                    | 27,945    | 3,029,238.00                       |  |
|       | HAMBORNER REIT AG            | 37,259    | 266,029.26                         |  |
|       | ICADE                        | 16,301    | 711,375.64                         |  |
|       | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 22,501    | 78,303.48                          |  |
|       | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI | 146,893   | 980,510.77                         |  |
|       | INTERVEST OFFICES & WAREHOUS | 11,608    | 240,866.00                         |  |
|       | IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 229,201   | 268,623.57                         |  |
|       | KLEPIERRE                    | 100,697   | 2,310,996.15                       |  |
|       | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 32,964    | 152,788.14                         |  |
|       | MERCIALYS                    | 41,427    | 420,898.32                         |  |
|       | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA  | 163,962   | 1,486,315.53                       |  |
|       | MONTEA NV                    | 6,507     | 482,168.70                         |  |
|       | NSI NV                       | 9,441     | 228,944.25                         |  |
|       | RETAIL ESTATES               | 5,846     | 374,728.60                         |  |
|       | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    | 55,414    | 3,247,260.40                       |  |
|       | VASTNED RETAIL NV            | 9,168     | 196,195.20                         |  |
|       | WAREHOUSES DE PAUW SCA       | 79,807    | 2,280,884.06                       |  |
|       | WERELDHAVE NV                | 18,745    | 256,806.50                         |  |
|       | XIOR STUDENT HOUSING NV      | 12,063    | 374,556.15                         |  |
| ユーロ合計 |                              | 1,321,443 | 23,487,322.85<br>(3,313,826,380)   |  |
| 合計    |                              |           | 88,995,810,970<br>(88,995,810,970) |  |

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

## 外貨建有価証券の内訳

| 種類         | 銘柄数        | 組入投資証券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|------------|------------|----------------|-------------------------|
| アメリカドル     | 投資証券 146銘柄 | 100.00%        | 76.56%                  |
| カナダドル      | 投資証券 31銘柄  | 100.00%        | 1.92%                   |
| オーストラリアドル  | 投資証券 31銘柄  | 100.00%        | 6.94%                   |
| イギリスポンド    | 投資証券 37銘柄  | 100.00%        | 4.95%                   |
| 香港ドル       | 投資証券 6銘柄   | 100.00%        | 1.54%                   |
| シンガポールドル   | 投資証券 25銘柄  | 100.00%        | 3.59%                   |
| ニュージーランドドル | 投資証券 6銘柄   | 100.00%        | 0.40%                   |
| 韓国ウォン      | 投資証券 12銘柄  | 100.00%        | 0.24%                   |
| イスラエルシェケル  | 投資証券 3銘柄   | 100.00%        | 0.13%                   |
| ユーロ        | 投資証券 28銘柄  | 100.00%        | 3.72%                   |

## 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】

## 【eMAX I S 最適化バランス（マイゴールキーパー）】

## 【純資産額計算書】

令和 5年 1月31日現在

（単位：円）

|                      |                |
|----------------------|----------------|
| I 資産総額               | 4,150,356,960  |
| II 負債総額              | 2,079,458      |
| III 純資産総額（I－II）      | 4,148,277,502  |
| IV 発行済口数             | 3,668,955,107口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 1.1306         |
| （10,000口当たり）         | （11,306）       |

## 【eMAX I S 最適化バランス（マイディフェンダー）】

## 【純資産額計算書】

令和 5年 1月31日現在

（単位：円）

|                      |                |
|----------------------|----------------|
| I 資産総額               | 3,105,062,762  |
| II 負債総額              | 4,348,584      |
| III 純資産総額（I－II）      | 3,100,714,178  |
| IV 発行済口数             | 2,429,292,543口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 1.2764         |
| （10,000口当たり）         | （12,764）       |

## 【eMAX I S 最適化バランス（マイミッドフィルダー）】

## 【純資産額計算書】

令和 5年 1月31日現在

（単位：円）

|                      |                |
|----------------------|----------------|
| I 資産総額               | 8,903,798,957  |
| II 負債総額              | 5,308,951      |
| III 純資産総額（I－II）      | 8,898,490,006  |
| IV 発行済口数             | 6,277,187,425口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 1.4176         |
| （10,000口当たり）         | （14,176）       |

## 【eMAX I S 最適化バランス（マイフォワード）】

## 【純資産額計算書】

令和 5年 1月31日現在

（単位：円）

|                      |                |
|----------------------|----------------|
| I 資産総額               | 5,484,042,878  |
| II 負債総額              | 7,067,216      |
| III 純資産総額（I－II）      | 5,476,975,662  |
| IV 発行済口数             | 3,420,758,260口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 1.6011         |
| （10,000口当たり）         | （16,011）       |

## 【eMAX I S 最適化バランス（マイストライカー）】

## 【純資産額計算書】

令和 5年 1月31日現在

（単位：円）

|                      |                |
|----------------------|----------------|
| I 資産総額               | 8,416,722,062  |
| II 負債総額              | 11,808,751     |
| III 純資産総額（I－II）      | 8,404,913,311  |
| IV 発行済口数             | 4,772,317,486口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 1.7612         |
| （10,000口当たり）         | （17,612）       |

（参考）

## TOPIXマザーファンド

## 純資産額計算書

令和 5年 1月31日現在

（単位：円）

|                      |                  |
|----------------------|------------------|
| I 資産総額               | 935,265,500,967  |
| II 負債総額              | 76,282,362,392   |
| III 純資産総額（I－II）      | 858,983,138,575  |
| IV 発行済口数             | 367,440,550,301口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 2.3377           |
| （10,000口当たり）         | （23,377）         |

## 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 5年 1月31日現在

(単位：円)

|                      |                   |
|----------------------|-------------------|
| I 資産総額               | 2,081,568,191,539 |
| II 負債総額              | 230,531,532       |
| III 純資産総額（I－II）      | 2,081,337,660,007 |
| IV 発行済口数             | 449,329,951,264口  |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 4.6321            |
| （10,000口当たり）         | （46,321）          |

## 新興国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

令和 5年 1月31日現在

(単位：円)

|                      |                  |
|----------------------|------------------|
| I 資産総額               | 399,147,675,754  |
| II 負債総額              | 803,159,330      |
| III 純資産総額（I－II）      | 398,344,516,424  |
| IV 発行済口数             | 127,078,306,486口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 3.1346           |
| （10,000口当たり）         | （31,346）         |

## 日本債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

令和 5年 1月31日現在

(単位：円)

|                      |                  |
|----------------------|------------------|
| I 資産総額               | 697,233,125,957  |
| II 負債総額              | 17,431,145,559   |
| III 純資産総額（I－II）      | 679,801,980,398  |
| IV 発行済口数             | 534,467,907,202口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 1.2719           |
| （10,000口当たり）         | （12,719）         |

## 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 5年 1月31日現在

(単位：円)

|                      |                  |
|----------------------|------------------|
| I 資産総額               | 394,421,593,003  |
| II 負債総額              | 1,775,264,579    |
| III 純資産総額（I－II）      | 392,646,328,424  |
| IV 発行済口数             | 174,910,060,152口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 2.2448           |
| （10,000口当たり）         | （22,448）         |

## 新興国債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

令和 5年 1月31日現在

(単位：円)

|                      |                 |
|----------------------|-----------------|
| I 資産総額               | 65,295,026,035  |
| II 負債総額              | 227,886,620     |
| III 純資産総額（I－II）      | 65,067,139,415  |
| IV 発行済口数             | 43,980,092,718口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 1.4795          |
| （10,000口当たり）         | （14,795）        |

