

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年9月24日提出
【発行者名】	三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 横川 直
【本店の所在の場所】	東京都港区東新橋一丁目９番１号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【電話番号】	03-4223-3037
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	ラップ向けアクティブアロケーションファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	１兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

ラップ向けアクティブアロケーションファンド（「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記の「（１１）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

１兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

（注）基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。

なお、便宜上１万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位

申込単位は販売会社にご確認ください。

（７）【申込期間】

2024年 9月25日から2025年 9月24日まで

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

（８）【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認ください。

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：営業日の9:00～17:00）

（９）【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。
各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

（１０）【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

（１１）【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

当ファンドは、ラップ口座に係る契約に基づいてラップ口座の資金を運用するためのファンドであり、当ファンドの取得申込者は、販売会社にラップ口座を開設のうえ申込みを行うものとします。

同様の権利義務関係を規定する契約の名称は販売会社によって異なります。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、値上がり益の獲得および利子・配当収益の確保をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000億円です。

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

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

商品分類表

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

属性区分表

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

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

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

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

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われ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「ＭＲＦ及びＭＭＦの運営に関する規則」に規定するＭＭＦをいいます。
	ＭＲＦ（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「ＭＲＦ及びＭＭＦの運営に関する規則」に規定するＭＲＦをいいます。
	ＥＴＦ	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

属性区分の定義

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

	公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（ＢＢ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。
投資対象地域	年４回	信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年６回（隔月）	信託約款において、年６回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年１２回（毎月）	信託約款において、年１２回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

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

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

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

日本を含む先進国の株式・債券、日本の不動産投資信託証券および短期公社債等を実質的な主要投資対象とし、値上がり益の獲得および利子・配当収益の確保をめざします。

ファンドの特色

特色

1

投資信託証券への投資を通じて、主として日本を含む先進国の株式・債券、日本の不動産投資信託証券*および短期公社債等を実質的な投資を行います。

- 各資産のそれぞれについて、投資対象となる投資信託証券(以下「指定投資信託証券」といいます。)を指定し、その中から選定した投資信託証券に投資します。
- 指定投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、指定投資信託証券として指定されていた投資信託証券を指定から外したり、新たに投資信託証券(ファンド設定以降に設定された投資信託証券も含みます。)を指定投資信託証券として指定する場合があります。

*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。

■指定投資信託証券(2024年6月末現在)

投資対象地域		
	日本	先進国
投資対象資産	株式	● 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 ● ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド*
	債券	● 日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ ● 国内債券インデックスマザーファンド ● 日本短期債券マザーファンド ● 外国債券インデックスマザーファンド ● ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド* ● 先進国高格付国債マザーファンドⅡ*
	不動産投資信託証券	● 東証REIT指数マザーファンド

*為替ヘッジを行う投資信託証券です。

1 上図に記載の指定投資信託証券以外に、新マネー・マーケット・マザーファンド受益証券を通じて、日本の短期公社債等に投資を行う場合があります。

1 先進国の株式または債券を対象資産とする投資信託証券では、実質的に新興国へ投資する場合があります。

特色

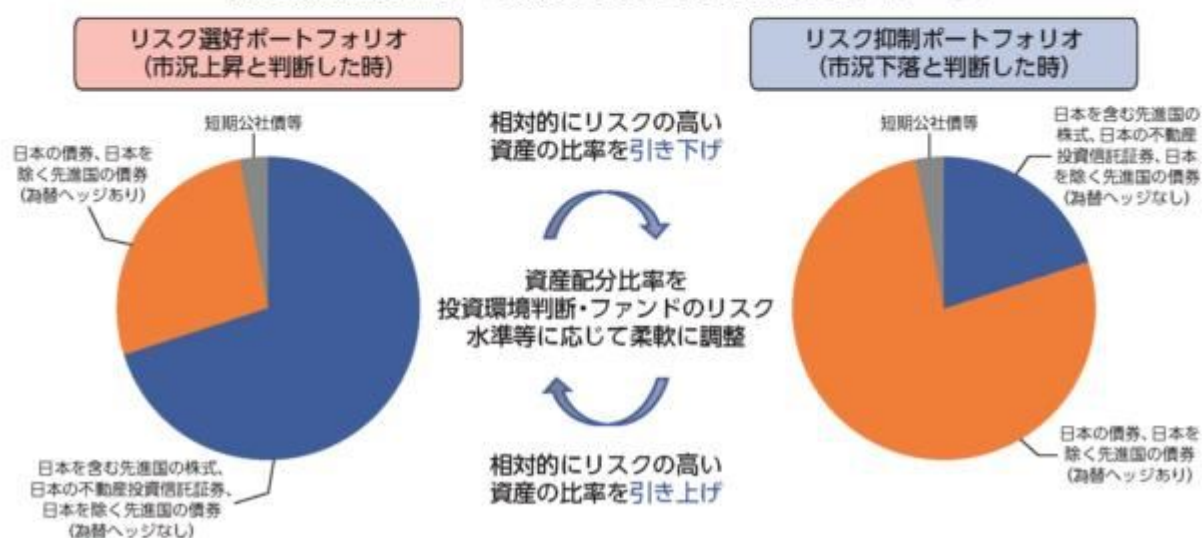
2

三菱UFJ信託銀行からの投資助言に基づき運用を行います。

- 投資対象とする投資信託証券および資産配分比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。
- 投資にあたっては、マクロ経済分析等に基づくトップダウンアプローチ、個別資産の魅力度判断等に基づくボトムアップアプローチにより基本ポートフォリオを決定するとともに、投資環境判断、ファンドのリスク水準等を考慮して機動的に資産配分の変更を行うことで、価格下落リスクの抑制を図りながら安定した収益の獲得をめざします。

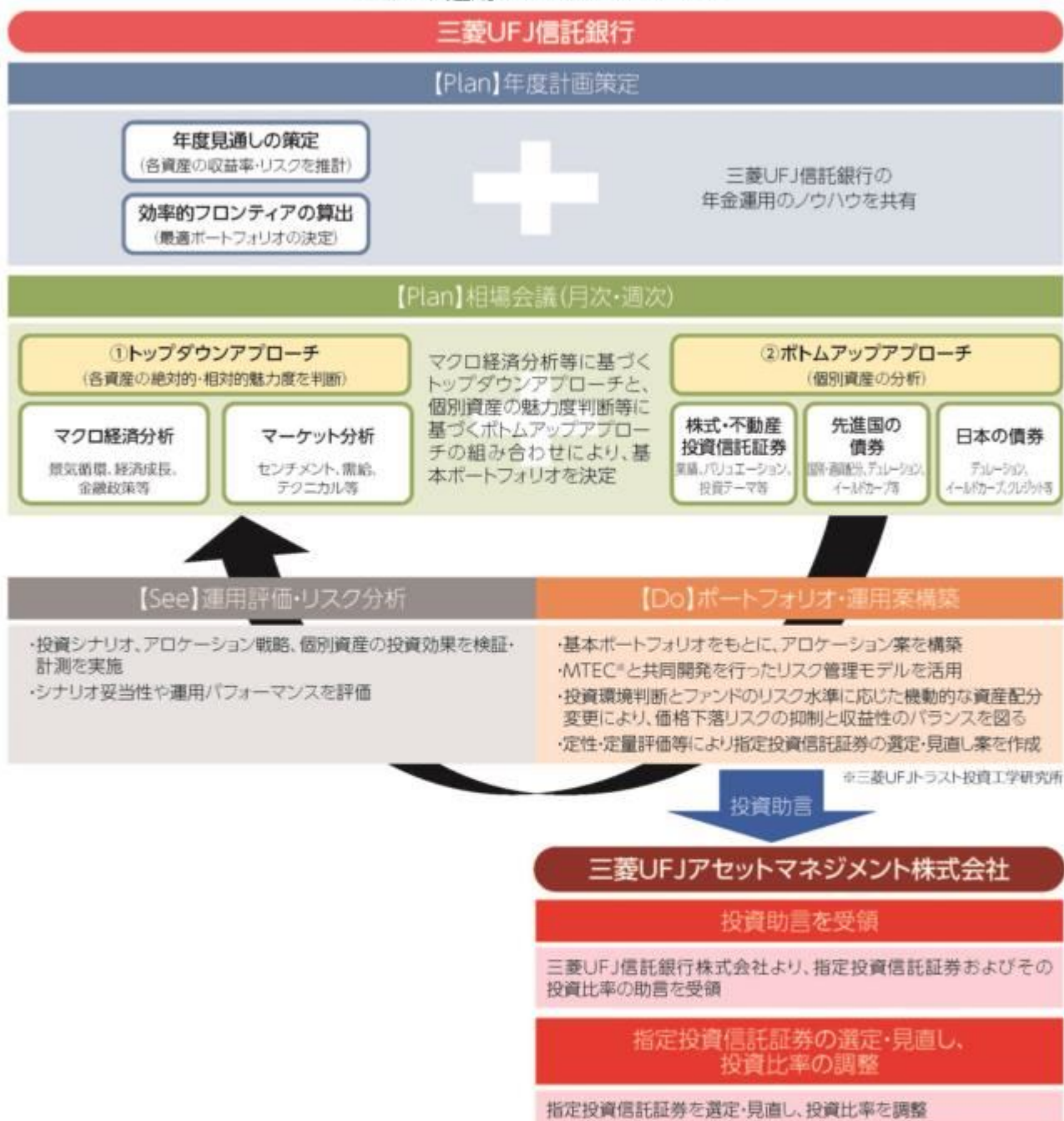
■運用方法・運用プロセス

＜指定投資信託証券への投資を通じた資産配分変更のイメージ＞



❗ 上図はファンドの資産配分の変更をご理解いただくためにイメージとして示したもので、実際とは異なる場合があります。

＜ファンド運用プロセスのイメージ＞



- ❗ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- ❗ 投資助言者、投資助言・情報提供の内容、投資助言・情報提供の有無等については、変更する場合があります。

特色3

実質組入外貨建資産について為替ヘッジを行う場合があります。

- 投資対象とする投資信託証券によっては、組入外貨建資産について為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図っている場合があります。
- ただし、為替ヘッジにより、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。
- 為替ヘッジを行わない場合は、為替相場の変動による影響を受けます。

① 為替ヘッジ(為替取引)を行うにあたっては、対象通貨間の金利差に基づくヘッジコスト(為替取引によるコスト)がかかります。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコスト(為替取引によるコスト)となる場合があります。

特色4

年1回の決算時(6月25日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。

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

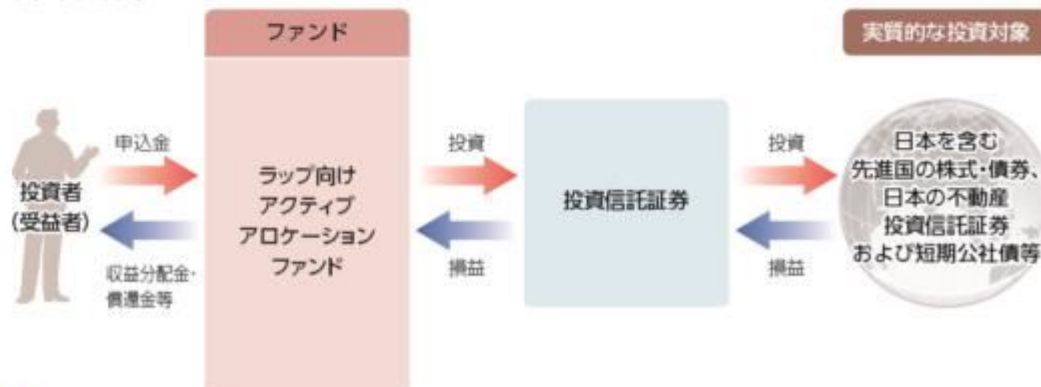
分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ファンドの仕組み

ファンド・オブ・ファンズ方式により運用を行います。

ファンド・オブ・ファンズ方式とは、株式や債券などに直接投資するのではなく、複数の他の投資信託証券に投資するしくみです。



① 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱ＵＦＪ信託銀行の投資助言に基づき決定します。

■主な投資制限

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



指数について

- ・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)(以下「TOPIX」といいます。)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に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。
- ・NOMURA-BPI国債 超長期(11-)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日本国が発行した固定利付債(個人向けは対象外)の残存期間11年以上の債券のパフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI国債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。
- ・NOMURA-BPI総合とは、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。
- ・NOMURA-BPI短期インデックスとは、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残存期間1年から3年の債券で構成されている債券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。
- ・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指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証REIT指数に係る標章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、円ヘッジ・円ベース)および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。当ファンドは、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数は、MSCI Inc.が独占的に所有しています。MSCI Inc.およびMSCI指数は、MSCI Inc.およびその関係会社のサービスマークであり、委託会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしているMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCI Inc.とその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指数は、当ファンドまたは当ファンドの委託会社あるいは受益者に関わらず、MSCI Inc.により決定、作成、および計算されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数の決定、作成、あるいは計算において、当ファンドの委託会社または受益者の要求を考慮に入れる義務は一切ありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの募集等に関する事項の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定または計算について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。MSCI Inc.は、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数またはそれに含まれるいかなるデータの独断性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的にも黙示的にも、被許諾者、その顧客または相手方、当ファンドの委託会社、当ファンドの受益者その他の個人・法人が、契約にもとづき許諾される権利またはその他使用のために許諾される権利に関連してMSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行うものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数およびそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。MSCI指数およびそれに含まれるデータに関し、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、特定目的のための市場性または適切性について、何ら保証を行うものではないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大損害その他のあらゆる損害(逸失利益を含む。)につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。当ファンドの購入者、販売者、または受益者あるいはいかなる個人・法人は、MSCI Inc.の許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCI Inc.に問い合わせることなく、当ファンドを保証、推奨、売買、または宣伝するためにいかなるMSCI Inc.のトレードネーム、トレードマーク、またはサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCI Inc.の書面による許諾を得ることなくMSCI Inc.との関係を一切主張することはできません。
- ・FTSE世界国債インデックス(除く日本)およびFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE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)・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、本ファンドのレスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2)【ファンドの沿革】