## 東証REIT指数マザーファンド

## 純資産額計算書

令和 5年 1月31日現在

(単位：円)

|                      |                 |
|----------------------|-----------------|
| I 資産総額               | 88,021,529,279  |
| II 負債総額              | 9,898,298,784   |
| III 純資産総額（I－II）      | 78,123,230,495  |
| IV 発行済口数             | 22,839,096,375口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 3.4206          |
| （10,000口当たり）         | （34,206）        |

## MUAM G－REITマザーファンド

## 純資産額計算書



令和 5年 1月31日現在

（単位：円）

|                      |                 |
|----------------------|-----------------|
| I 資産総額               | 93,316,459,264  |
| II 負債総額              | 36,753,772      |
| III 純資産総額（I－II）      | 93,279,705,492  |
| IV 発行済口数             | 41,087,941,712口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 2.2702          |
| （10,000口当たり）         | （22,702）        |

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## （1）名義書換等

該当事項はありません。

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

## （2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## （3）譲渡制限の内容

該当事項はありません。

## （4）受益権の譲渡

- 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

2023年1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年間に於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・管理委員会において、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運用部門による自律的な運用管理

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、運用部門内の管理担当部署は逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また、運用戦略・管理委員会を通じて運用状況のモニタリングを行い、運用部門内での自律的牽制により運用改善を図ります。

###### ⑥管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署は、（a）運用に関するパフォーマンス測定・分析、意図した運用成果が得られていない場合にはその原因の分析のほか、（b）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、（a）についてはファンド管理委員会における審議を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバックされ、（b）についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

###### ⑦ファンドに係る法人等の管理

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

2023年1月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

| 商品分類       | 本数<br>(本) | 純資産総額<br>(百万円) |
|------------|-----------|----------------|
| 追加型株式投資信託  | 876       | 22,481,972     |
| 追加型公社債投資信託 | 16        | 1,443,997      |
| 単位型株式投資信託  | 91        | 422,774        |
| 単位型公社債投資信託 | 51        | 120,386        |
| 合 計        | 1,034     | 24,469,129     |

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37期事業年度（自 令和3年4月1日 至 令和4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38期事業年度に係る中間会計期間（自 令和4年4月1日 至 令和4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36期<br>(令和3年3月31日現在) |             | 第37期<br>(令和4年3月31日現在) |             |
|------------|-----------------------|-------------|-----------------------|-------------|
| (資産の部)     |                       |             |                       |             |
| 流動資産       |                       |             |                       |             |
| 現金及び預金     | ※2                    | 56,803,388  | ※2                    | 51,593,362  |
| 有価証券       |                       | 2,001       |                       | 293,326     |
| 前払費用       |                       | 598,135     |                       | 645,109     |
| 未収入金       |                       | 31,359      |                       | 61,092      |
| 未収委託者報酬    |                       | 13,216,357  |                       | 15,750,264  |
| 未収収益       | ※2                    | 662,230     | ※2                    | 783,790     |
| 金銭の信託      |                       | 2,300,000   |                       | 8,401,300   |
| その他        |                       | 269,506     |                       | 295,584     |
| 流動資産合計     |                       | 73,882,978  |                       | 77,823,830  |
| 固定資産       |                       |             |                       |             |
| 有形固定資産     |                       |             |                       |             |
| 建物         | ※1                    | 548,902     | ※1                    | 391,042     |
| 器具備品       | ※1                    | 1,435,369   | ※1                    | 1,079,023   |
| 土地         |                       | 628,433     |                       | 628,433     |
| 有形固定資産合計   |                       | 2,612,705   |                       | 2,098,499   |
| 無形固定資産     |                       |             |                       |             |
| 電話加入権      |                       | 15,822      |                       | 15,822      |
| ソフトウェア     |                       | 3,569,171   |                       | 4,381,293   |
| ソフトウェア仮勘定  |                       | 1,895,190   |                       | 1,581,652   |
| 無形固定資産合計   |                       | 5,480,184   |                       | 5,978,768   |
| 投資その他の資産   |                       |             |                       |             |
| 投資有価証券     |                       | 18,616,670  |                       | 16,803,642  |
| 関係会社株式     |                       | 320,136     |                       | 159,536     |
| 投資不動産      | ※1                    | 814,684     | ※1                    | 810,684     |
| 長期差入保証金    |                       | 538,497     |                       | 524,244     |
| 前払年金費用     |                       | 258,835     |                       | 189,708     |
| 繰延税金資産     |                       | 916,962     |                       | 982,406     |
| 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 |                       | 21,487,417  |                       | 19,491,852  |
| 固定資産合計     |                       | 29,580,307  |                       | 27,569,120  |
| 資産合計       |                       | 103,463,286 |                       | 105,392,950 |

(単位：千円)

|        | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) | 第37期<br>(令和4年3月31日現在) |
|--------|-----------------------|-----------------------|
| (負債の部) |                       |                       |
| 流動負債   |                       |                       |

|           |              |              |
|-----------|--------------|--------------|
| 預り金       | 533,622      | 565,222      |
| 未払金       |              |              |
| 未払収益分配金   | 158,856      | 197,334      |
| 未払償還金     | 133,877      | 7,418        |
| 未払手数料     | ※2 5,200,810 | ※2 6,423,139 |
| その他未払金    | ※2 4,412,521 | ※2 4,565,457 |
| 未払費用      | ※2 4,755,909 | ※2 4,328,968 |
| 未払消費税等    | 752,617      | 1,112,923    |
| 未払法人税等    | 873,027      | 769,692      |
| 賞与引当金     | 933,381      | 942,287      |
| 役員賞与引当金   | 160,710      | 149,028      |
| その他       | 691,143      | 5,517        |
| 流動負債合計    | 18,606,476   | 19,066,990   |
| 固定負債      |              |              |
| 長期未払金     | 21,600       | 10,800       |
| 退職給付引当金   | 1,145,514    | 1,246,300    |
| 役員退職慰労引当金 | 117,938      | 117,938      |
| 時効後支払損引当金 | 245,426      | 250,214      |
| 固定負債合計    | 1,530,479    | 1,625,252    |
| 負債合計      | 20,136,956   | 20,692,243   |
| (純資産の部)   |              |              |
| 株主資本      |              |              |
| 資本金       | 2,000,131    | 2,000,131    |
| 資本剰余金     |              |              |
| 資本準備金     | 3,572,096    | 3,572,096    |
| その他資本剰余金  | 41,160,616   | 41,160,616   |
| 資本剰余金合計   | 44,732,712   | 44,732,712   |
| 利益剰余金     |              |              |
| 利益準備金     | 342,589      | 342,589      |
| その他利益剰余金  |              |              |
| 別途積立金     | 6,998,000    | 6,998,000    |
| 繰越利益剰余金   | 26,951,289   | 29,000,498   |
| 利益剰余金合計   | 34,291,879   | 36,341,088   |
| 株主資本合計    | 81,024,723   | 83,073,932   |

(単位：千円)

|              | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) | 第37期<br>(令和4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 | 2,301,606             | 1,626,775             |
| 評価・換算差額等合計   | 2,301,606             | 1,626,775             |
| 純資産合計        | 83,326,329            | 84,700,707            |
| 負債純資産合計      | 103,463,286           | 105,392,950           |