2022年1月27日

設定日、信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割

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

委託会社と関係法人との契約の概要

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

委託会社の概況（2024年6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
2023年10月	エム・ユー投資顧問株式会社の有価証券運用事業を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社へ統合し、商号を三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社に更改

・大株主の状況

株 主 名	住 所	所有株式数	所有比率
株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	211,581株	100.0%

2【投資方針】

（１）【投資方針】

投資信託証券を主要投資対象とします。

投資信託証券への投資を通じて、主としてわが国を含む先進国の株式、債券、わが国の不動産投資信託証券および短期公社債等に投資を行います。

投資対象とする投資信託証券（以下「指定投資信託証券」といいます。）については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、指定投資信託証券として指定されていた投資信託証券を指定から外したり、新たに投資信託証券（この投資信託の設定以降に設定された投資信託証券も含みます。）を指定投資信託証券として指定する場合があります。

投資にあたっては、マクロ経済分析等に基づくトップダウンアプローチ、個別資産の魅力度判断等に基づくボトムアップアプローチにより基本ポートフォリオを決定するとともに、投資環境判断、ファンドのリスク水準等を考慮して機動的に資産配分の変更を行うことで、価格下落リスクの抑制を図りながら安定した収益の獲得をめざします。

投資信託証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

指定投資信託証券は、三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社の助言に基づき、投資先ファンド間の相関や流動性、投資実績等を総合的に勘案して選定しました。

実質組入外貨建資産については、為替ヘッジを行う場合があります。

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。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- イ．有価証券
- ロ．約束手形
- ハ．金銭債権

- 2．次に掲げる特定資産以外の資産

- イ．為替手形

有価証券の指図範囲

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

- 1．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
- 2．コマーシャル・ペーパー
- 3．外国または外国の者の発行する証券または証書で、2．の証券の性質を有するもの
- 4．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

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

その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

< 投資信託証券の概要 >

■投資対象とする投資信託証券の概要(2024年6月末現在)

TOPIXマザーファンド	
形態	証券投資信託
ベンチマーク (対象インデックス)	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
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。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	東京証券取引所に上場されている株式
主な投資制限	・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引を行うことができます。 ・デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
信託期間	無期限(2001年3月26日設定)
決算日	原則として毎年3月25日
収益分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ	
形態	証券投資信託
ベンチマーク (対象インデックス)	NOMURA-BPI国債 超長期(11-)
投資態度	・主としてわが国の国債に投資を行います。 ・国債の組入比率は高位を維持することを基本とします。 ・対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し債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。
主な投資対象	わが国の国債
主な投資制限	・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
信託期間	無期限(2020年12月28日設定)
決算日	原則として毎年5月12日
収益分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

国内債券インデックスマザーファンド	
形態	証券投資信託
ベンチマーク (対象インデックス)	NOMURA-BPI総合
投資態度	・主としてわが国の公社債に投資を行います。 ・公社債の組入比率は高位を維持することを基本とします。 ・対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の公社債
主な投資制限	・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
信託期間	無期限(2020年3月2日設定)
決算日	原則として毎年5月12日
収益分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

日本短期債券マザーファンド	
形態	証券投資信託
ベンチマーク (対象インデックス)	NOMURA-BPI短期インデックス
投資態度	・ポートフォリオのデュレーション調整と銘柄選択による収益獲得をめざして運用を行います。 ・ポートフォリオのデュレーションはベンチマークの平均を中心に調整します。 ・デュレーション調整は主としてファンダメンタルズ分析に基づく中期的な金利見通しに沿って行います。 ・銘柄選択は信用リスクと金利スプレッドを定量的・定性的に分析して行います。 ・NOMURA-BPI短期インデックスをベンチマークとし、同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の公社債・金融商品
主な投資制限	・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
信託期間	無期限(1998年12月2日設定)
決算日	原則として毎年7月22日
収益分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

東証REIT指数マザーファンド	
形態	証券投資信託
ベンチマーク (対象インデックス)	東証REIT指数(配当込み)
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。
主な投資対象	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。)
主な投資制限	・株式への投資は行いません。 ・投資信託証券への投資割合に制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行いません。 ・不動産投信指数先物取引を行うことができます。 ・デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	解約日の基準価額の0.1%
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
信託期間	無期限(2009年10月28日設定)
決算日	原則として毎年1月26日
収益分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	
形態	証券投資信託
ベンチマーク (対象インデックス)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ヘッジ・円ベース)
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、以下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、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、為替ヘッジ比率を引き下げる、あるいは為替ヘッジ比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ヘッジ・円ベース)に採用されている株式
主な投資制限	・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引を行うことができます。 ・外国為替予約取引を行うことができます。 ・デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ・外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
信託期間	無期限(2007年6月21日設定)
決算日	原則として毎年5月12日
収益分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

外国株式インデックスマザーファンド	
形態	証券投資信託
ベンチマーク (対象インデックス)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)
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。
主な投資対象	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
主な投資制限	・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引を行うことができます。 ・外国為替予約取引を行うことができます。 ・デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ・外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	解約日の基準価額の0.1%
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
信託期間	無期限(2001年12月5日設定)
決算日	原則として毎年5月12日
収益分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

外国債券インデックスマザーファンド	
形態	証券投資信託
ベンチマーク (対象インデックス)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)
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、以下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。
主な投資対象	FTSE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
主な投資制限	・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引を行うことができます。 ・外国為替予約取引を行うことができます。 ・デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ・外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	解約日の基準価額の0.07%
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
信託期間	無期限(2001年12月18日設定)
決算日	原則として毎年5月12日
収益分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

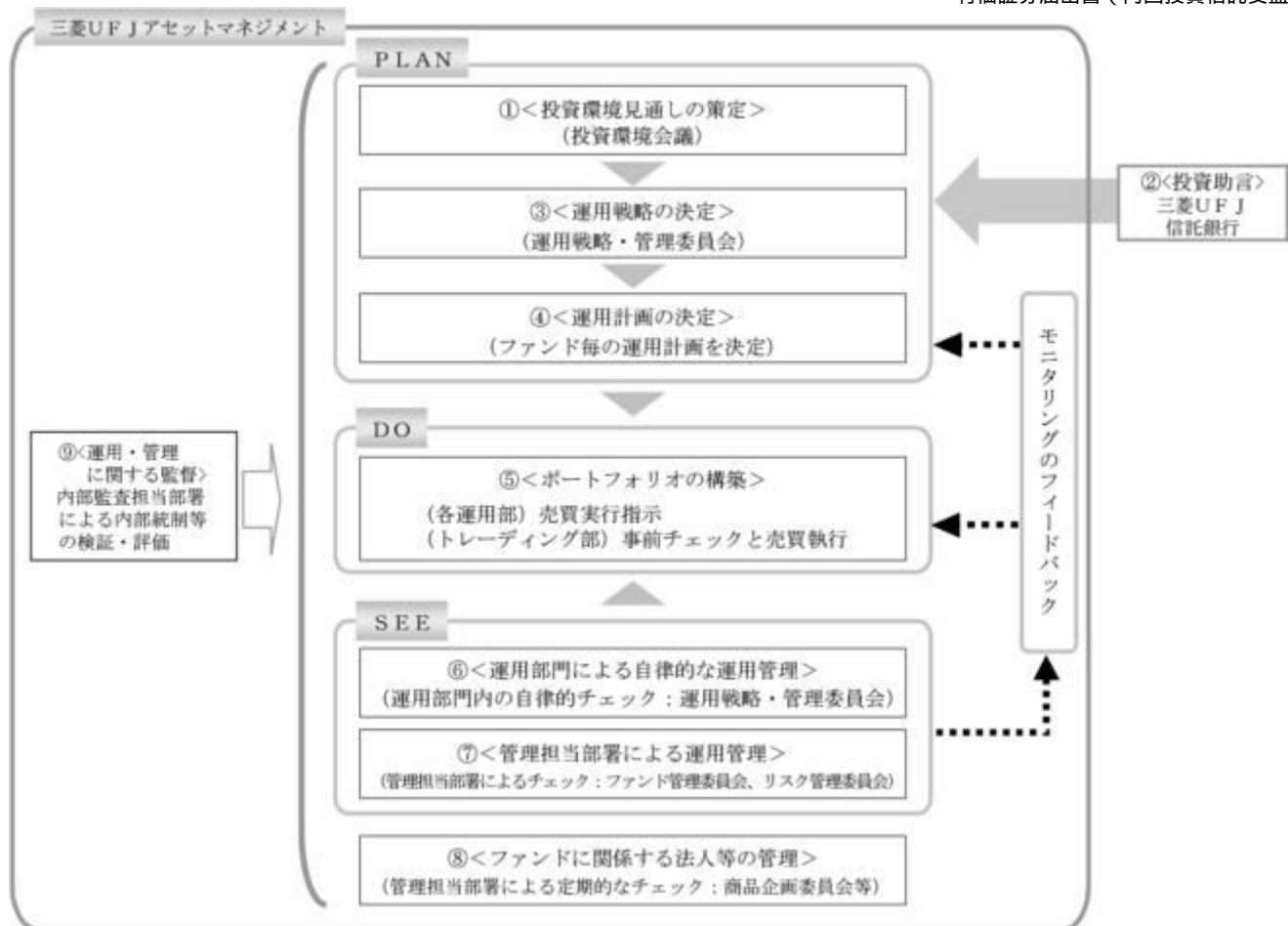
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	
形態	証券投資信託
ベンチマーク (対象インデックス)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)
投資態度	・日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。 ・対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の投資比率が100%を超える場合があります。 ・組入外貨建資産については、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、為替ヘッジ比率を引き下げる、あるいは為替ヘッジ比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	日本を除く世界各国の公社債
主な投資制限	・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・金利先渡し取引および為替先渡し取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・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減じる目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
信託期間	無期限(2009年8月28日設定)
決算日	原則として毎年1月26日
収益分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

先進国高格付国債マザーファンドⅡ	
形態	証券投資信託
ベンチマーク (対象インデックス)	—
投資態度	・主として日本を含む先進国の国債等に投資を行います。 ・投資する国債等(日本国債を除きます。)は、原則として取得時においてAAマイナス格相当以上の格付けを取得しているものに限りします。 ・銘柄選定にあたっては、最終利回り、イールドカーブおよび為替ヘッジコスト等を勘案して決定します。 ・組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。 ・債券等(為替ヘッジのために行う外国為替予約取引等を含みます。)の運用にあたっては、三菱UFJアセット・マネジメント(UK)に運用の指図に関する権限を委託します。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	日本を含む先進国の国債等
主な投資制限	・株式への投資は行いません。 ・外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ・有価証券先物取引等は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社 (運用指図権限の委託先:三菱UFJアセット・マネジメント(UK))
信託期間	無期限(2019年9月11日設定)
決算日	原則として毎年9月6日
収益分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

1 当該投資信託証券には、上記費用のほか、当ファンドに係る運用管理費用のうち委託会社の取り分から運用指図権限の委託先に支払われる報酬があります。詳細については、後掲「ファンドの費用」をご参照ください。

新マネー・マーケット・マザーファンド	
形態	証券投資信託
ベンチマーク (対象インデックス)	－
投資態度	・主としてわが国の短期公社債等に投資を行います。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の公社債等
主な投資制限	・株式への投資は行いません。 ・外貨建資産への投資は行いません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・金利先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
信託期間	無期限(2016年10月7日設定)
決算日	原則として毎年3・9月の各25日
収益分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

(3) 【運用体制】



投資環境見通しの策定

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

投資助言

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

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。

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。

ファンドに関係する法人等の管理

助言元、受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、その業務に関する委託会社

の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、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。

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.mufig.jp/investment_policy/fm.html

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

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

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

（５）【投資制限】

< 信託約款に定められた投資制限 >

株式

株式への直接投資は行いません。

投資信託証券

投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

信用取引

信用取引の指図は行いません。

外国為替予約取引

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

公社債の借入れ

a．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

b．a．の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

c．信託財産の一部解約等の事由により、b．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

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。

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。

信用リスクの分散規制

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

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

（主なりスクであり、以下に限定されるものではありません。）

**価格変動
リスク**

主要投資対象とする投資信託証券への投資を通じて、実質的に組み入れる有価証券等の価格変動の影響を受けます。

- ・株式の価格は、株式市場全体の動向のほか、発行企業の業績や業績に対する市場の見通しなどの影響を受けて変動します。組入株式の価格の下落は、基準価額の下落要因となります。
- ・債券の価格は、市場金利の変動の影響を受けて変動します。一般に市場金利が上がると、債券の価格は下落し、組入債券の価格の下落は基準価額の下落要因となります。市場金利の変動による債券価格の変動は、一般にその債券の残存期間が長いほど大きくなる傾向があります。
- ・リート（REIT）の価格は、リート市場全体の動向のほか、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します。また、金利上昇時にはリートの配当（分配金）利回りの相対的な魅力が弱まるため、リートの価格が下落することがあります。組入リート（REIT）の価格下落は、基準価額の下落要因となります。

**為替変動
リスク**

投資対象とする投資信託証券によっては、組入外貨建資産について為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図っている場合があります。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨建の金利より低いときには、これらの金利差相当分がヘッジコストとなります。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。

また、為替ヘッジを行わない場合は、為替変動の影響を受けます。

信用リスク

有価証券等の発行企業の経営、財務状況が悪化したり、市場においてその懸念が高まった場合には、有価証券等の価格が下落（債券の場合は利回りが上昇）すること、配当金が減額あるいは支払いが停止、または利払いや償還金の支払いが滞ること、倒産等によりその価値がなくなること等があります。

**流動性
リスク**

有価証券等を売買しようとする際に、その有価証券等の取引量が十分でない場合や規制等により取引が制限されている場合には、売買が成立しなかったり、十分な数量の売買が出来なかったり、ファンドの売買自体によって市場価格が動き、結果として不利な価格での取引となる場合があります。

留意事項

- ・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。
- ・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、換金の申込みの受け付け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。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・投資環境によっては、マイナス利回りの公社債や金融商品等での運用となることがあり、この場合、基準価額の下落要因となりますのでご注意ください。
- ・投資対象国における社会情勢の混乱や資産凍結を含む重大な規制の導入等による影響を受けることにより、価格変動・為替変動・信用・流動性のリスクが大きくなる可能性があります。

（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検討しています。

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。

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。

リスク管理担当部署

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

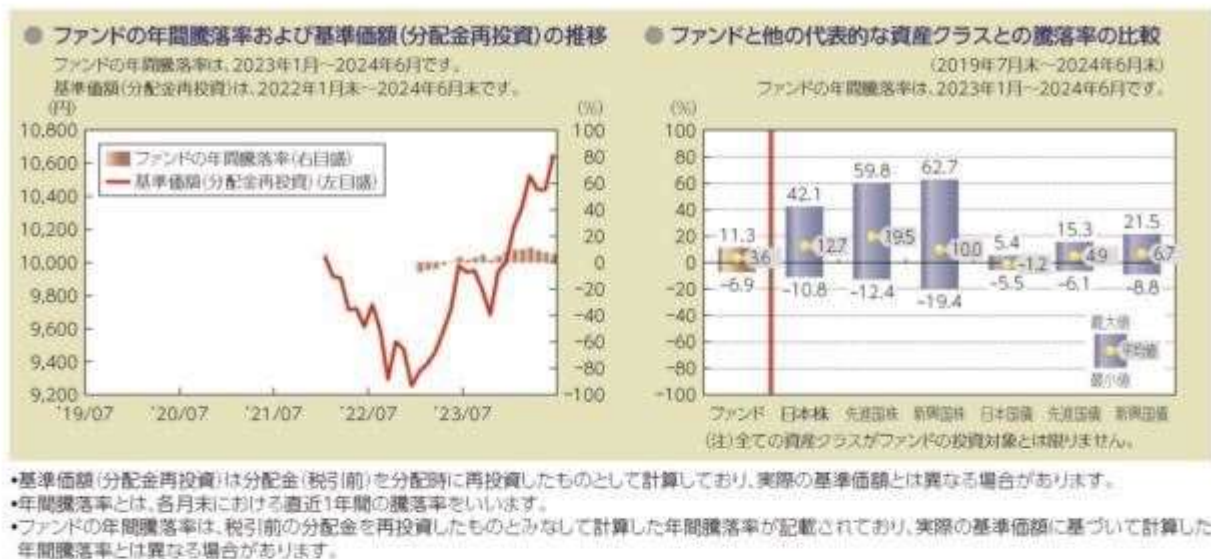
内部監査担当部署

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

* 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。



上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標準又は商標は、株式会社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。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPI(国債)とは、野村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 (除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当該指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

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

（２）【換金（解約）手数料】

かかりません。

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

（３）【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年0.22%（税抜0.20%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

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

上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

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

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.16%	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等
販売会社	0.01%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	0.03%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

- ・先進国高格付国債マザーファンドの運用指図権限の委託先への報酬
委託会社が受ける報酬から、当該マザーファンドのファンド組入額の年率0.075%以内が支払われます。

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

上場投資信託（リート）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おりません。

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

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。

法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

個別元本について

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

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

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

収益分配金について

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

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

上記は2024年6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。

(参考情報)ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間(以下「当期間」といいます。)(2023年6月27日～2024年6月25日)における当ファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
0.23%	0.22%	0.01%

(比率は年率、表示桁数未満四捨五入)

※当期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。消費税等のかかるものは消費税等を含む。)を当期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除しています。

詳細につきましては、当期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

【ラップ向けアクティブアロケーションファンド】

(1)【投資状況】

2024年 6月28日現在
(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	372,685,215	93.09
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	27,680,213	6.91
純資産総額		400,365,428	100.00

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

2024年 6月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	95,700,637	1.1069	105,931,035	1.1036	105,615,222	26.38
日本	親投資信託受益証券	T O P I X マザーファンド	19,990,890	3.4190	68,350,851	3.4503	68,974,567	17.23
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	9,016,804	7.4575	67,242,816	7.5476	68,055,229	17.00
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	18,446,912	2.7923	51,510,875	2.8055	51,752,811	12.93
日本	親投資信託受益証券	日本短期債券マザーファンド	41,473,584	1.1219	46,529,213	1.1212	46,500,182	11.61
日本	親投資信託受益証券	東証 R E I T 指数マザーファンド	5,734,947	3.4785	19,949,584	3.4371	19,711,586	4.92
日本	親投資信託受益証券	新マナー・マーケット・マザーファンド	12,206,225	0.9893	12,075,619	0.9893	12,075,618	3.02

(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

2024年 6月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	93.09
合計	93.09

（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】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および2024年6月末日、同日前１年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額		基準価額 （１万口当たりの純資産価額）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末日（2022年 6月27日）	62,786,950	62,786,950	9,607	9,607
第2計算期間末日（2023年 6月26日）	232,155,851	232,155,851	9,941	9,941
第3計算期間末日（2024年 6月25日）	399,244,086	399,244,086	10,618	10,618
2023年 6月末日	234,872,806	—	9,982	—
7月末日	230,346,743	—	9,942	—
8月末日	250,681,921	—	9,951	—
9月末日	258,079,622	—	9,834	—
10月末日	287,530,483	—	9,686	—
11月末日	315,594,795	—	9,945	—
12月末日	333,945,971	—	10,002	—
2024年 1月末日	357,457,988	—	10,214	—
2月末日	370,756,368	—	10,329	—
3月末日	380,895,537	—	10,524	—
4月末日	379,312,284	—	10,440	—
5月末日	388,355,169	—	10,441	—
6月末日	400,365,428	—	10,647	—

【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

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	3.93

第2計算期間	3.47
第3計算期間	6.81

（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	65,355,671	—	65,355,671
第2計算期間	182,223,164	14,054,751	233,524,084
第3計算期間	172,633,216	30,134,693	376,022,607

（参考）

ＴＯＰＩＸマザーファンド

投資状況

2024年 6月28日現在
（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	日本	1,548,361,239,540	99.45
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	8,589,046,672	0.55
純資産総額		1,556,950,286,212	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

2024年 6月28日現在
（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	13,546,610,000	0.87

（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

2024年 6月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	20,848,300	3,801.24	79,249,391,892	3,290.00	68,590,907,000	4.41
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	23,522,700	1,579.02	37,142,865,683	1,729.00	40,670,748,300	2.61
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2,746,500	13,042.69	35,821,748,779	13,640.00	37,462,260,000	2.41
日本	株式	日立製作所	電気機器	9,518,600	2,786.05	26,519,368,993	3,601.00	34,276,478,600	2.20
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2,704,900	8,990.61	24,318,701,408	10,725.00	29,010,052,500	1.86
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	830,000	38,585.86	32,026,271,417	34,900.00	28,967,000,000	1.86
日本	株式	キーエンス	電気機器	392,400	70,267.78	27,573,077,040	70,550.00	27,683,820,000	1.78

日本	株式	三菱商事	卸売業	7,967,600	3,532.51	28,145,654,586	3,148.00	25,082,004,800	1.61
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	2,903,600	6,573.03	19,085,473,148	8,607.00	24,991,285,200	1.61
日本	株式	三井物産	卸売業	6,215,900	3,574.62	22,219,526,909	3,651.00	22,694,250,900	1.46
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	3,771,200	4,720.94	17,803,628,902	6,005.00	22,646,056,000	1.45
日本	株式	信越化学工業	化学	3,522,800	6,700.91	23,605,994,018	6,238.00	21,975,226,400	1.41
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	2,789,300	6,593.67	18,391,740,890	7,854.00	21,907,162,200	1.41
日本	株式	任天堂	その他製品	2,476,000	8,281.50	20,505,004,049	8,556.00	21,184,656,000	1.36
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,940,300	9,147.47	17,748,849,178	10,390.00	20,159,717,000	1.29
日本	株式	第一三共	医薬品	3,426,600	4,852.70	16,628,267,624	5,524.00	18,928,538,400	1.22
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	117,000,100	181.34	21,217,441,257	151.80	17,760,615,180	1.14
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	5,213,700	3,046.20	15,882,007,362	3,358.00	17,507,604,600	1.12
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	9,292,300	1,870.22	17,378,714,609	1,720.00	15,982,756,000	1.03
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	3,481,100	4,343.72	15,120,934,459	4,172.00	14,523,149,200	0.93
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	772,100	19,007.88	14,675,985,063	18,705.00	14,442,130,500	0.93
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	6,282,200	2,017.08	12,671,730,796	1,964.50	12,341,381,900	0.79
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	2,893,100	4,501.38	13,022,942,478	4,254.00	12,307,247,400	0.79
日本	株式	三菱重工業	機械	6,926,900	1,364.20	9,449,703,833	1,723.00	11,935,048,700	0.77
日本	株式	ディスコ	機械	190,700	54,663.49	10,424,328,125	61,040.00	11,640,328,000	0.75
日本	株式	村田製作所	電気機器	3,503,300	2,858.52	10,014,253,116	3,322.00	11,637,962,600	0.75
日本	株式	三菱電機	電気機器	4,338,900	2,549.42	11,061,678,438	2,567.50	11,140,125,750	0.72
日本	株式	ダイキン工業	機械	472,900	20,542.72	9,714,652,745	22,370.00	10,578,773,000	0.68
日本	株式	丸紅	卸売業	3,441,800	2,677.60	9,215,788,675	2,975.50	10,241,075,900	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	2,346,500	3,999.23	9,384,214,317	4,348.00	10,202,582,000	0.66

（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

2024年 6月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.34
	建設業	2.00
	食料品	3.04
	繊維製品	0.36
	パルプ・紙	0.14
	化学	5.59
	医薬品	4.34
	石油・石炭製品	0.55
	ゴム製品	0.64
	ガラス・土石製品	0.66
	鉄鋼	0.87
	非鉄金属	0.76
	金属製品	0.51
	機械	5.69

電気機器	17.69
輸送用機器	8.28
精密機器	2.21
その他製品	2.43
電気・ガス業	1.45
陸運業	2.22
海運業	0.73
空運業	0.36
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	7.01
卸売業	7.57
小売業	3.97
銀行業	8.12
証券、商品先物取引業	0.93
保険業	3.21
その他金融業	1.18
不動産業	1.90
サービス業	4.51
小計	99.45
合計	99.45

（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

2024年 6月28日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ ２４年０９月限	買建	482	円	13,363,884,100	13,546,610,000	0.87

（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。

日本短期債券マザーファンド

投資状況

2024年 6月28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	6,130,133,900	46.11
特殊債券	日本	596,865,000	4.49
社債券	日本	6,474,285,000	48.69
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	94,472,837	0.71
純資産総額		13,295,756,737	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 3 0 銘柄

2024年 6月28日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第 4 6 0 回利付国債（ 2 年）	4,800,000,000	99.91	4,796,037,700	99.97	4,798,656,000	0.300000	2026/5/1	36.09
日本	国債証券	第 4 6 1 回利付国債（ 2 年）	1,300,000,000	99.99	1,299,922,000	100.13	1,301,729,000	0.400000	2026/6/1	9.79
日本	特殊債券	第 2 9 2 号商工債券（ 3 年）	300,000,000	99.94	299,823,000	99.94	299,829,000	0.620000	2027/5/27	2.26
日本	社債券	第 3 9 回ソニーグループ	300,000,000	99.44	298,335,000	99.39	298,182,000	0.350000	2027/3/5	2.24
日本	特殊債券	第 3 8 0 回信金中金債	300,000,000	99.23	297,714,000	99.01	297,036,000	0.030000	2026/7/27	2.23
日本	社債券	第 1 2 回ロイズ・バンキング・グループ期限前償還条項付	200,000,000	100.00	200,000,000	100.69	201,380,000	1.377000	2027/12/1	1.51
日本	社債券	第 3 1 回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	200,000,000	100.00	200,000,000	100.24	200,480,000	0.668000	2027/6/18	1.51
日本	社債券	第 2 4 回ルノー	200,000,000	100.54	201,089,000	100.01	200,038,000	1.540000	2024/7/5	1.50
日本	社債券	第 2 5 回ソフトバンク	200,000,000	100.00	200,000,000	99.92	199,842,000	0.828000	2027/5/27	1.50
日本	社債券	第 1 回サントナル銀行（ 2 0 1 9 ）	200,000,000	99.88	199,774,000	99.91	199,822,000	0.463000	2024/12/5	1.50
日本	社債券	第 1 5 回クレディ・アグリコル・エス・エー（ 2 0 2 4 ）	200,000,000	100.00	200,000,000	99.79	199,590,000	1.114000	2028/1/26	1.50
日本	社債券	第 1 4 回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	200,000,000	99.90	199,804,000	99.72	199,440,000	0.574000	2027/4/19	1.50
日本	社債券	第 2 2 回大和ハウス工業（グリーン）	200,000,000	99.69	199,384,000	99.64	199,286,000	0.130000	2025/9/12	1.50
日本	社債券	第 1 6 回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	200,000,000	99.88	199,776,000	99.47	198,942,000	0.180000	2025/12/19	1.50
日本	社債券	第 2 1 回積水ハウス	200,000,000	99.34	198,694,000	99.13	198,276,000	0.200000	2026/7/17	1.49
日本	社債券	第 1 0 3 回トヨタファイナンス	200,000,000	100.00	200,000,000	99.13	198,268,000	0.617000	2029/4/11	1.49
日本	社債券	第 3 9 回芙蓉総合リース	200,000,000	100.00	200,000,000	99.07	198,140,000	0.350000	2027/2/26	1.49
日本	社債券	第 1 7 回イオンフィナンシャルサービス	200,000,000	99.18	198,364,000	98.94	197,884,000	0.340000	2026/7/31	1.49
日本	社債券	第 2 7 回野村ホールディングス	100,000,000	103.46	103,466,000	101.62	101,629,000	2.107000	2025/9/24	0.76
日本	社債券	第 1 2 回セブン＆アイ・ホールディングス	100,000,000	100.90	100,904,000	100.38	100,385,000	0.781000	2025/6/20	0.76
日本	社債券	第 6 3 回神戸製鋼所	100,000,000	100.80	100,804,000	100.33	100,337,000	0.924000	2025/5/21	0.75
日本	社債券	第 3 2 回三菱ＵＦＪリース	100,000,000	100.61	100,617,000	100.13	100,131,000	0.695000	2024/10/25	0.75
日本	社債券	第 5 7 回日立キャピタル	100,000,000	100.48	100,481,000	100.12	100,124,000	0.616000	2024/12/20	0.75