## (2) 【損益計算書】

| (単位：千円)     |                                     |            |                                     |            |
|-------------|-------------------------------------|------------|-------------------------------------|------------|
|             | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) |            | 第37期<br>(自 令和3年4月1日<br>至 令和4年3月31日) |            |
| 営業収益        |                                     |            |                                     |            |
| 委託者報酬       |                                     | 67,963,712 |                                     | 79,977,953 |
| 投資顧問料       |                                     | 2,443,980  |                                     | 2,711,169  |
| その他営業収益     |                                     | 21,613     |                                     | 13,459     |
| 営業収益合計      |                                     | 70,429,306 |                                     | 82,702,582 |
| 営業費用        |                                     |            |                                     |            |
| 支払手数料       | ※2                                  | 26,689,896 | ※2                                  | 31,644,834 |
| 広告宣伝費       |                                     | 668,150    |                                     | 720,785    |
| 公告費         |                                     | 250        |                                     | 500        |
| 調査費         |                                     |            |                                     |            |
| 調査費         |                                     | 2,077,942  |                                     | 2,430,158  |
| 委託調査費       |                                     | 12,035,954 |                                     | 14,557,009 |
| 事務委託費       |                                     | 798,528    |                                     | 1,450,062  |
| 営業雑経費       |                                     |            |                                     |            |
| 通信費         |                                     | 296,490    |                                     | 138,868    |
| 印刷費         |                                     | 378,180    |                                     | 379,428    |
| 協会費         |                                     | 51,841     |                                     | 49,590     |
| 諸会費         |                                     | 16,613     |                                     | 17,729     |
| 事務機器関連費     |                                     | 1,977,769  |                                     | 2,172,978  |
| その他営業雑経費    |                                     | 8,391      |                                     | 649        |
| 営業費用合計      |                                     | 45,000,009 |                                     | 53,562,596 |
| 一般管理費       |                                     |            |                                     |            |
| 給料          |                                     |            |                                     |            |
| 役員報酬        |                                     | 352,879    |                                     | 414,260    |
| 給料・手当       |                                     | 6,461,546  |                                     | 6,496,233  |
| 賞与引当金繰入     |                                     | 933,381    |                                     | 942,287    |
| 役員賞与引当金繰入   |                                     | 160,710    |                                     | 149,028    |
| 福利厚生費       |                                     | 1,272,568  |                                     | 1,282,310  |
| 交際費         |                                     | 2,721      |                                     | 4,874      |
| 旅費交通費       |                                     | 22,768     |                                     | 21,698     |
| 租税公課        |                                     | 402,939    |                                     | 430,233    |
| 不動産賃借料      |                                     | 666,331    |                                     | 724,961    |
| 退職給付費用      |                                     | 481,135    |                                     | 494,615    |
| 役員退職慰労引当金繰入 |                                     | 11,763     |                                     | -          |
| 固定資産減価償却費   |                                     | 1,358,911  |                                     | 2,249,287  |
| 諸経費         |                                     | 413,538    |                                     | 379,054    |
| 一般管理費合計     |                                     | 12,541,193 |                                     | 13,588,846 |
| 営業利益        |                                     | 12,888,103 |                                     | 15,551,139 |

(単位：千円)

|  | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) |  | 第37期<br>(自 令和3年4月1日<br>至 令和4年3月31日) |  |
|--|-------------------------------------|--|-------------------------------------|--|
|--|-------------------------------------|--|-------------------------------------|--|

|              |    |            |              |
|--------------|----|------------|--------------|
| 営業外収益        |    |            |              |
| 受取配当金        |    | 170,807    | 243,133      |
| 受取利息         | ※2 | 2,726      | ※2 7,408     |
| 投資有価証券償還益    |    | 81,557     | 1,089,101    |
| 収益分配金等時効完成分  |    | 275,835    | 137,485      |
| 受取賃貸料        | ※2 | 65,808     | ※2 65,808    |
| その他          |    | 12,504     | 36,211       |
| 営業外収益合計      |    | 609,239    | 1,579,148    |
| 営業外費用        |    |            |              |
| 投資有価証券償還損    |    | 95,946     | 3,074        |
| 時効後支払損引当金繰入  |    | 16,395     | 16,548       |
| 事務過誤費        |    | -          | 76,076       |
| 賃貸関連費用       |    | 13,472     | 15,780       |
| その他          |    | 2,932      | 7,585        |
| 営業外費用合計      |    | 128,747    | 119,066      |
| 経常利益         |    | 13,368,595 | 17,011,221   |
| 特別利益         |    |            |              |
| 投資有価証券売却益    |    | 2,007,655  | 605,706      |
| 特別利益合計       |    | 2,007,655  | 605,706      |
| 特別損失         |    |            |              |
| 投資有価証券売却損    |    | 51,737     | 28,188       |
| 投資有価証券評価損    |    | 26,317     | 36,558       |
| 固定資産除却損      | ※1 | 536        | ※1 13,094    |
| 特別損失合計       |    | 78,591     | 77,840       |
| 税引前当期純利益     |    | 15,297,659 | 17,539,087   |
| 法人税、住民税及び事業税 | ※2 | 4,755,427  | ※2 5,366,608 |
| 法人税等調整額      |    | △19,122    | 22,446       |
| 法人税等合計       |    | 4,736,304  | 5,389,054    |
| 当期純利益        |    | 10,561,354 | 12,150,032   |

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

（単位：千円）

|                             | 株主資本      |           |              |             |           |           |             |             |            |
|-----------------------------|-----------|-----------|--------------|-------------|-----------|-----------|-------------|-------------|------------|
|                             | 資本金       | 資本剰余金     |              |             | 利益剰余金     |           |             |             | 株主資本合計     |
|                             |           | 資本<br>準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本<br>剰余金合計 | 利益<br>準備金 | その他利益剰余金  |             | 利益剰余金<br>合計 |            |
|                             |           |           |              |             |           | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>剰余金 |             |            |
| 当期首残高                       | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616   | 44,732,712  | 342,589   | 6,998,000 | 25,847,605  | 33,188,194  | 79,921,039 |
| 当期変動額                       |           |           |              |             |           |           |             |             |            |
| 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<br>項目の当期変動額<br>(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



|                             | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>差額等合計 | 純資産合計      |
|-----------------------------|----------------------|----------------|------------|
| 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<br>項目の当期変動額<br>（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 |

## 第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日）

（単位：千円）

|                     | 株主資本      |           |              |             |           |           |             |             | 株主資本合計      |             |
|---------------------|-----------|-----------|--------------|-------------|-----------|-----------|-------------|-------------|-------------|-------------|
|                     | 資本金       | 資本剰余金     |              |             | 利益剰余金     |           |             | 株主資本合計      |             |             |
|                     |           | 資本<br>準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本<br>剰余金合計 | 利益<br>準備金 | その他利益剰余金  |             |             |             | 利益剰余金<br>合計 |
|                     |           |           |              |             |           | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>剰余金 |             |             |             |
| 当期首残高               | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616   | 44,732,712  | 342,589   | 6,998,000 | 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  |             |
| 当期変動額               |           |           |              |             |           |           |             |             |             |             |
| 剰余金の配当              |           |           |              |             |           |           | △10,576,511 | △10,576,511 | △10,576,511 |             |
| 当期純利益               |           |           |              |             |           |           | 12,150,032  | 12,150,032  | 12,150,032  |             |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） |           |           |              |             |           |           |             |             |             |             |
| 当期変動額合計             | —         | —         | —            | —           | —         | —         | 1,573,521   | 1,573,521   | 1,573,521   |             |
| 当期末残高               | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616   | 44,732,712  | 342,589   | 6,998,000 | 29,000,498  | 36,341,088  | 83,073,932  |             |

|                             | 評価・換算差額等             |                | 純資産合計       |
|-----------------------------|----------------------|----------------|-------------|
|                             | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>差額等合計 |             |
| 当期首残高                       | 2,301,606            | 2,301,606      | 83,326,329  |
| 会計方針の変更による<br>累積的影響額        |                      |                | 475,687     |
| 会計方針の変更を<br>反映した当期首残高       | 2,301,606            | 2,301,606      | 83,802,017  |
| 当期変動額                       |                      |                |             |
| 剰余金の配当                      |                      |                | △10,576,511 |
| 当期純利益                       |                      |                | 12,150,032  |
| 株主資本以外の<br>項目の当期変動額<br>（純額） | △674,831             | △674,831       | △674,831    |
| 当期変動額合計                     | △674,831             | △674,831       | 898,690     |
| 当期末残高                       | 1,626,775            | 1,626,775      | 84,700,707  |