日本	社債券	第１８回大和証券グループ本社	100,000,000	100.52	100,525,000	100.08	100,085,000	0.871000	2024/8/28	0.75
日本	社債券	第１４回森ビル	100,000,000	100.53	100,535,000	100.06	100,064,000	0.861000	2024/8/14	0.75
日本	社債券	第２５回ＳＢＩホールディングス	100,000,000	100.04	100,040,000	99.99	99,995,000	0.600000	2024/7/26	0.75
日本	社債券	第２９回ＳＢＩホールディングス	100,000,000	100.14	100,140,000	99.95	99,957,000	1.000000	2025/7/22	0.75
日本	社債券	第４３回ＩＨＩ	100,000,000	99.82	99,821,000	99.94	99,941,000	0.200000	2024/10/17	0.75
日本	社債券	第７５回三菱ＵＦＪリース	100,000,000	100.06	100,063,000	99.90	99,904,000	0.220000	2025/1/23	0.75
日本	社債券	第７９回アコム	100,000,000	99.94	99,948,000	99.87	99,878,000	0.290000	2025/2/28	0.75

（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

2024年 6月28日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	46.11
特殊債券	4.49
社債券	48.69
合計	99.29

（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

2024年 6月28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	115,634,943,800	98.47
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	1,793,342,104	1.53
純資産総額		117,428,285,904	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

2024年 6月28日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国 / 地域	時価合計	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引	買建	日本	1,922,082,000	1.64

（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

2024年 6月28日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	13,654	591,679.21	8,078,787,982	563,000	7,687,202,000	6.55
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	12,022	559,357.7	6,724,598,355	508,000	6,107,176,000	5.20
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	37,848	158,381.63	5,994,428,143	142,700	5,400,909,600	4.60
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	33,165	159,733.98	5,297,577,547	156,500	5,190,322,500	4.42
日本	投資証券	GLP投資法人	39,313	131,304.02	5,161,954,991	131,300	5,161,796,900	4.40
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	20,389	267,336.48	5,450,723,640	251,000	5,117,639,000	4.36
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	56,100	98,604.77	5,531,727,607	90,500	5,077,050,000	4.32
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	17,642	253,655.84	4,474,996,372	245,800	4,336,403,600	3.69
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	11,483	328,944.98	3,777,275,306	327,500	3,760,682,500	3.20
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	26,181	149,805.02	3,922,045,315	142,900	3,741,264,900	3.19
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	23,320	168,933.83	3,939,537,079	159,200	3,712,544,000	3.16
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	56,668	61,736.34	3,498,475,463	65,200	3,694,753,600	3.15
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	40,445	76,137.79	3,079,393,252	77,700	3,142,576,500	2.68
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	35,170	78,365.1	2,756,100,911	79,100	2,781,947,000	2.37
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	21,318	134,623.46	2,869,902,933	126,600	2,698,858,800	2.30
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	8,004	350,039.54	2,801,716,495	324,000	2,593,296,000	2.21
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,041	609,841.73	2,464,370,431	639,000	2,582,199,000	2.20
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	14,961	149,879.68	2,242,350,017	147,600	2,208,243,600	1.88
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,023	404,377.14	2,435,563,558	365,000	2,198,395,000	1.87
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	4,868	458,089.83	2,229,981,330	433,500	2,110,278,000	1.80
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,471	280,215.34	2,093,488,834	266,000	1,987,286,000	1.69
日本	投資証券	イオンリート投資法人	14,357	140,801.49	2,021,487,109	133,200	1,912,352,400	1.63
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,343	431,566.84	1,874,294,820	439,500	1,908,748,500	1.63
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,755	314,896.71	1,812,230,590	318,000	1,830,090,000	1.56
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	13,763	138,859.01	1,911,116,668	131,600	1,811,210,800	1.54
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	17,235	106,079.14	1,828,274,110	105,000	1,809,675,000	1.54
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	10,950	154,977.2	1,697,000,412	146,000	1,598,700,000	1.36
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	22,560	73,957.36	1,668,478,133	69,400	1,565,664,000	1.33
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	4,041	376,218.05	1,520,297,153	381,000	1,539,621,000	1.31
日本	投資証券	NTT都市開発リート投資法人	11,866	125,025.78	1,483,556,022	116,300	1,380,015,800	1.18

（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

2024年 6月28日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	98.47
合計	98.47

（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

2024年 6月28日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証ＲＥＩＴ ２４年０９月限	買建	1,126	円	1,914,767,250	1,922,082,000	1.64

（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

2024年 6月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	アメリカ	4,511,757,966,531	73.42
	イギリス	234,362,393,789	3.81
	カナダ	184,979,815,526	3.01
	フランス	164,134,354,333	2.67
	スイス	155,629,600,403	2.53
	ドイツ	135,856,101,618	2.21
	オーストラリア	110,820,935,904	1.80
	オランダ	105,442,729,661	1.72
	デンマーク	62,938,306,321	1.02
	スウェーデン	50,816,212,884	0.83
	スペイン	40,698,450,046	0.66
	イタリア	32,245,471,692	0.52
	香港	26,081,505,939	0.42
	シンガポール	17,116,587,707	0.28
	フィンランド	15,789,096,046	0.26
	ベルギー	12,498,817,172	0.20
	ノルウェー	9,413,394,719	0.15
	アイルランド	5,528,987,967	0.09
	イスラエル	5,397,097,913	0.09
	オーストリア	2,974,487,168	0.05
	ルクセンブルク	2,871,249,708	0.05
	ニュージーランド	2,713,864,789	0.04
	ポルトガル	2,541,808,656	0.04
	バミューダ	851,256,100	0.01
	小計	5,893,460,492,592	95.91
投資証券	アメリカ	93,976,576,262	1.53
	オーストラリア	7,396,934,733	0.12
	フランス	1,966,178,386	0.03
	イギリス	1,763,701,262	0.03
	シンガポール	1,358,531,152	0.02

	香港	995,933,880	0.02
	ベルギー	432,453,188	0.01
	カナダ	302,575,605	0.00
	小計	108,192,884,468	1.76
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	143,417,864,022	2.33
純資産総額		6,145,071,241,082	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

2024年 6月28日現在
（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	109,919,853,771	1.79
	買建	カナダ	4,883,352,199	0.08
	買建	ドイツ	15,674,785,246	0.26
	買建	オーストラリア	3,959,157,825	0.06
	買建	イギリス	5,870,845,656	0.10
	買建	スイス	3,756,430,180	0.06

（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

2024年 6月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (％)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア・ サービス	4,201,504	66,881.71	281,003,800,661	72,940.54	306,460,010,486	4.99
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	8,728,915	29,615.40	258,510,373,041	34,485.08	301,017,393,191	4.90
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	14,876,050	14,731.04	219,139,769,367	19,971.06	297,090,625,460	4.83
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	5,571,070	30,134.22	167,879,901,161	31,867.69	177,537,184,653	2.89
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディ ア・娯楽	1,303,990	76,779.56	100,119,784,703	83,685.52	109,125,093,222	1.78
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディ ア・娯楽	3,507,171	27,200.56	95,397,020,966	29,863.98	104,738,115,113	1.70
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディ ア・娯楽	3,036,997	27,461.29	83,399,876,808	30,097.54	91,406,139,295	1.49
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	480,913	123,061.81	59,182,025,501	146,419.07	70,414,835,557	1.15

アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	262,023	215,615.24	56,496,152,492	255,563.32	66,963,469,421	1.09
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1,708,697	32,005.54	54,687,786,594	32,080.31	54,815,532,703	0.89
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1,706,316	27,210.24	46,429,272,602	31,798.43	54,258,185,923	0.88
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	780,398	66,347.81	51,777,700,837	65,708.50	51,278,787,056	0.83
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	2,669,118	18,959.96	50,606,382,323	18,506.94	49,397,214,686	0.80
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	1,943,076	20,476.56	39,787,521,833	23,160.06	45,001,756,745	0.73
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	548,652	82,517.90	45,273,614,265	78,350.89	42,987,372,939	0.70
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	940,343	45,156.40	42,462,511,616	42,939.65	40,378,000,522	0.66
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	237,870	149,298.85	35,513,718,523	165,436.80	39,352,451,616	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	1,399,438	26,870.28	37,603,302,054	26,837.48	37,557,394,094	0.61
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	264,499	127,118.42	33,622,695,367	137,009.36	36,238,839,610	0.59
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	495,140	73,530.62	36,407,954,462	71,313.74	35,310,286,461	0.57
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	1,432,762	24,122.53	34,561,850,055	23,484.00	33,646,991,405	0.55
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	590,039	55,745.59	32,892,072,267	55,003.79	32,454,383,785	0.53
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	1,506,810	20,935.91	31,546,445,655	20,910.10	31,507,558,931	0.51
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	2,634,480	9,783.53	25,774,524,640	10,933.43	28,803,906,882	0.47
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	1,054,544	25,913.05	27,326,458,196	27,219.21	28,703,864,397	0.47
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	257,760	98,562.82	25,405,552,487	110,226.64	28,412,019,706	0.46
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	4,228,403	6,200.14	26,216,727,179	6,321.99	26,731,953,195	0.44
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	1,044,372	26,656.12	27,838,911,493	25,178.46	26,295,681,134	0.43
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	1,591,107	17,050.46	27,129,107,899	16,499.50	26,252,485,539	0.43
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	2,445,044	10,191.34	24,918,296,489	10,293.98	25,169,243,082	0.41

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

2024年 6月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	エネルギー	4.33
	素材	3.53
	資本財	6.62
	商業・専門サービス	1.52
	運輸	1.54
	自動車・自動車部品	1.53
	耐久消費財・アパレル	1.31
	消費者サービス	1.84
	メディア・娯楽	6.69
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.87
	生活必需品流通・小売り	1.71
	食品・飲料・タバコ	3.01
	家庭用品・パーソナル用品	1.54
	ヘルスケア機器・サービス	3.92
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.78
	銀行	5.26
	金融サービス	6.26
	保険	2.88
	ソフトウェア・サービス	9.93
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.40
	電気通信サービス	1.07
	公益事業	2.47
	半導体・半導体製造装置	9.63
	不動産管理・開発	0.26
小計		95.91
投資証券	—	1.76
合計		97.67

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

投資不動産物件
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

2024年 6月28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（％）
	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2409	買建	2,461	アメリカドル	682,158,868.1	109,875,328,885	682,435,300	109,919,853,771	1.79

株価指数先物取引	カナダ	モンテリオール取引所	SP/TSE602409	買建	158	カナダドル	41,017,154.5	4,816,234,281	41,588,760	4,883,352,199	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 2409	買建	1,842	ユーロ	91,210,055.9	15,718,228,932	90,957,960	15,674,785,246	0.26
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2409	買建	191	オーストラリアドル	37,002,000.25	3,959,214,027	37,001,475	3,959,157,825	0.06
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2409	買建	351	イギリスポンド	28,940,893.75	5,888,893,060	28,852,200	5,870,845,656	0.10
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX2409	買建	174	スイスフラン	21,028,561.9	3,765,584,579	20,977,440	3,756,430,180	0.06

（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

2024年 6月28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	310,406,003,029	46.20
	中国	66,143,668,981	9.85
	フランス	49,964,329,292	7.44
	イタリア	46,803,119,882	6.97
	ドイツ	39,935,046,948	5.94
	イギリス	34,821,030,634	5.18
	スペイン	31,759,142,098	4.73
	カナダ	13,039,448,041	1.94
	ベルギー	11,476,961,058	1.71
	オランダ	9,860,263,723	1.47
	オーストラリア	8,401,406,759	1.25
	オーストリア	7,671,761,148	1.14
	メキシコ	5,054,217,493	0.75
	フィンランド	3,572,496,635	0.53
	ポーランド	3,471,554,963	0.52
	マレーシア	3,252,778,491	0.48
	アイルランド	3,248,117,330	0.48
	シンガポール	2,740,766,045	0.41
	イスラエル	2,032,353,888	0.30
	デンマーク	1,650,196,168	0.25
	ニュージーランド	1,565,414,720	0.23
	スウェーデン	1,063,951,893	0.16
	ノルウェー	981,701,502	0.15
	小計	658,915,730,721	98.08
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	12,899,327,247	1.92

純資産総額	671,815,057,968	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

2024年 6月28日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	4 T-NOTE 340215	25,750,000	15,469.52	3,983,403,356	15,738.30	4,052,612,449	4.000000	2034/2/15	0.60
アメリカ	国債証券	4.5 T-NOTE 331115	19,430,000	16,090.64	3,126,411,618	16,357.41	3,178,245,460	4.500000	2033/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	4.625 T-NOTE 260228	19,800,000	16,025.52	3,173,053,215	16,051.63	3,178,223,173	4.625000	2026/2/28	0.47
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 301115	22,310,000	12,860.43	2,869,162,559	13,074.98	2,917,028,717	0.875000	2030/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	3.875 T-NOTE 330815	18,320,000	15,335.31	2,809,428,984	15,591.07	2,856,284,511	3.875000	2033/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	2.375 T-NOTE 270515	18,570,000	15,090.04	2,802,221,248	15,178.95	2,818,732,856	2.375000	2027/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	3.5 T-NOTE 330215	17,690,000	14,937.66	2,642,473,731	15,182.42	2,685,770,188	3.500000	2033/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 311115	20,320,000	12,932.15	2,627,814,750	13,162.43	2,674,607,618	1.375000	2031/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 310815	19,990,000	12,906.36	2,579,981,940	13,129.40	2,624,568,487	1.250000	2031/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	4.125 T-NOTE 321115	16,070,000	15,672.86	2,518,629,579	15,920.44	2,558,416,031	4.125000	2032/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	3.375 T-NOTE 330515	16,800,000	14,761.60	2,479,949,480	15,018.20	2,523,058,352	3.375000	2033/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 320815	17,340,000	14,169.44	2,456,981,090	14,408.84	2,498,493,545	2.750000	2032/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 320515	17,030,000	14,350.33	2,443,861,251	14,586.58	2,484,095,817	2.875000	2032/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 310515	17,540,000	13,367.90	2,344,731,084	13,574.23	2,380,921,208	1.625000	2031/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 320215	16,860,000	13,359.68	2,252,443,200	13,589.65	2,291,215,345	1.875000	2032/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 310215	17,120,000	13,008.91	2,227,126,970	13,222.21	2,263,642,550	1.125000	2031/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300815	17,350,000	12,727.67	2,208,251,759	12,951.66	2,247,113,672	0.625000	2030/8/15	0.33
アメリカ	国債証券	3.125 T-NOTE 281115	14,380,000	15,183.63	2,183,406,149	15,317.37	2,202,639,165	3.125000	2028/11/15	0.33
アメリカ	国債証券	4.25 T-NOTE 251231	13,580,000	15,924.53	2,162,552,253	15,954.73	2,166,653,498	4.250000	2025/12/31	0.32
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 280831	14,930,000	13,966.65	2,085,222,212	14,131.06	2,109,767,439	1.125000	2028/8/31	0.31
アメリカ	国債証券	4.5 T-NOTE 270415	13,000,000	16,028.98	2,083,767,624	16,093.78	2,092,192,345	4.500000	2027/4/15	0.31
アメリカ	国債証券	4.25 T-BOND 540215	13,340,000	15,083.47	2,012,135,653	15,626.30	2,084,549,312	4.250000	2054/2/15	0.31
アメリカ	国債証券	0.75 T-NOTE 260331	13,590,000	14,922.56	2,027,977,151	15,020.09	2,041,230,512	0.750000	2026/3/31	0.30
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 270131	13,540,000	14,799.87	2,003,903,651	14,910.92	2,018,939,848	1.500000	2027/1/31	0.30
中国	国債証券	2.39 CHINA GOVT 261115	88,000,000	2,238.31	1,969,713,132	2,245.12	1,975,705,635	2.390000	2026/11/15	0.29
アメリカ	国債証券	4 T-NOTE 270115	12,300,000	15,818.20	1,945,639,397	15,880.49	1,953,300,923	4.000000	2027/1/15	0.29
アメリカ	国債証券	4.125 T-NOTE 310331	12,100,000	15,749.62	1,905,704,135	15,955.99	1,930,675,622	4.125000	2031/3/31	0.29

中国	国債証券	2.46 CHINA GOVT 260215	86,000,000	2,235.08	1,922,170,992	2,241.35	1,927,567,073	2.460000	2026/2/15	0.29
フランス	国債証券	2.5 O.A.T 300525	11,270,000	16,911.98	1,905,980,345	16,769.40	1,889,911,815	2.500000	2030/5/25	0.28
アメリカ	国債証券	4.25 T-NOTE 270315	11,800,000	15,921.76	1,878,768,801	15,987.14	1,886,482,662	4.250000	2027/3/15	0.28

（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

2024年 6月28日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.08
合計	98.08

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

2024年 6月28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	173,950,578,908	47.64
	中国	36,761,700,090	10.07
	フランス	27,896,320,140	7.64
	イタリア	25,763,699,672	7.06
	ドイツ	22,270,441,037	6.10
	イギリス	19,395,174,141	5.31
	スペイン	17,140,693,702	4.69
	カナダ	7,639,211,847	2.09
	ベルギー	6,245,527,223	1.71
	オランダ	5,470,110,676	1.50
	オーストラリア	4,725,613,505	1.29
	オーストリア	4,263,148,963	1.17
	メキシコ	3,004,145,210	0.82
	フィンランド	2,000,035,588	0.55
	ポーランド	1,922,216,656	0.53
	マレーシア	1,866,087,602	0.51
	アイルランド	1,838,944,678	0.50
	シンガポール	1,566,461,906	0.43
	イスラエル	1,045,105,895	0.29
	デンマーク	973,570,941	0.27
	ニュージーランド	825,999,600	0.23

	スウェーデン	624,318,562	0.17
	ノルウェー	607,262,428	0.17
	小計	367,796,368,970	100.73
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	2,662,358,130	0.73
純資産総額		365,134,010,840	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

2024年 6月28日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	4.5 T-NOTE 331115	12,080,000	16,563.67	2,000,892,415	16,357.41	1,975,975,562	4.500000	2033/11/15	0.54
アメリカ	国債証券	3.875 T-NOTE 330815	10,940,000	15,746.73	1,722,692,628	15,591.07	1,705,663,346	3.875000	2033/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	4.125 T-NOTE 321115	10,070,000	16,110.22	1,622,299,295	15,920.44	1,603,189,137	4.125000	2032/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 301115	12,020,000	13,083.85	1,572,679,523	13,074.98	1,571,612,961	0.875000	2030/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	3.375 T-NOTE 330515	10,150,000	15,161.82	1,538,925,293	15,018.20	1,524,347,756	3.375000	2033/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	3.5 T-NOTE 330215	9,990,000	15,350.86	1,533,551,808	15,182.42	1,516,723,807	3.500000	2033/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 311115	11,270,000	13,187.04	1,486,179,683	13,162.43	1,483,406,882	1.375000	2031/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 310815	11,260,000	13,159.92	1,481,807,255	13,129.40	1,478,371,244	1.250000	2031/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 310515	10,680,000	13,631.29	1,455,822,543	13,574.23	1,449,728,535	1.625000	2031/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 320515	9,900,000	14,709.27	1,456,218,461	14,586.58	1,444,072,143	2.875000	2032/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 320215	10,360,000	13,621.22	1,411,158,543	13,589.65	1,407,887,956	1.875000	2032/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	4 T-NOTE 340215	8,800,000	15,801.16	1,390,502,159	15,738.30	1,384,970,461	4.000000	2034/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 310215	10,300,000	13,283.55	1,368,206,280	13,222.21	1,361,887,750	1.125000	2031/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 320815	9,410,000	14,471.59	1,361,777,107	14,408.84	1,355,872,218	2.750000	2032/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300815	10,200,000	12,930.69	1,318,931,359	12,951.66	1,321,069,710	0.625000	2030/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	4.75 T-BOND 531115	6,920,000	17,105.72	1,183,716,100	16,962.68	1,173,817,759	4.750000	2053/11/15	0.32
アメリカ	国債証券	4.375 T-NOTE 260815	7,060,000	16,122.62	1,138,257,486	16,002.55	1,129,780,459	4.375000	2026/8/15	0.31
フランス	国債証券	2.5 O.A.T 300525	6,720,000	17,172.00	1,153,958,837	16,769.40	1,126,903,937	2.500000	2030/5/25	0.31
アメリカ	国債証券	1 T-NOTE 280731	7,780,000	14,082.21	1,095,596,618	14,088.90	1,096,116,895	1.000000	2028/7/31	0.30
アメリカ	国債証券	4.5 T-NOTE 270515	6,700,000	16,032.73	1,074,193,406	16,097.56	1,078,536,671	4.500000	2027/5/15	0.30
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 270131	7,200,000	14,925.08	1,074,606,183	14,910.92	1,073,586,919	1.500000	2027/1/31	0.29
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300515	8,200,000	13,044.46	1,069,646,361	13,057.99	1,070,755,602	0.625000	2030/5/15	0.29
アメリカ	国債証券	4.5 T-NOTE 270415	6,500,000	15,947.86	1,036,611,085	16,093.78	1,046,096,172	4.500000	2027/4/15	0.29
アメリカ	国債証券	3.75 T-NOTE 281231	6,610,000	15,861.70	1,048,459,024	15,721.62	1,039,199,571	3.750000	2028/12/31	0.28

アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280930	7,300,000	14,208.45	1,037,216,876	14,175.10	1,034,782,570	1.250000	2028/9/30	0.28
アメリカ	国債証券	4.25 T-NOTE 290228	6,340,000	16,053.96	1,017,821,270	16,062.95	1,018,391,491	4.250000	2029/2/28	0.28
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 280215	6,650,000	15,324.92	1,019,107,819	15,204.75	1,011,116,300	2.750000	2028/2/15	0.28
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280515	6,600,000	15,367.08	1,014,227,590	15,236.84	1,005,631,733	2.875000	2028/5/15	0.28
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 251115	6,400,000	15,516.20	993,036,814	15,535.07	994,244,844	2.250000	2025/11/15	0.27
アメリカ	国債証券	4.625 T-NOTE 260228	6,180,000	16,046.21	991,655,804	16,051.63	991,990,868	4.625000	2026/2/28	0.27

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

2024年 6月28日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	100.73
合計	100.73

（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。

新マネー・マーケット・マザーファンド

投資状況

2024年 6月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国 / 地域	時価合計	投資比率（％）
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	41,608,800	100.00
純資産総額		41,608,800	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

該当事項はありません。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

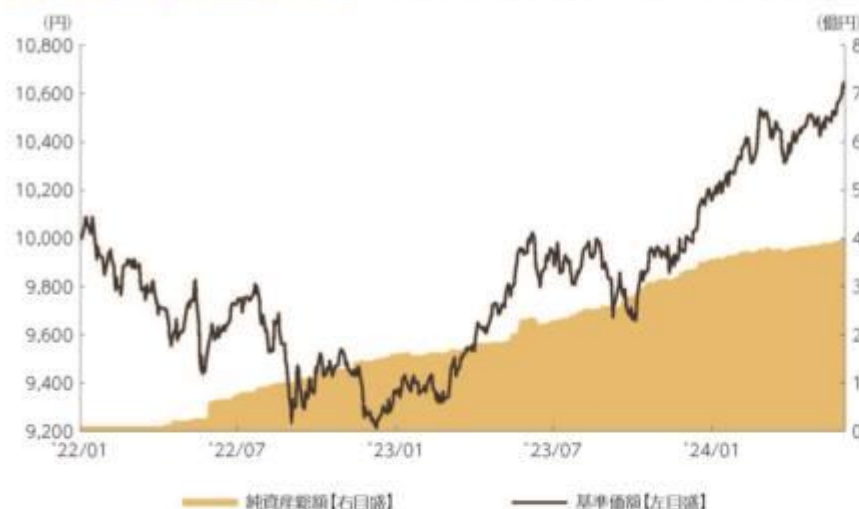
参考情報



運用実績

2024年6月28日現在

■基準価額・純資産の推移 2022年1月27日(設定日)～2024年6月28日



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

■基準価額・純資産

基準価額	10,647円
純資産総額	4.0億円

•純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024年 6月	0円
2023年 6月	0円
2022年 6月	0円
設定来累計	0円

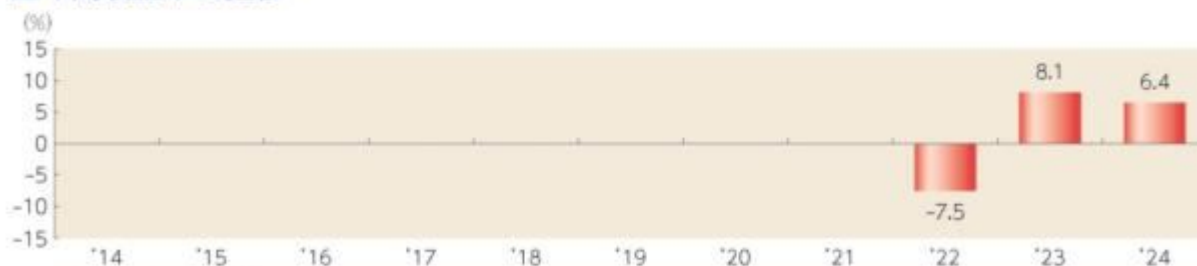
•分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