## [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

市場価格のない株式等以外のもの

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. 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. 収益及び費用の計上基準

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。委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受領しております。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。投資顧問料は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を主に年4回受領しております。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。

## 7. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

### (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、「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」（実務対応報告第39号 令和2年3月31日）により「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日）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。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取り扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 令和3年8月12日）を適用する予定であります。

### （会計方針の変更）

#### (1) 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。）等を当事業年度の期首から適用し、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、当事業年度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、当事業年度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、当事業年度の貸借対照表は、流動負債のその他は484,886千円減少、繰延税金資産は148,472千円減少、繰越利益剰余金は336,414千円増加しております。

当事業年度の損益計算書は、委託者報酬、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ200,739千円減少しております。

当事業年度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、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。

#### (2) 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。）等を当事業年度の期首から適用し、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、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。

### （未適用の会計基準等）

「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3年6月17日）

#### (1) 概要

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 企業会計基準適用指針第31号）の令和3年6月17日の改正は、令和元年7月4日の公表時において、「投資信託の時価の算定」に関する検討には、関係者との協議等に一定の期間が必要と考えられるため、また、「貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資」の時価の注記についても、一定の検討を要するため、「時価の算定に関する会計基準」公表後、概ね1年をかけて検討を行うこととされていたものが、改正され、公表されたものです。

#### (2) 適用予定日

令和5年3月期の期首より適用します。

#### (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の適用指針」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36期<br>(令和3年3月31日現在) | 第37期<br>(令和4年3月31日現在) |
|-------|-----------------------|-----------------------|
| 建物    | 643,920千円             | 805,250千円             |
| 器具備品  | 1,545,179千円           | 2,054,366千円           |
| 投資不動産 | 151,833千円             | 157,995千円             |

## ※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36期<br>(令和3年3月31日現在) | 第37期<br>(令和4年3月31日現在) |
|--------|-----------------------|-----------------------|
| 預金     | 40,328,414千円          | 43,782,913千円          |
| 未収収益   | 14,138千円              | 13,741千円              |
| 未払手数料  | 772,495千円             | 836,105千円             |
| その他未払金 | 3,425,136千円           | 3,887,520千円           |
| 未払費用   | 349,222千円             | 337,847千円             |

## (損益計算書関係)

## ※1.固定資産除却損の内訳

|      | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) | 第37期<br>(自 令和3年4月1日<br>至 令和4年3月31日) |
|------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 建物   | -                                   | 2,599千円                             |
| 器具備品 | 536千円                               | 10,495千円                            |
| 計    | 536千円                               | 13,094千円                            |

## ※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36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) | 第37期<br>(自 令和3年4月1日<br>至 令和4年3月31日) |
|--------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 支払手数料        | 5,128,270千円                         | 5,153,589千円                         |
| 受取利息         | 143千円                               | 7,377千円                             |
| 受取賃貸料        | 65,808千円                            | 65,808千円                            |
| 法人税、住民税及び事業税 | 3,492,898千円                         | 4,062,765千円                         |

## (株主資本等変動計算書関係)

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<br>株式数（株） | 当事業年度増加<br>株式数（株） | 当事業年度減少<br>株式数（株） | 当事業年度末<br>株式数（株） |
|-------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 発行済株式 |                   |                   |                   |                  |
| 普通株式  | 211,581           | —                 | —                 | 211,581          |
| 合計    | 211,581           | —                 | —                 | 211,581          |

## 2.配当に関する事項

## (1)配当金支払額

令和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    |

第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

令和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 | 1株当たり配当額 | 49,988円      |
| ③ | 基準日      | 令和3年3月31日    |
| ④ | 効力発生日    | 令和3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4年6月28日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

|   |          |             |
|---|----------|-------------|
| ① | 配当金の総額   | 6,075,125千円 |
| ② | 配当の原資    | 利益剰余金       |
| ③ | 1株当たり配当額 | 28,713円     |
| ④ | 基準日      | 令和4年3月31日   |
| ⑤ | 効力発生日    | 令和4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36期<br>(令和3年3月31日現在) | 第37期<br>(令和4年3月31日現在) |
|-----|-----------------------|-----------------------|
| 1年内 | 709,808千円             | 709,808千円             |
| 1年超 | 709,808千円             | 414,054千円             |
| 合計  | 1,419,616千円           | 1,123,863千円           |

## (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。

## 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、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）。

第36期(令和3年3月31日現在)

|            | 貸借対照表<br>計上額（千円） | 時価（千円）     | 差額（千円） |
|------------|------------------|------------|--------|
| (1) 有価証券   | 2,001            | 2,001      | —      |
| (2) 金銭の信託  | 2,300,000        | 2,300,000  | —      |
| (3) 投資有価証券 | 18,585,310       | 18,585,310 | —      |
| 資産計        | 20,887,311       | 20,887,311 | —      |

(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) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（前事業年度の貸借対照表計上額31,360千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(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（前事業年度の貸借対照表計上額 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、記載していません。

(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。

(注4) 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36期(令和3年3月31日現在)

(単位：千円)

|                   | 1年以内       | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超   |
|-------------------|------------|-------------|--------------|--------|
| 現金及び預金            | 56,803,388 | —           | —            | —      |
| 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 |

第37期(令和4年3月31日現在)

|            | 貸借対照表<br>計上額（千円） | 時価（千円）     | 差額（千円） |
|------------|------------------|------------|--------|
| (1) 有価証券   | 293,326          | 293,326    | —      |
| (2) 金銭の信託  | 8,401,300        | 8,401,300  | —      |
| (3) 投資有価証券 | 16,772,282       | 16,772,282 | —      |
| 資産計        | 25,466,909       | 25,466,909 | —      |

(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（当事業年度の貸借対照表計上額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、関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額 関連会社株式159,536千円）は、市場価格がないため、記載していません。

(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。

(注4) 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37期(令和4年3月31日現在)

(単位：千円)

|  | 1年以内 | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超 |
|--|------|-------------|--------------|------|
|  |      |             |              |      |

|                   |            |           |           |   |
|-------------------|------------|-----------|-----------|---|
| 現金及び預金            | 51,593,362 | —         | —         | — |
| 金銭の信託             | 8,401,300  | —         | —         | — |
| 未収委託者報酬           | 15,750,264 | —         | —         | — |
| 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              | 293,326    | 6,911,464 | 3,695,585 | — |
| 合計                | 76,038,253 | 6,911,464 | 3,695,585 | — |

### 3.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、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（貸借対照表計上額 有価証券 293,326千円、投資有価証券16,772,282千円）は、次表には含めておりません。

#### 時価をもって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 | —      | 8,401,300 | —    | 8,401,300 |
| 資産計   | —      | 8,401,300 | —    | 8,401,300 |

（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）

#### 1.子会社株式及び関連会社株式

前事業年度の子会社株式及び関連会社株式（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。

また、当事業年度の関連会社株式（貸借対照表計上額は関連会社株式159,536千円）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

##### 第36期(令和3年3月31日現在)

|                      | 種類  | 貸借対照表計上額<br>（千円） | 取得原価<br>（千円） | 差額（千円）    |
|----------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの  | 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、取得原価は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。