組入上位銘柄	比率
1 ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	26.4%
2 TOPIXマザーファンド	17.2%
3 外国株式インデックスマザーファンド	17.0%
4 外国債券インデックスマザーファンド	12.9%
5 日本短期債券マザーファンド	11.6%
6 東証REIT指数マザーファンド	4.9%
7 新マネー・マーケット・マザーファンド	3.0%

•比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2022年は設定日から年末までの、2024年は年初から6月28日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日およびその前営業日

ニューヨークの銀行の休業日およびその前営業日

ロンドン証券取引所の休業日およびその前営業日

ロンドンの銀行の休業日およびその前営業日

シンガポールの銀行の休業日およびその前営業日

モントリオールの銀行の休業日およびその前営業日

シドニーの銀行の休業日およびその前営業日

その他ニューヨーク、ロンドン、シンガポール、モントリオールまたはシドニーにおける債券市場の取引停止日およびその前営業日

なお、取得申込受付日から起算して７営業日の間に特定の海外休業日（組入各国・地域、ニューヨークおよびロンドンのいずれかの銀行の休業日または債券市場の取引停止日（いずれも半休を含みます。））が３日以上ある場合であって、受益者間の公平性の観点から運用上必要であると委託会社が判断した日を追加することができます。

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

申込単位

販売会社が定める単位

申込価額

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額

申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

申込手数料

ありません。

申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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。

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。

ただし、2024年11月5日以降は、以下の通りとなります。

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30分までに、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。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

取得申込みの受付の中止および取消し

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

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

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日およびその前営業日

ニューヨークの銀行の休業日およびその前営業日

ロンドン証券取引所の休業日およびその前営業日

ロンドンの銀行の休業日およびその前営業日

シンガポールの銀行の休業日およびその前営業日

モントリオールの銀行の休業日およびその前営業日

シドニーの銀行の休業日およびその前営業日

その他ニューヨーク、ロンドン、シンガポール、モントリオールまたはシドニーにおける債券市場の取引停止日およびその前営業日

なお、解約請求受付日から起算して7営業日の間に特定の海外休業日（組入各国・地域、ニューヨークおよびロンドンのいずれかの銀行の休業日または債券市場の取引停止日（いずれも半休を含みます。））が3日以上ある場合であって、受益者間の公平性の観点から運用上必要であると委託会社が判断した日を追加することができます。

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。

解約単位

販売会社が定める単位

解約価額

解約請求受付日の翌々営業日の基準価額

信託財産留保額

ありません。

解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

支払開始日

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

解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、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。

ただし、2024年11月5日以降は、以下の通りとなります。

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時30分までに、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。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

解約請求受付の中止および取消し

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

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

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

（資産の評価方法）

・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

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

・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

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

ます。

- ・公社債等

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

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

- ・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

- ・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

- ・外貨建資産

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

- ・外国為替予約取引

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

- ・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限（2022年１月27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６月26日から翌年６月25日まで

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

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

ファンドの償還条件等

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

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

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

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

信託約款の変更等

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

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

ファンドの償還等に関する開示方法

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

反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

関係法人との契約の更改

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

運用報告書

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

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

信託事務の再信託

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

公告

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

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

（１）収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に应じて受領する権利を有します。

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。

分配金再投資コース（累積投資コース）

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

（２）償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に应じて受領する権利を有します。

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

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

（３）換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（2023年6月27日から2024年6月25日まで）の財務諸表について、PwC Japan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】

【ラップ向けアクティブアロケーションファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 [2023年 6月26日現在]	第3期 [2024年 6月25日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,820,889	28,168,001
親投資信託受益証券	221,624,427	371,486,616
未収入金	8,900,000	-
未収利息	-	48
流動資産合計	232,345,316	399,654,665
資産合計	232,345,316	399,654,665
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	28,074	60,811
未払委託者報酬	159,012	344,560
未払利息	4	-
その他未払費用	2,375	5,208
流動負債合計	189,465	410,579
負債合計	189,465	410,579
純資産の部		
元本等		
元本	233,524,084	376,022,607
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,368,233	23,221,479
（分配準備積立金）	7,867,939	31,220,716
元本等合計	232,155,851	399,244,086
純資産合計	232,155,851	399,244,086
負債純資産合計	232,345,316	399,654,665

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 自 2022年 6月28日 至 2023年 6月26日	第3期 自 2023年 6月27日 至 2024年 6月25日
営業収益		
受取利息	62	3,405
有価証券売買等損益	8,180,666	25,482,586
営業収益合計	8,180,728	25,485,991
営業費用		
支払利息	3,569	4,163
受託者報酬	45,173	104,777
委託者報酬	255,795	593,630
その他費用	3,799	8,957
営業費用合計	308,336	711,527
営業利益又は営業損失（ ）	7,872,392	24,774,464
経常利益又は経常損失（ ）	7,872,392	24,774,464
当期純利益又は当期純損失（ ）	7,872,392	24,774,464
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（ ）	201,789	639,760
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,568,721	1,368,233
剰余金増加額又は欠損金減少額	641,343	455,008
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	641,343	181,625
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	273,383
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,515,036	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,515,036	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,368,233	23,221,479

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年6月25日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は2023年 6月27日から2024年 6月25日までとなっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第2期 [2023年 6月26日現在]	第3期 [2024年 6月25日現在]
1. 期首元本額	65,355,671円	233,524,084円
期中追加設定元本額	182,223,164円	172,633,216円
期中一部解約元本額	14,054,751円	30,134,693円
2. 元本の欠損		
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	1,368,233円	—円
3. 受益権の総数	233,524,084口	376,022,607口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第2期 自 2022年 6月28日 至 2023年 6月26日	第3期 自 2023年 6月27日 至 2024年 6月25日																																																												
1.運用に係る権限を委託するための費用 「先進国高格付国債マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の7.5以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。	1.運用に係る権限を委託するための費用 「先進国高格付国債マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の7.5以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。																																																												
2.分配金の計算過程	2.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>2,033,832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>5,760,837円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>326,695円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>73,270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>8,194,634円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>233,524,084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>350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	2,033,832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	5,760,837円	収益調整金額	C	326,695円	分配準備積立金額	D	73,270円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,194,634円	当ファンドの期末残存口数	F	233,524,084口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	350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>5,406,185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>18,728,519円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>6,226,082円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>7,086,012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>37,446,798円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>376,022,607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>995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	5,406,185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	18,728,519円	収益調整金額	C	6,226,082円	分配準備積立金額	D	7,086,012円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	37,446,798円	当ファンドの期末残存口数	F	376,022,607口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	995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	2,033,832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	5,760,837円																																																											
収益調整金額	C	326,695円																																																											
分配準備積立金額	D	73,270円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,194,634円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	233,524,084口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	350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	5,406,185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	18,728,519円																																																											
収益調整金額	C	6,226,082円																																																											
分配準備積立金額	D	7,086,012円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	37,446,798円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	376,022,607口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	995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2期 自 2022年 6月28日 至 2023年 6月26日	第3期 自 2023年 6月27日 至 2024年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左

区分	第2期 自 2022年 6月28日 至 2023年 6月26日	第3期 自 2023年 6月27日 至 2024年 6月25日
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第2期 [2023年 6月26日現在]	第3期 [2024年 6月25日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
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2期 [2023年 6月26日現在]	第3期 [2024年 6月25日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	8,492,961	10,492,523
合計	8,492,961	10,492,523

(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2期 [2023年 6月26日現在]	第3期 [2024年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	0.9941円	1.0618円
(1万口当たり純資産額)	(9,941円)	(10,618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

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	95,700,637	105,931,035	
	東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	4,355,081	15,149,584	
	新マネー・マーケット・マザーファンド	22,314,383	22,075,619	
	日本短期債券マザーファンド	41,473,584	46,529,213	
	ＴＯＰＩＸマザーファンド	17,221,155	58,880,851	
	外国株式インデックスマザーファンド	10,598,651	79,039,439	
	外国債券インデックスマザーファンド	15,716,646	43,880,875	
合 計		207,380,137	371,486,616	

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）

[2024年 6月25日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	18,355,142,028
株式	1,525,268,823,520
派生商品評価勘定	157,617,850
未収配当金	5,812,891,067
未収利息	31,862
前払金	96,495,000
その他未収収益	17,539,563
差入委託証拠金	676,169,473
流動資産合計	1,550,384,710,363
資産合計	1,550,384,710,363
負債の部	
流動負債	
未払金	498,213,409
未払解約金	1,453,153,726
未払利息	666,302
受入担保金	8,870,701,979
流動負債合計	10,822,735,416
負債合計	10,822,735,416
純資産の部	
元本等	
元本	450,277,870,938
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,089,284,104,009
元本等合計	1,539,561,974,947

[2024年 6月25日現在]

純資産合計	1,539,561,974,947
負債純資産合計	1,550,384,710,363

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 6月25日現在]
1. 期首	2023年 6月27日
期首元本額	402,039,788,052円
期中追加設定元本額	186,034,125,175円
期中一部解約元本額	137,796,042,289円
元本の内訳	
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスオープン	6,557,010,231円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	740,117,866円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	3,604,560,997円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	3,735,037,750円
三菱ＵＦＪ トピックスオープン（確定拠出年金）	3,717,634,846円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	5,491,866,256円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	32,542,134,437円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	41,479,791,911円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	83,015,677円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（成長型）	233,367,960円
ファンド・マネジャー（国内株式）	367,585,050円
eMAXIS TOPIXインデックス	7,278,627,026円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,922,737,444円
eMAXIS バランス（波乗り型）	76,516,959円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	2,711,159,887円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	811,636,159円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	1,105,966,907円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	1,112,060,243円
eMAXIS Slim 国内株式（TOPIX）	55,986,411,827円
国内株式セレクション（ラップ向け）	5,947,152,067円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	10,473,487,079円
つみたて日本株式（TOPIX）	10,724,816,898円
つみたて8資産均等バランス	5,270,085,751円
つみたて4資産均等バランス	2,003,331,999円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	3,092,678円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	5,254,739円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	9,752,093円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	698,699,355円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	944,212,360円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	692,772,516円
三菱ＵＦＪ DC年金バランス（株式15）	500,692,745円
三菱ＵＦＪ DC年金バランス（株式40）	1,729,718,993円
三菱ＵＦＪ DC年金バランス（株式65）	4,362,611,013円
eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）	1,606,848,367円

	[2024年 6月25日現在]
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金インデックス（国内株式）	5,076,000,148円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）	646,696,118円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式２５）	150,130,908円
国内株式インデックス・オープン（ラップ向け）	20,559,538,941円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６５（確定拠出年金）	317,190,158円
ラップ向けインデックスf 国内株式	3,974,504,391円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）	150,798,956円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）	3,897,533,875円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）	2,512,638,259円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式８０）	62,839,870円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	3,933,347,202円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	109,937,691円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	17,221,155円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	30,230,052円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０７０（確定拠出年金）	4,099,096円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス（為替リスク軽減型）コンサバティブコース	3,188,427円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス（為替リスク軽減型）スタンダードコース	59,229,858円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	1,052,002,391円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	2,520,574,502円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	172,751,012円
三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	1,544,861,098円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	267,537,328円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	18,178,836円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	129,340,605円
eMAXIS バランス（４資産均等型）	830,438,907円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	148,789,753円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	190,743,227円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	807,928,788円
eMAXIS 最適化バランス（マイフワード）	670,616,258円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	1,241,998,166円
三菱ＵＦＪ トピックスオープン	932,458,164円
三菱ＵＦＪ ＤＣトピックスオープン	8,087,744,608円
三菱ＵＦＪ トピックスオープンVA（適格機関投資家限定）	40,685,848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）	3,805,769,706円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５VA（適格機関投資家限定）	7,126,130円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０VA（適格機関投資家限定）	3,417,658,721円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA ２０型（適格機関投資家限定）	56,530,817円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA ４０型（適格機関投資家限定）	1,157,558,090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）	57,008,040,431円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA ５０型（適格機関投資家限定）	174,861,412円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５VA（適格機関投資家限定）	200,364円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA ３０型（適格機関投資家限定）	119,197円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	173,094,647円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０VA（適格機関投資家限定）	311,014,211円
MUAM インデックスファンドTOPIXi（適格機関投資家限定）	3,980,868,428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）	3,279,597,155円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	1,023,840,101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）	489,975,713円
世界８資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	88,443,632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）	2,655,446,409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）	147,660,310円

	[2024年 6月25日現在]
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）	3,756,458,341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）	246,971,365円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	6,172,404,822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）	31,326,214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）	269,377円
日米コアバランス（F O F s用）（適格機関投資家限定）	78,414,341円
日本株式インデックスファンドS	3,834,981,695円
グローバルバランスオープンV（適格機関投資家限定）	3,301,579円
MUAM グローバルバランス（退職給付信託向け）（適格機関投資家限定）	9,798,010,251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）	35,419,113円
MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド２０２０－０７（適格機関投資家限定）	81,351,225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）	34,940,101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）	34,951,319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）	34,742,713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）	34,935,203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）	35,058,940円
MUKAM 日米コアバランス ２０２１－０７（適格機関投資家限定）	210,747,257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）	34,450,377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）	34,305,177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）	34,874,281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）	35,762,664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）	395,970,408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）	37,565,083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）	38,774,804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）	39,792,135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）	39,241,585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）	39,102,095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）	39,096,327円
MUKAM アセットアロケーションファンド２０２３－０３（適格機関投資家限定）	39,100,255円
MUKAM アセットアロケーションファンド２０２３－０５（適格機関投資家限定）	39,088,327円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	5,652,449,235円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	2,528,269円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	6,150,244円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	1,437,676円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	5,578,293円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	444,960,195円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	62,040,407円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	2,795,906円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	24,614,162円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	1,347,059円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	14,361,459円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,583,689,495円