### 第37期(令和4年3月31日現在)

|                      | 種類  | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額（千円）    |
|----------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの  | 株式  | —                | —            | —         |
|                      | 債券  | —                | —            | —         |
|                      | その他 | 19,193,250       | 16,560,340   | 2,632,910 |
|                      | 小計  | 19,193,250       | 16,560,340   | 2,632,910 |
| 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 | 6,273,658        | 6,561,836    | △288,177  |
|                      | 小計  | 6,273,658        | 6,561,836    | △288,177  |
| 合計                   |     | 25,466,909       | 23,122,176   | 2,344,732 |

（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8,401,300千円、取得原価は8,400,000千円）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、市場価格がないため、含めておりません。

### 3.売却したその他有価証券

#### 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      |

#### 第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4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 | 4,164,921 | 605,706     | 28,188      |
| 合計  | 4,164,921 | 605,706     | 28,188      |

### 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。

当事業年度において、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、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36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) | 第37期<br>(自 令和3年4月1日<br>至 令和4年3月31日) |
|------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 退職給付債務の期首残高      | 3,718,736 千円                        | 3,729,235 千円                        |
| 勤務費用             | 203,106                             | 198,457                             |
| 利息費用             | 19,110                              | 21,549                              |
| 数理計算上の差異の<br>発生額 | △18,826                             | △46,069                             |
| 退職給付の支払額         | △192,890                            | △179,650                            |
| 過去勤務費用の発生額       | —                                   | —                                   |
| 退職給付債務の期末残高      | 3,729,235                           | 3,723,521                           |

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

|                  | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) | 第37期<br>(自 令和3年4月1日<br>至 令和4年3月31日) |
|------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 年金資産の期首残高        | 2,460,824 千円                        | 2,649,846 千円                        |
| 期待運用収益           | 44,130                              | 47,588                              |
| 数理計算上の差異の<br>発生額 | 304,281                             | 1,824                               |
| 事業主からの拠出額        | —                                   | —                                   |
| 退職給付の支払額         | △159,390                            | △115,331                            |
| 年金資産の期末残高        | 2,649,846                           | 2,583,927                           |

## (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36期<br>(令和3年3月31日現在) | 第37期<br>(令和4年3月31日現在) |
|---------------------|-----------------------|-----------------------|
| 積立型制度の<br>退職給付債務    | 2,810,893 千円          | 2,675,015 千円          |
| 年金資産                | △2,649,846            | △2,583,927            |
|                     | 161,046               | 91,087                |
| 非積立型制度の退職給付債務       | 918,342               | 1,048,506             |
| 未積立退職給付債務           | 1,079,388             | 1,139,593             |
| 未認識数理計算上の差異         | 161,333               | 205,679               |
| 未認識過去勤務費用           | △354,043              | △288,681              |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 886,678               | 1,056,591             |
| 退職給付引当金             | 1,145,514             | 1,246,300             |
| 前払年金費用              | △258,835              | △189,708              |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 886,678               | 1,056,591             |

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

|                    | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) | 第37期<br>(自 令和3年4月1日<br>至 令和4年3月31日) |
|--------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 勤務費用               | 203,106 千円                          | 198,457 千円                          |
| 利息費用               | 19,110                              | 21,549                              |
| 期待運用収益             | △44,130                             | △47,588                             |
| 数理計算上の差異の<br>費用処理額 | 41,361                              | △3,547                              |
| 過去勤務費用の費用処理額       | 65,361                              | 65,361                              |

|                 |         |         |
|-----------------|---------|---------|
| その他             | 44,446  | 109,013 |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 329,255 | 343,245 |

(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36期<br>(令和3年3月31日現在) | 第37期<br>(令和4年3月31日現在) |
|-----|-----------------------|-----------------------|
| 債券  | 62.7 %                | 62.0 %                |
| 株式  | 35.4                  | 36.3                  |
| その他 | 1.9                   | 1.7                   |
| 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36期<br>(令和3年3月31日現在) | 第37期<br>(令和4年3月31日現在) |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| 割引率       | 0.051～0.59%           | 0.078～0.72%           |
| 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151,880千円、当事業年度151,370千円であります。

#### (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36期<br>(令和3年3月31日現在) | 第37期<br>(令和4年3月31日現在) |
|---------------|-----------------------|-----------------------|
| 繰延税金資産        |                       |                       |
| 減損損失          | 418,394千円             | 410,082千円             |
| 投資有価証券評価損     | 188,859               | 65,490                |
| 未払事業税         | 180,263               | 165,702               |
| 賞与引当金         | 285,801               | 288,528               |
| 役員賞与引当金       | 25,472                | 25,799                |
| 役員退職慰労引当金     | 36,112                | 36,112                |
| 退職給付引当金       | 350,756               | 381,617               |
| 減価償却超過額       | 68,024                | 145,316               |
| 委託者報酬         | 209,938               | -                     |
| 長期差入保証金       | 48,639                | 52,869                |
| 時効後支払損引当金     | 75,149                | 76,615                |
| 連結納税適用による時価評価 | 38,873                | 35,311                |
| その他           | 87,023                | 76,257                |
| 繰延税金資産 小計     | 2,013,308             | 1,759,702             |
| 評価性引当額        | —                     | —                     |
| 繰延税金資産 合計     | 2,013,308             | 1,759,702             |

##### 繰延税金負債

|               |            |          |
|---------------|------------|----------|
| 前払年金費用        | △79,225    | △58,088  |
| 連結納税適用による時価評価 | △1,203     | △1,149   |
| その他有価証券評価差額金  | △1,015,785 | △717,957 |
| その他           | △101       | △101     |
| 繰延税金負債 合計     | △1,096,346 | △777,296 |
| 繰延税金資産の純額     | 916,962    | 982,406  |

## 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36期（令和3年3月31日現在）及び第37期（令和4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。

### （収益認識関係）

#### 1.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。

#### 2.顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は、「（重要な会計方針）の6.収益および費用の計上基準」に記載のとおりであります。

#### 3.顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

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36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）及び第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4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36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）及び第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4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<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                                 | 取引の内容                                 | 取引金額<br>(注4)    | 科目     | 期末残高<br>(注4)    |
|-----|----------------------------|-----------------|------------------|-------------|------------------------|-----------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|--------|-----------------|
| 親会社 | ㈱三菱UFJ<br>フィナンシャル・<br>グループ | 東京都<br>千代田<br>区 | 2,141,513<br>百万円 | 銀行持株<br>会社業 | 被所有<br>間接<br>100.0%    | 連結納税                                          | 連結納税に<br>伴う支払<br>(注1)                 | 3,492,898<br>千円 | その他未払金 | 3,425,136<br>千円 |
| 親会社 | 三菱UFJ<br>信託銀行㈱             | 東京都<br>千代田<br>区 | 324,279<br>百万円   | 信託業、<br>銀行業 | 被所有<br>直接<br>100.0%    | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料の<br>支払<br>(注2) | 5,128,270<br>千円 | 未払手数料  | 772,495<br>千円   |
|     |                            |                 |                  |             |                        | 投資の助言<br><br>役員の兼任                            | 投資助言料<br>(注3)                         | 523,327<br>千円   | 未払費用   | 290,120<br>千円   |

第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日）

| 種類  | 会社等の名称                     | 所在地             | 資本金              | 事業の内容       | 議決権等の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                                 | 取引の内容                                 | 取引金額<br>(注4)    | 科目     | 期末残高<br>(注4)    |
|-----|----------------------------|-----------------|------------------|-------------|------------------------|-----------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|--------|-----------------|
| 親会社 | ㈱三菱UFJ<br>フィナンシャル・<br>グループ | 東京都<br>千代田<br>区 | 2,141,513<br>百万円 | 銀行持株<br>会社業 | 被所有<br>間接<br>100.0%    | 連結納税                                          | 連結納税に<br>伴う支払<br>(注1)                 | 4,062,765<br>千円 | その他未払金 | 3,887,520<br>千円 |
| 親会社 | 三菱UFJ<br>信託銀行㈱             | 東京都<br>千代田<br>区 | 324,279<br>百万円   | 信託業、<br>銀行業 | 被所有<br>直接<br>100.0%    | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料の<br>支払<br>(注2) | 5,153,589<br>千円 | 未払手数料  | 836,105<br>千円   |
|     |                            |                 |                  |             |                        | 投資の助言<br><br>役員の兼任                            | 投資助言料<br>(注3)                         | 499,388<br>千円   | 未払費用   | 272,264<br>千円   |

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

- （注） 1. 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。  
 2. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。  
 3. 投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。  
 4. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

#### （2）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第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<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係 | 取引の内容 | 取引金額<br>(注2) | 科目 | 期末残高<br>(注2) |
|----|--------|-----|-----|-------|------------------------|---------------|-------|--------------|----|--------------|
|----|--------|-----|-----|-------|------------------------|---------------|-------|--------------|----|--------------|

|             |                      |         |                  |     |    |                               |                           |                 |       |                 |
|-------------|----------------------|---------|------------------|-----|----|-------------------------------|---------------------------|-----------------|-------|-----------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | (株)三菱UFJ銀行           | 東京都千代田区 | 1,711,958<br>百万円 | 銀行業 | なし | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払<br>(注1) | 3,729,785<br>千円 | 未払手数料 | 764,501<br>千円   |
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJモルガン・スタンレー証券(株) | 東京都千代田区 | 40,500<br>百万円    | 証券業 | なし | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払<br>(注1) | 5,655,482<br>千円 | 未払手数料 | 1,193,245<br>千円 |

## 第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日）

| 種類          | 会社等の名称               | 所在地     | 資本金              | 事業の内容 | 議決権等の所有<br>(被所有)割合 | 関連当事者との関係                     | 取引の内容                     | 取引金額<br>(注2)    | 科目    | 期末残高<br>(注2)    |
|-------------|----------------------|---------|------------------|-------|--------------------|-------------------------------|---------------------------|-----------------|-------|-----------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | (株)三菱UFJ銀行           | 東京都千代田区 | 1,711,958<br>百万円 | 銀行業   | なし                 | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払<br>(注1) | 4,097,951<br>千円 | 未払手数料 | 838,058<br>千円   |
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJモルガン・スタンレー証券(株) | 東京都千代田区 | 40,500<br>百万円    | 証券業   | なし                 | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払<br>(注1) | 7,025,984<br>千円 | 未払手数料 | 1,319,958<br>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. 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36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) | 第37期<br>(自 令和3年4月1日<br>至 令和4年3月31日) |
|--|-------------------------------------|-------------------------------------|
|--|-------------------------------------|-------------------------------------|

|              |             |             |
|--------------|-------------|-------------|
| 1株当たり純資産額    | 393,827.09円 | 400,322.84円 |
| 1株当たり当期純利益金額 | 49,916.36円  | 57,424.97円  |

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

2. 「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、当事業年度の1株当たり純資産額は2,248.25円増加し、1株当たり純利益金額は658.24円減少しております。

3. 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36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) | 第37期<br>(自 令和3年4月1日<br>至 令和4年3月31日) |
|---------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 当期純利益金額 (千円)        | 10,561,354                          | 12,150,032                          |
| 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) | 10,561,354                          | 12,150,032                          |
| 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38期中間会計期間  
(令和4年9月30日現在)

#### (資産の部)

##### 流動資産

|         |            |
|---------|------------|
| 現金及び預金  | 48,375,193 |
| 有価証券    | 270,676    |
| 前払費用    | 804,517    |
| 未収入金    | 78,340     |
| 未収委託者報酬 | 16,141,814 |
| 未収収益    | 751,362    |
| 金銭の信託   | 10,401,500 |
| その他     | 264,566    |
| 流動資産合計  | 77,087,971 |

##### 固定資産

##### 有形固定資産

|          |    |           |
|----------|----|-----------|
| 建物       | ※1 | 285,704   |
| 器具備品     | ※1 | 898,241   |
| 土地       |    | 628,433   |
| 建設仮勘定    |    | 39,450    |
| 有形固定資産合計 |    | 1,851,829 |

##### 無形固定資産

|           |  |           |
|-----------|--|-----------|
| 電話加入権     |  | 15,822    |
| ソフトウェア    |  | 4,470,447 |
| ソフトウェア仮勘定 |  | 1,585,322 |
| 無形固定資産合計  |  | 6,071,592 |

##### 投資その他の資産

|         |    |            |
|---------|----|------------|
| 投資有価証券  |    | 14,693,980 |
| 関係会社株式  |    | 159,536    |
| 投資不動産   | ※1 | 809,716    |
| 長期差入保証金 |    | 1,204,923  |
| 前払年金費用  |    | 154,270    |
| 繰延税金資産  |    | 1,369,880  |

|            |             |
|------------|-------------|
| その他        | 45,230      |
| 貸倒引当金      | △23,600     |
| 投資その他の資産合計 | 18,413,938  |
| 固定資産合計     | 26,337,361  |
| 資産合計       | 103,425,332 |

(単位：千円)

第38期中間会計期間

(令和4年9月30日現在)

|           |            |
|-----------|------------|
| (負債の部)    |            |
| 流動負債      |            |
| 預り金       | 1,783,230  |
| 未払金       |            |
| 未払収益分配金   | 112,635    |
| 未払償還金     | 7,418      |
| 未払手数料     | 6,226,860  |
| その他未払金    | 575,030    |
| 未払費用      | 5,329,791  |
| 未払消費税等    | ※2 592,374 |
| 未払法人税等    | 2,634,965  |
| 賞与引当金     | 954,015    |
| 役員賞与引当金   | 86,040     |
| その他       | 5,517      |
| 流動負債合計    | 18,307,880 |
| 固定負債      |            |
| 退職給付引当金   | 1,299,571  |
| 役員退職慰労引当金 | 75,667     |
| 時効後支払損引当金 | 261,505    |
| 固定負債合計    | 1,636,744  |
| 負債合計      | 19,944,625 |
| (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   | 28,593,826 |
| 利益剰余金合計   | 35,934,416 |
| 株主資本合計    | 82,667,260 |

(単位：千円)

第38期中間会計期間

(令和4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 | 813,447     |
| 評価・換算差額等合計   | 813,447     |
| 純資産合計        | 83,480,707  |
| 負債純資産合計      | 103,425,332 |