	[2024年 6月25日現在]
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	299,743,876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）	1,303,611,955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）	1,263,628,261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）	1,235,194,805円
三菱ＵＦＪ ＤＣ国内株式インデックスファンド	60,632,984,111円
合計	450,277,870,938円
2. 貸付有価証券 貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っております。 株式	8,604,019,100円
3. 受益権の総数	450,277,870,938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 2023年 6月27日 至 2024年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、新株予約権証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク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	[2024年 6月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[2024年 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	6,958,986,237
合計	6,958,986,237

（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

[2024年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	14,131,715,000	—	14,289,615,000	157,900,000
合計		14,131,715,000	—	14,289,615,000	157,900,000

（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 ）

	[2024年 6月25日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.4191円 (34,191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	22,500	4,115.00	92,587,500	
1332	ニッスイ	544,300	866.50	471,635,950	
1333	マルハニチロ	80,800	3,228.00	260,822,400	貸付有価証券 2,800株
1375	雪国まいたけ	46,400	1,016.00	47,142,400	
1376	カネコ種苗	15,400	1,430.00	22,022,000	
1377	サカタのタネ	62,000	3,460.00	214,520,000	
1379	ホクト	43,600	1,891.00	82,447,600	
1384	ホクリヨウ	2,500	992.00	2,480,000	貸付有価証券 200株
1514	住石ホールディングス	69,300	1,390.00	96,327,000	貸付有価証券 18,200株
1515	日鉄鉱業	21,800	5,110.00	111,398,000	
1518	三井松島ホールディングス	32,200	4,960.00	159,712,000	貸付有価証券 2,400株
1605	I N P E X	1,828,100	2,388.00	4,365,502,800	
1662	石油資源開発	63,100	6,400.00	403,840,000	
1663	K & Oエナジーグループ	24,700	3,640.00	89,908,000	

1414	ショーボンドホールディングス	74,100	5,832.00	432,151,200	
1417	ミライト・ワン	164,300	2,099.00	344,865,700	
1419	タマホーム	34,200	3,940.00	134,748,000	
1420	サンヨーホームズ	2,100	735.00	1,543,500	貸付有価証券 200株
1429	日本アクア	7,000	927.00	6,489,000	貸付有価証券 900株
1430	ファーストコーポレーション	4,300	770.00	3,311,000	貸付有価証券 400株
1433	ベステラ	3,800	1,014.00	3,853,200	貸付有価証券 600株
1446	キャンディル	2,800	634.00	1,775,200	貸付有価証券 400株
1712	ダイセキ環境ソリューション	3,400	1,005.00	3,417,000	貸付有価証券 1,200株
1716	第一カッター興業	15,700	1,629.00	25,575,300	
1719	安藤・間	315,400	1,144.00	360,817,600	貸付有価証券 5,900株
1720	東急建設	170,500	764.00	130,262,000	
1721	コムシスホールディングス	173,800	3,112.00	540,865,600	
1726	ピーアールホールディングス	79,800	362.00	28,887,600	
1762	高松コンストラクショングループ	40,400	3,025.00	122,210,000	
1766	東建コーポレーション	13,700	12,330.00	168,921,000	貸付有価証券 600株
1768	ソネック	1,800	954.00	1,717,200	
1780	ヤマウラ	27,600	1,369.00	37,784,400	
1786	オリエンタル白石	201,500	365.00	73,547,500	
1801	大成建設	348,800	5,820.00	2,030,016,000	貸付有価証券 100株
1802	大林組	1,361,800	1,830.50	2,492,774,900	貸付有価証券 1,900株
1803	清水建設	1,079,700	884.50	954,994,650	
1805	飛島建設	39,300	1,498.00	58,871,400	
1808	長谷工コーポレーション	349,400	1,779.00	621,582,600	
1810	松井建設	35,500	856.00	30,388,000	
1811	銭高組	1,500	4,300.00	6,450,000	貸付有価証券 600株
1812	鹿島建設	844,300	2,731.00	2,305,783,300	貸付有価証券 9,700株
1813	不動テトラ	26,300	2,521.00	66,302,300	貸付有価証券 200株
1814	大末建設	4,600	1,705.00	7,843,000	
1815	鉄建建設	27,300	2,645.00	72,208,500	
1820	西松建設	72,600	4,537.00	329,386,200	
1821	三井住友建設	283,400	399.00	113,076,600	
1822	大豊建設	13,100	3,375.00	44,212,500	貸付有価証券 500株

1826	佐田建設	7,500	740.00	5,550,000	貸付有価証券 200株
1827	ナカノフドー建設	8,400	518.00	4,351,200	
1833	奥村組	61,800	4,980.00	307,764,000	貸付有価証券 500株
1835	東鉄工業	47,200	3,190.00	150,568,000	
1847	イチケン	2,900	2,666.00	7,731,400	
1848	富士ピー・エス	5,400	460.00	2,484,000	
1852	浅沼組	28,200	3,735.00	105,327,000	
1860	戸田建設	515,300	1,057.00	544,672,100	
1861	熊谷組	62,800	3,655.00	229,534,000	
1866	北野建設	2,200	3,620.00	7,964,000	
1867	植木組	3,400	1,709.00	5,810,600	
1870	矢作建設工業	51,800	1,632.00	84,537,600	
1871	ピーエス三菱	48,300	989.00	47,768,700	
1873	日本ハウスホールディングス	81,300	342.00	27,804,600	貸付有価証券 800株
1879	新日本建設	53,500	1,633.00	87,365,500	
1882	東亜道路工業	74,600	1,307.00	97,502,200	
1884	日本道路	44,700	1,800.00	80,460,000	貸付有価証券 1,200株
1885	東亜建設工業	115,000	1,027.00	118,105,000	
1887	日本国土開発	108,300	470.00	50,901,000	
1888	若築建設	13,200	3,495.00	46,134,000	
1890	東洋建設	95,900	1,421.00	136,273,900	貸付有価証券 600株
1893	五洋建設	539,800	664.10	358,481,180	
1898	世紀東急工業	48,900	1,723.00	84,254,700	
1899	福田組	14,400	5,660.00	81,504,000	
1911	住友林業	329,100	5,266.00	1,733,040,600	
1914	日本基礎技術	7,200	635.00	4,572,000	貸付有価証券 200株
1921	巴コーポレーション	15,000	853.00	12,795,000	
1925	大和ハウス工業	1,053,000	4,065.00	4,280,445,000	貸付有価証券 500株
1926	ライト工業	75,700	2,106.00	159,424,200	
1928	積水ハウス	1,154,900	3,526.00	4,072,177,400	貸付有価証券 3,800株
1929	日特建設	36,400	1,113.00	40,513,200	貸付有価証券 1,300株
1930	北陸電気工事	26,100	1,188.00	31,006,800	
1934	ユアテック	83,900	1,510.00	126,689,000	
1938	日本リーテック	29,800	1,262.00	37,607,600	
1939	四電工	15,900	3,670.00	58,353,000	
1941	中電工	59,100	3,155.00	186,460,500	

1942	関電工	238,400	1,703.00	405,995,200	貸付有価証券 200株
1944	きんでん	264,800	3,268.00	865,366,400	
1945	東京エネシス	35,500	1,394.00	49,487,000	
1946	トーエネック	12,600	6,020.00	75,852,000	
1949	住友電設	36,200	3,820.00	138,284,000	
1950	日本電設工業	71,500	1,980.00	141,570,000	
1951	エクシオグループ	372,200	1,586.50	590,495,300	貸付有価証券 500株
1952	新日本空調	24,700	3,955.00	97,688,500	
1959	九電工	82,300	5,852.00	481,619,600	貸付有価証券 400株
1961	三機工業	82,300	2,120.00	174,476,000	
1963	日揮ホールディングス	376,700	1,285.50	484,247,850	
1964	中外炉工業	12,500	3,445.00	43,062,500	
1967	ヤマト	9,900	985.00	9,751,500	
1968	太平電業	23,700	5,440.00	128,928,000	
1969	高砂熱学工業	102,000	5,800.00	591,600,000	貸付有価証券 200株
1972	三晃金属工業	1,500	4,540.00	6,810,000	
1975	朝日工業社	35,500	1,378.00	48,919,000	
1976	明星工業	73,700	1,291.00	95,146,700	
1979	大気社	43,900	5,140.00	225,646,000	
1980	ダイダン	50,100	3,045.00	152,554,500	
1982	日比谷総合設備	27,600	3,560.00	98,256,000	
3267	フィル・カンパニー	5,900	719.00	4,242,100	貸付有価証券 800株
5074	テスホールディングス	82,000	429.00	35,178,000	
5076	インフロニア・ホールディングス	439,000	1,299.50	570,480,500	貸付有価証券 14,100株
6330	東洋エンジニアリング	56,000	887.00	49,672,000	
6379	レイズネクスト	55,100	1,832.00	100,943,200	
2001	ニッポン	114,400	2,340.00	267,696,000	
2002	日清製粉グループ本社	353,500	1,851.50	654,505,250	
2003	日東富士製粉	6,800	7,450.00	50,660,000	
2004	昭和産業	37,000	3,110.00	115,070,000	
2009	鳥越製粉	9,900	698.00	6,910,200	貸付有価証券 2,100株
2053	中部飼料	52,900	1,622.00	85,803,800	
2060	フィード・ワン	55,900	976.00	54,558,400	貸付有価証券 2,000株
2107	東洋精糖	2,200	1,652.00	3,634,400	
2108	日本甜菜製糖	22,300	2,167.00	48,324,100	
2109	D M三井製糖ホールディングス	37,900	3,395.00	128,670,500	
2112	塩水港精糖	15,700	268.00	4,207,600	

2117	ウェルネオシュガー	19,100	2,356.00	44,999,600	
2201	森永製菓	161,500	2,522.50	407,383,750	
2204	中村屋	9,500	3,270.00	31,065,000	
2206	江崎グリコ	109,400	4,237.00	463,527,800	
2207	名糖産業	15,100	2,000.00	30,200,000	
2209	井村屋グループ	22,800	2,448.00	55,814,400	
2211	不二家	26,200	2,659.00	69,665,800	貸付有価証券 1,000株
2212	山崎製パン	255,900	3,409.00	872,363,100	貸付有価証券 1,400株
2215	第一屋製パン	2,200	684.00	1,504,800	貸付有価証券 200株
2217	モロゾフ	12,400	4,770.00	59,148,000	
2220	亀田製菓	21,900	4,250.00	93,075,000	貸付有価証券 100株
2222	寿スビリッツ	180,700	1,822.50	329,325,750	
2229	カルビー	175,000	3,138.00	549,150,000	
2264	森永乳業	133,500	3,309.00	441,751,500	
2266	六甲バター	28,000	1,561.00	43,708,000	
2267	ヤクルト本社	546,300	2,924.00	1,597,381,200	貸付有価証券 13,300株
2269	明治ホールディングス	468,700	3,467.00	1,624,982,900	
2270	雪印メグミルク	92,500	2,614.00	241,795,000	
2281	プリマハム	51,300	2,396.00	122,914,800	
2282	日本ハム	164,400	4,908.00	806,875,200	
2286	林兼産業	4,000	528.00	2,112,000	
2288	丸大食品	38,500	1,735.00	66,797,500	
2292	S F o o d s	42,200	2,957.00	124,785,400	貸付有価証券 200株
2294	柿安本店	14,900	2,634.00	39,246,600	
2296	伊藤ハム米久ホールディングス	58,400	4,280.00	249,952,000	
2501	サッポロホールディングス	125,800	5,587.00	702,844,600	
2502	アサヒグループホールディングス	883,300	5,794.00	5,117,840,200	
2503	キリンホールディングス	1,592,400	2,132.50	3,395,793,000	
2531	宝ホールディングス	257,800	1,086.50	280,099,700	
2533	オエノンホールディングス	114,300	382.00	43,662,600	
2540	養命酒製造	12,600	2,229.00	28,085,400	
2579	コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	299,500	2,015.00	603,492,500	
2585	ライフドリンク カンパニー	7,600	6,580.00	50,008,000	
2587	サントリー食品インターナショナル	269,200	5,842.00	1,572,666,400	
2590	ダイドーグループホールディングス	43,300	2,715.00	117,559,500	貸付有価証券 2,400株
2593	伊藤園	129,500	3,557.00	460,631,500	
2594	キーコーヒー	42,800	2,080.00	89,024,000	