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

| 第38期中間会計期間<br>(自 令和4年4月1日<br>至 令和4年9月30日) |              |
|-------------------------------------------|--------------|
| 営業収益                                      |              |
| 委託者報酬                                     | 40,789,208   |
| 投資顧問料                                     | 1,442,097    |
| その他営業収益                                   | 5,655        |
| 営業収益合計                                    | 42,236,961   |
| 営業費用                                      |              |
| 支払手数料                                     | 15,949,349   |
| 広告宣伝費                                     | 237,620      |
| 公告費                                       | 250          |
| 調査費                                       |              |
| 調査費                                       | 1,359,939    |
| 委託調査費                                     | 7,988,301    |
| 事務委託費                                     | 709,248      |
| 営業雑経費                                     |              |
| 通信費                                       | 64,639       |
| 印刷費                                       | 194,724      |
| 協会費                                       | 27,550       |
| 諸会費                                       | 9,245        |
| 事務機器関連費                                   | 1,088,738    |
| 営業費用合計                                    | 27,629,607   |
| 一般管理費                                     |              |
| 給料                                        |              |
| 役員報酬                                      | 204,466      |
| 給料・手当                                     | 2,770,641    |
| 賞与引当金繰入                                   | 954,015      |
| 役員賞与引当金繰入                                 | 86,040       |
| 福利厚生費                                     | 637,045      |
| 交際費                                       | 4,351        |
| 旅費交通費                                     | 22,970       |
| 租税公課                                      | 219,318      |
| 不動産賃借料                                    | 362,988      |
| 退職給付費用                                    | 193,777      |
| 固定資産減価償却費                                 | ※1 1,198,877 |
| 諸経費                                       | 182,304      |
| 一般管理費合計                                   | 6,836,796    |
| 営業利益                                      | 7,770,556    |

(単位：千円)

| 第38期中間会計期間<br>(自 令和4年4月1日<br>至 令和4年9月30日) |         |
|-------------------------------------------|---------|
| 営業外収益                                     |         |
| 受取配当金                                     | 31,240  |
| 受取利息                                      | 5,115   |
| 投資有価証券償還益                                 | 780     |
| 収益分配金等時効完成分                               | 93,217  |
| 受取賃貸料                                     | 32,904  |
| その他                                       | 32,041  |
| 営業外収益合計                                   | 195,299 |
| 営業外費用                                     |         |



|              |           |
|--------------|-----------|
| 時効後支払損引当金繰入  | 39,158    |
| 事務過誤費        | 1,807     |
| 賃貸関連費用       | ※1 6,770  |
| その他          | 11,805    |
| 営業外費用合計      | 59,541    |
| 経常利益         | 7,906,314 |
| 特別利益         |           |
| 投資有価証券売却益    | 364,481   |
| 特別利益合計       | 364,481   |
| 特別損失         |           |
| 投資有価証券売却損    | 338       |
| 投資有価証券評価損    | 104,554   |
| 固定資産除却損      | 3,528     |
| 特別損失合計       | 108,421   |
| 税引前中間純利益     | 8,162,374 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 2,522,443 |
| 法人税等調整額      | △ 28,522  |
| 法人税等合計       | 2,493,921 |
| 中間純利益        | 5,668,453 |

(3)中間株主資本等変動計算書  
第38期中間会計期間（自 令和4年4月1日 至 令和4年9月30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 | 29,000,498 | 36,341,088 | 83,073,932 |
| 当中間期変動額               |           |           |            |            |         |           |            |            |            |
| 剰余金の配当                |           |           |            |            |         |           | △6,075,125 | △6,075,125 | △6,075,125 |
| 中間純利益                 |           |           |            |            |         |           | 5,668,453  | 5,668,453  | 5,668,453  |
| 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             | —         | —         | —          | —          | —       | —         | △406,671   | △406,671   | △406,671   |
| 当中間期末残高               | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616 | 44,732,712 | 342,589 | 6,998,000 | 28,593,826 | 35,934,416 | 82,667,260 |

|                       | 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                 | 1,626,775    | 1,626,775  | 84,700,707  |
| 当中間期変動額               |              |            |             |
| 剰余金の配当                |              |            | △6,075,125  |
| 中間純利益                 |              |            | 5,668,453   |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） | △813,328     | △813,328   | △813,328    |
| 当中間期変動額合計             | △813,328     | △813,328   | △ 1,220,000 |
| 当中間期末残高               | 813,447      | 813,447    | 83,480,707  |

[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。委託者報酬は、純資産総額

に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受領しております。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。投資顧問料は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を主に年4回受領しております。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

### グループ通算制度の適用

当中間会計期間からグループ通算制度を適用しております。

### [会計方針の変更]

#### (時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用)

「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3年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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、時価算定会計基準適用指針の適用による、中間財務諸表への影響はありません。

#### (追加情報)

当社は、当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日。以下「実務対応報告第42号」という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項(1)に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

### [注記事項]

#### (中間貸借対照表関係)

##### ※1 減価償却累計額

|       | 第38期中間会計期間<br>(令和4年9月30日現在) |
|-------|-----------------------------|
| 建物    | 903,274千円                   |
| 器具備品  | 2,258,329千円                 |
| 投資不動産 | 161,052千円                   |

##### ※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38期中間会計期間<br>(自 令和4年4月1日<br>至 令和4年9月30日) |
|--------|-------------------------------------------|
| 有形固定資産 | 321,137千円                                 |
| 無形固定資産 | 877,740千円                                 |
| 投資不動産  | 3,057千円                                   |

#### (中間株主資本等変動計算書関係)

第38期中間会計期間（自 令和4年4月1日 至 令和4年9月30日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

令和4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   | 6,075,125千円 |
| ② | 配当の原資    | 利益剰余金       |
| ③ | 1株当たり配当額 | 28,713円     |
| ④ | 基準日      | 令和4年3月31日   |
| ⑤ | 効力発生日    | 令和4年6月29日   |

（リース取引関係）

第38期中間会計期間（令和4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 | 880,111千円   |
| 1年超 | 1,932,485千円 |
| 合 計 | 2,812,596千円 |

（金融商品関係）

第38期中間会計期間（令和4年9月30日現在）

### 1. 金融商品の時価等に関する事項

令和4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<br>（千円） | 時価（千円）     | 差額（千円） |
|------------|--------------------|------------|--------|
| (1) 有価証券   | 270,676            | 270,676    | —      |
| (2) 金銭の信託  | 10,401,500         | 10,401,500 | —      |
| (3) 投資有価証券 | 14,662,620         | 14,662,620 | —      |
| 資産計        | 25,334,797         | 25,334,797 |        |

（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 関連会社株式159,536千円）は、市場価格がないため、記載していません。

（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。

#### 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産

| 区分     | 時価（千円）    |            |      |            |
|--------|-----------|------------|------|------------|
|        | レベル1      | レベル2       | レベル3 | 合計         |
| 有価証券   | —         | 270,676    | —    | 270,676    |
| 金銭の信託  | —         | 10,401,500 | —    | 10,401,500 |
| 投資有価証券 | 1,743,912 | 12,918,707 | —    | 14,662,620 |
| 資産計    | 1,743,912 | 23,590,884 | —    | 25,334,797 |

（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

#### 有価証券及び投資有価証券

ETF（上場投資信託）は相場価格を用いて評価しております。ETFは活発な市場で取引されているため、レベル1の時価に分類しております。

ETF（上場投資信託）以外の投資信託は基準価額を用いて評価しております。基準価額は観察可能なインプットを用いて算出しているため、レベル2の時価に分類しております。

#### 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38期中間会計期間（令和4年9月30日現在）

#### 1. 子会社及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 関連会社株式159,536千円）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<br>計上額（千円） | 取得原価<br>（千円） | 差額（千円）    |
|--------------------------------|-----|--------------------|--------------|-----------|
| 中間貸借対照表<br>計上額が取得原価<br>を超えるもの  | 株式  | —                  | —            | —         |
|                                | 債券  | —                  | —            | —         |
|                                | その他 | 17,920,574         | 16,110,224   | 1,810,349 |
|                                | 小 計 | 17,920,574         | 16,110,224   | 1,810,349 |
| 中間貸借対照表<br>計上額が取得原価<br>を超えないもの | 株式  | —                  | —            | —         |
|                                | 債券  | —                  | —            | —         |
|                                | その他 | 7,414,223          | 8,052,120    | △637,897  |
|                                | 小 計 | 7,414,223          | 8,052,120    | △637,897  |
| 合 計                            |     | 25,334,797         | 24,162,345   | 1,172,451 |

（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10,401,500千円、取得価額10,400,000千円）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、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104,554千円（その他有価証券のその他104,554千円）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38期中間会計期間（自 令和4年4月1日 至 令和4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38期中間会計期間（自 令和4年4月1日 至 令和4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38期中間会計期間<br>(令和4年9月30日現在) |
|--------------------------------------|-----------------------------|
| 1株当たり純資産額                            | 394,556.72円                 |
| (算定上の基礎)                             |                             |
| 純資産の部の合計額（千円）                        | 83,480,707                  |
| 普通株式に係る中間期末の純資産額（千円）                 | 83,480,707                  |
| 1株当たり純資産額の算定に用いられた<br>中間期末の普通株式の数（株） | 211,581                     |

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

|                    | 第38期中間会計期間<br>(自 令和4年4月1日<br>至 令和4年9月30日) |
|--------------------|-------------------------------------------|
| 1株当たり中間純利益金額       | 26,790.93円                                |
| (算定上の基礎)           |                                           |
| 中間純利益金額（千円）        | 5,668,453                                 |
| 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） | 5,668,453                                 |
| 普通株式の期中平均株式数（株）    | 211,581                                   |

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

- ①自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ②運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、も

しくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。)

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

## 5【その他】

### ①定款の変更等

定款について2023年10月1日付で以下の変更を行います。

- ・商号の変更（三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更）

### 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（2022年9月末現在）

##### ③事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### （2）販売会社

| ①名称          | ②資本金の額<br>(2022年9月末現在) | ③事業の内容       |
|--------------|------------------------|--------------|
| 株式会社三菱UFJ銀行  | 1,711,958 百万円          | 銀行業務を営んでいます。 |
| PayPay銀行株式会社 | 37,250 百万円             | 銀行業務を営んでいます。 |
| ソニー銀行株式会社    | 38,500 百万円             | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社北海道銀行    | 93,524 百万円             | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社青森銀行     | 19,562 百万円             | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社山形銀行     | 12,008 百万円             | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社東邦銀行     | 23,519 百万円             | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社足利銀行     | 135,000 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社常陽銀行     | 85,113 百万円             | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社武蔵野銀行    | 45,743 百万円             | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社千葉銀行     | 145,069 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社きらぼし銀行   | 43,734 百万円             | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社横浜銀行     | 215,628 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社第四北越銀行   | 32,776 百万円             | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社山梨中央銀行   | 15,400 百万円             | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社北陸銀行     | 140,409 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |

|               |                               |                               |
|---------------|-------------------------------|-------------------------------|
| 株式会社静岡銀行      | 90,845 百万円                    | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社三十三銀行     | 37,461 百万円                    | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社百五銀行      | 20,000 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。                  |
| 株式会社広島銀行      | 54,573 百万円                    | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社山口銀行      | 10,005 百万円                    | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社四国銀行      | 25,000 百万円                    | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社福岡銀行      | 82,329 百万円                    | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社佐賀銀行      | 16,062 百万円                    | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社十八親和銀行    | 36,878 百万円                    | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社大分銀行      | 19,598 百万円                    | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社宮崎銀行      | 14,697 百万円                    | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社琉球銀行      | 56,967 百万円                    | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社北九州銀行     | 10,000 百万円                    | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社 | 324,279 百万円                   | 銀行業務および信託業務を営んでいます。           |
| 株式会社愛知銀行      | 18,000 百万円                    | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社中京銀行      | 31,879 百万円                    | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社もみじ銀行     | 10,000 百万円                    | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社熊本銀行      | 10,000 百万円                    | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 労働金庫連合会       | 120,000 百万円※                  | 金融業務を営んでいます。                  |
| auカブコム証券株式会社  | 7,196 百万円                     | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 株式会社ＳＢＩ証券     | 48,323 百万円                    | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 岡三証券株式会社      | 5,000 百万円                     | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| ぐんぎん証券株式会社    | 3,000 百万円                     | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 十六ＴＴ証券株式会社    | 3,000 百万円                     | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 大和証券株式会社      | 100,000 百万円                   | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| ちばぎん証券株式会社    | 4,374 百万円                     | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 中銀証券株式会社      | 2,000 百万円                     | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 楽天証券株式会社      | 19,495 百万円<br>(2022年11月30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。 |
| 東海東京証券株式会社    | 6,000 百万円                     | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |



|                       |            |                                   |
|-----------------------|------------|-----------------------------------|
| 東洋証券株式会社              | 13,494 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種<br>金融商品取引業を営んでいます。 |
| 西日本シティＴＴ証券株式会社        | 3,000 百万円  | 金融商品取引法に定める第一種<br>金融商品取引業を営んでいます。 |
| ＳＭＢＣ日興証券株式会社          | 10,000 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種<br>金融商品取引業を営んでいます。 |
| マネックス証券株式会社           | 12,200 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種<br>金融商品取引業を営んでいます。 |
| 浜銀ＴＴ証券株式会社            | 3,307 百万円  | 金融商品取引法に定める第一種<br>金融商品取引業を営んでいます。 |
| ひろぎん証券株式会社            | 5,000 百万円  | 金融商品取引法に定める第一種<br>金融商品取引業を営んでいます。 |
| 松井証券株式会社              | 11,945 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種<br>金融商品取引業を営んでいます。 |
| 丸三証券株式会社              | 10,000 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種<br>金融商品取引業を営んでいます。 |
| 水戸証券株式会社              | 12,272 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種<br>金融商品取引業を営んでいます。 |
| 三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社 | 40,500 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種<br>金融商品取引業を営んでいます。 |
| 三菱ＵＦＪ国際投信株式会社         | 2,000 百万円  | 金融商品取引法に定める第二種<br>金融商品取引業を営んでいます。 |

※労働金庫連合会の資本金の額は「出資金」を記載しております。

## ２【関係業務の概要】

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

## ３【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2023年1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    |
|-------------|---------|
| 2022年 4月25日 | 有価証券届出書 |

|             |               |
|-------------|---------------|
| 2022年 4月25日 | 有価証券報告書       |
| 2022年10月25日 | 有価証券届出書の訂正届出書 |
| 2022年10月25日 | 半期報告書         |

独立監査人の監査報告書

令和4年6月10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<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 青木裕晃 |
|--------------------|-------|------|

|                    |       |      |
|--------------------|-------|------|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 伊藤鉄也 |
|--------------------|-------|------|

## 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4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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

## 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) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

令和5年3月29日

三菱UFJ国際投信株式会社  
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤  
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eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）の令和4年1月27日から令和5年1月26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、eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）の令和5年1月26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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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) １. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
２. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

令和5年3月29日

三菱UFJ国際投信株式会社  
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤  
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eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）の令和4年1月27日から令和5年1月26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、eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）の令和5年1月26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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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) １. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
２. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

令和5年3月29日

三菱UFJ国際投信株式会社  
取締役会 御 中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤  
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eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）の令和4年1月27日から令和5年1月26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、eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）の令和5年1月26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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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) １. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
２. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

令和5年3月29日

三菱UFJ国際投信株式会社  
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤  
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eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）の令和4年1月27日から令和5年1月26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、eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）の令和5年1月26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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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) １． 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
２． XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

令和5年3月29日

三菱UFJ国際投信株式会社  
取締役会 御 中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤  
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eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）の令和4年1月27日から令和5年1月26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、eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）の令和5年1月26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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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) １. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
２. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

令和4年12月2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

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 伊藤 鉄 也

## 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4年4月1日から令和5年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（令和4年4月1日から令和4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4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4年4月1日から令和4年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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



## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。