2597	ユニカフェ	4,000	921.00	3,684,000	
2599	ジャパンフーズ	1,800	2,444.00	4,399,200	
2602	日清オイリオグループ	53,800	4,960.00	266,848,000	
2607	不二製油グループ本社	89,000	2,908.00	258,812,000	
2612	かどや製油	1,200	3,645.00	4,374,000	
2613	Ｊ－オイルミルズ	43,800	2,001.00	87,643,800	貸付有価証券 1,000株
2801	キッコーマン	1,266,700	1,899.50	2,406,096,650	
2802	味の素	908,500	5,846.00	5,311,091,000	
2804	ブルドックソース	20,300	1,998.00	40,559,400	貸付有価証券 900株
2809	キューピー	205,400	3,220.00	661,388,000	貸付有価証券 7,300株
2810	ハウス食品グループ本社	131,700	2,911.50	383,444,550	
2811	カゴメ	164,400	3,320.00	545,808,000	貸付有価証券 5,800株
2815	アリアケジャパン	38,100	5,070.00	193,167,000	
2818	ピエトロ	1,600	1,801.00	2,881,600	
2819	エバラ食品工業	9,100	2,944.00	26,790,400	
2820	やまみ	1,000	3,260.00	3,260,000	貸付有価証券 200株
2871	ニチレイ	175,200	3,570.00	625,464,000	貸付有価証券 1,300株
2875	東洋水産	193,200	9,705.00	1,875,006,000	貸付有価証券 5,200株
2882	イトアンドホールディングス	18,100	2,134.00	38,625,400	
2883	大冷	1,600	1,930.00	3,088,000	
2884	ヨシムラ・フード・ホールディングス	17,400	1,643.00	28,588,200	貸付有価証券 3,200株
2897	日清食品ホールディングス	403,200	4,095.00	1,651,104,000	
2899	永谷園ホールディングス	18,800	3,095.00	58,186,000	
2904	一正蒲鉾	5,100	772.00	3,937,200	貸付有価証券 1,700株
2908	フジッコ	39,300	1,866.00	73,333,800	
2910	ロック・フィールド	46,700	1,488.00	69,489,600	貸付有価証券 6,400株
2914	日本たばこ産業	2,323,000	4,491.00	10,432,593,000	
2915	ケンコーマヨネーズ	26,300	2,043.00	53,730,900	
2918	わらべや日洋ホールディングス	25,600	2,321.00	59,417,600	貸付有価証券 1,800株
2922	なとり	24,000	2,103.00	50,472,000	
2924	イフジ産業	2,200	1,393.00	3,064,600	貸付有価証券 200株
2929	ファーマフーズ	50,700	1,014.00	51,409,800	
2931	ユーグレナ	238,000	551.00	131,138,000	貸付有価証券 19,000株
2933	紀文食品	33,100	1,283.00	42,467,300	

2935	ピククルスホールディングス	22,400	1,181.00	26,454,400	
4404	ミヨシ油脂	4,400	1,507.00	6,630,800	貸付有価証券 600株
4526	理研ビタミン	33,000	2,769.00	91,377,000	
3001	片倉工業	35,800	2,216.00	79,332,800	
3002	グンゼ	27,600	5,680.00	156,768,000	
3101	東洋紡	168,100	1,064.00	178,858,400	
3103	ユニチカ	125,800	343.00	43,149,400	
3104	富士紡ホールディングス	17,000	4,970.00	84,490,000	
3106	倉敷紡績	27,600	4,995.00	137,862,000	
3109	シキボウ	25,100	1,120.00	28,112,000	
3201	日本毛織	99,700	1,348.00	134,395,600	
3202	ダイトウボウ	19,700	104.00	2,048,800	貸付有価証券 7,000株
3204	トーア紡コーポレーション	4,800	423.00	2,030,400	貸付有価証券 2,000株
3205	ダイドーリミテッド	15,500	817.00	12,663,500	貸付有価証券 7,100株
3302	帝国繊維	43,900	2,501.00	109,793,900	
3401	帝人	373,600	1,379.50	515,381,200	
3402	東レ	2,605,600	759.10	1,977,910,960	
3501	住江織物	2,200	2,518.00	5,539,600	貸付有価証券 200株
3512	日本フェルト	7,000	499.00	3,493,000	貸付有価証券 500株
3513	イチカワ	1,500	1,783.00	2,674,500	
3524	日東製網	1,300	1,505.00	1,956,500	貸付有価証券 100株
3529	アツギ	8,200	630.00	5,166,000	貸付有価証券 3,600株
3551	ダイニック	3,600	830.00	2,988,000	貸付有価証券 400株
3569	セーレン	75,100	2,418.00	181,591,800	
3571	ソトー	3,800	712.00	2,705,600	
3577	東海染工	1,100	833.00	916,300	
3580	小松マテーレ	56,400	757.00	42,694,800	
3591	ワコールホールディングス	79,700	4,408.00	351,317,600	貸付有価証券 2,500株
3593	ホギメディカル	51,300	3,990.00	204,687,000	
3607	クラウディアホールディングス	2,800	426.00	1,192,800	貸付有価証券 1,100株
3608	T S Iホールディングス	116,600	946.00	110,303,600	
3611	マツオカコーポレーション	3,600	1,775.00	6,390,000	貸付有価証券 100株
3612	ワールド	54,900	2,120.00	116,388,000	貸付有価証券 1,800株
8011	三陽商会	16,500	2,471.00	40,771,500	

8013	ナイガイ	4,100	261.00	1,070,100	貸付有価証券 1,600株
8016	オンワードホールディングス	229,300	633.00	145,146,900	貸付有価証券 8,800株
8029	ルックホールディングス	12,200	2,814.00	34,330,800	
8107	キムラタン	77,000	17.00	1,309,000	貸付有価証券 23,300株
8111	ゴールドウイン	68,900	8,820.00	607,698,000	貸付有価証券 700株
8114	デサント	67,000	3,445.00	230,815,000	
8118	キング	4,600	732.00	3,367,200	貸付有価証券 1,200株
8127	ヤマトインターナショナル	9,500	354.00	3,363,000	
3708	特種東海製紙	21,200	3,725.00	78,970,000	
3861	王子ホールディングス	1,620,100	626.70	1,015,316,670	
3863	日本製紙	219,400	964.00	211,501,600	
3864	三菱製紙	16,200	800.00	12,960,000	貸付有価証券 5,100株
3865	北越コーポレーション	191,100	1,115.00	213,076,500	貸付有価証券 28,800株
3877	中越パルプ工業	4,800	1,533.00	7,358,400	貸付有価証券 1,900株
3880	大王製紙	171,800	879.10	151,029,380	
3896	阿波製紙	3,000	554.00	1,662,000	貸付有価証券 1,500株
3941	レンゴー	354,200	1,025.50	363,232,100	
3946	トーモク	22,500	2,869.00	64,552,500	貸付有価証券 800株
3950	ザ・パックス	28,900	3,675.00	106,207,500	
2930	北の達人コーポレーション	163,900	181.00	29,665,900	貸付有価証券 21,300株
3405	クラレ	566,700	1,901.50	1,077,580,050	
3407	旭化成	2,631,000	1,033.00	2,717,823,000	
3553	共和レザー	7,000	806.00	5,642,000	
3878	巴川コーポレーション	3,400	1,091.00	3,709,400	貸付有価証券 1,300株
4004	レゾナック・ホールディングス	375,800	3,411.00	1,281,853,800	
4005	住友化学	2,886,000	334.10	964,212,600	
4008	住友精化	18,300	5,270.00	96,441,000	
4021	日産化学	181,400	4,940.00	896,116,000	
4022	ラサ工業	15,000	2,931.00	43,965,000	
4023	クレハ	85,000	2,787.00	236,895,000	
4025	多木化学	15,100	4,455.00	67,270,500	貸付有価証券 200株
4027	テイカ	31,900	1,674.00	53,400,600	
4028	石原産業	64,500	1,585.00	102,232,500	
4031	片倉コープアグリ	2,800	1,199.00	3,357,200	貸付有価証券 1,300株

4041	日本曹達	45,900	5,160.00	236,844,000	
4042	東ソー	519,200	2,099.00	1,089,800,800	貸付有価証券 3,100株
4043	トクヤマ	125,600	2,924.00	367,254,400	
4044	セントラル硝子	41,500	3,725.00	154,587,500	
4045	東亜合成	187,000	1,544.00	288,728,000	貸付有価証券 600株
4046	大阪ソーダ	27,200	10,400.00	282,880,000	
4047	関東電化工業	75,200	964.00	72,492,800	貸付有価証券 2,700株
4061	デンカ	141,400	2,164.50	306,060,300	
4063	信越化学工業	3,487,500	6,125.00	21,360,937,500	
4064	日本カーバイド工業	18,500	1,998.00	36,963,000	
4078	堺化学工業	29,600	2,942.00	87,083,200	
4082	第一稀元素化学工業	42,500	841.00	35,742,500	
4088	エア・ウォーター	366,900	2,197.00	806,079,300	
4091	日本酸素ホールディングス	377,300	4,735.00	1,786,515,500	貸付有価証券 400株
4092	日本化学工業	14,300	2,629.00	37,594,700	
4093	東邦アセチレン	13,300	374.00	4,974,200	貸付有価証券 3,000株
4095	日本パーカライジング	173,300	1,275.00	220,957,500	貸付有価証券 6,800株
4097	高圧ガス工業	56,500	978.00	55,257,000	
4098	チタン工業	1,600	1,025.00	1,640,000	貸付有価証券 500株
4099	四国化成ホールディングス	44,000	2,081.00	91,564,000	
4100	戸田工業	8,900	2,149.00	19,126,100	
4109	ステラ ケミファ	21,100	4,285.00	90,413,500	
4112	保土谷化学工業	12,200	5,710.00	69,662,000	
4114	日本触媒	226,500	1,594.50	361,154,250	
4116	大日精化工業	27,000	3,430.00	92,610,000	
4118	カネカ	95,800	4,274.00	409,449,200	
4182	三菱瓦斯化学	283,900	3,057.00	867,882,300	
4183	三井化学	320,800	4,375.00	1,403,500,000	
4186	東京応化工業	185,600	4,280.00	794,368,000	
4187	大阪有機化学工業	32,500	3,495.00	113,587,500	
4188	三菱ケミカルグループ	2,843,100	889.00	2,527,515,900	貸付有価証券 89,900株
4189	K Hネオケム	59,300	2,327.00	137,991,100	
4202	ダイセル	499,900	1,588.50	794,091,150	
4203	住友ベークライト	108,900	4,643.00	505,622,700	
4204	積水化学工業	781,400	2,241.50	1,751,508,100	貸付有価証券 600株
4205	日本ゼオン	266,600	1,373.50	366,175,100	
4206	アイカ工業	98,100	3,529.00	346,194,900	

4208	ＵＢＥ	185,000	2,842.50	525,862,500	
4212	積水樹脂	58,000	2,330.00	135,140,000	
4215	タキロンシーアイ	99,200	744.00	73,804,800	
4216	旭有機材	25,900	4,955.00	128,334,500	
4218	ニチバン	21,100	1,948.00	41,102,800	貸付有価証券 900株
4220	リケンテクノス	72,900	1,030.00	75,087,000	貸付有価証券 100株
4221	大倉工業	18,000	2,878.00	51,804,000	
4228	積水化成品工業	54,600	468.00	25,552,800	
4229	群栄化学工業	9,100	3,300.00	30,030,000	
4231	タイガースポリマー	5,400	847.00	4,573,800	
4238	ミライアル	4,200	1,548.00	6,501,600	
4245	ダイキアクシス	4,700	733.00	3,445,100	
4246	ダイキョーニシカワ	85,800	700.00	60,060,000	
4248	竹本容器	4,200	869.00	3,649,800	
4249	森六ホールディングス	20,200	2,834.00	57,246,800	
4251	恵和	28,000	1,664.00	46,592,000	貸付有価証券 2,400株
4272	日本化薬	297,100	1,236.00	367,215,600	
4275	カーリットホールディングス	41,900	1,297.00	54,344,300	
4362	日本精化	25,800	2,709.00	69,892,200	
4368	扶桑化学工業	41,200	4,100.00	168,920,000	
4369	トリケミカル研究所	47,200	4,225.00	199,420,000	
4401	A D E K A	135,600	3,183.00	431,614,800	
4403	日油	352,100	2,136.00	752,085,600	
4406	新日本理化	16,600	186.00	3,087,600	貸付有価証券 2,400株
4410	ハリマ化成グループ	27,300	924.00	25,225,200	
4452	花王	879,400	6,792.00	5,972,884,800	
4461	第一工業製薬	15,500	3,765.00	58,357,500	貸付有価証券 500株
4462	石原ケミカル	17,400	2,283.00	39,724,200	
4463	日華化学	4,800	1,085.00	5,208,000	
4465	ニイタカ	2,200	1,887.00	4,151,400	貸付有価証券 600株
4471	三洋化成工業	23,900	3,960.00	94,644,000	貸付有価証券 100株
4531	有機合成薬品工業	9,400	305.00	2,867,000	貸付有価証券 3,300株
4611	大日本塗料	43,100	1,325.00	57,107,500	
4612	日本ペイントホールディングス	2,065,000	1,065.00	2,199,225,000	
4613	関西ペイント	336,100	2,535.50	852,181,550	貸付有価証券 13,900株
4615	神東塗料	10,000	130.00	1,300,000	貸付有価証券 3,400株

4617	中国塗料	79,900	2,002.00	159,959,800	
4619	日本特殊塗料	8,600	1,231.00	10,586,600	
4620	藤倉化成	44,800	537.00	24,057,600	
4626	太陽ホールディングス	67,700	3,290.00	222,733,000	
4631	D I C	152,000	3,156.00	479,712,000	貸付有価証券 600株
4633	サカタインクス	86,500	1,832.00	158,468,000	
4634	a r t i e n c e	84,600	3,285.00	277,911,000	
4901	富士フイルムホールディングス	2,167,200	3,702.00	8,022,974,400	
4911	資生堂	813,100	4,740.00	3,854,094,000	
4912	ライオン	495,600	1,291.50	640,067,400	
4914	高砂香料工業	29,300	3,920.00	114,856,000	
4917	マンダム	84,100	1,233.00	103,695,300	
4919	ミルボン	52,900	3,395.00	179,595,500	
4921	ファンケル	170,300	2,772.00	472,071,600	貸付有価証券 13,600株
4922	コーセー	79,200	10,700.00	847,440,000	貸付有価証券 100株
4923	コタ	39,400	1,578.00	62,173,200	貸付有価証券 1,300株
4926	シーボン	1,600	1,394.00	2,230,400	貸付有価証券 600株
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	199,600	1,369.50	273,352,200	
4928	ノエビアホールディングス	34,700	5,570.00	193,279,000	
4929	アジュバンホールディングス	2,900	883.00	2,560,700	貸付有価証券 1,500株
4931	新日本製薬	22,200	1,738.00	38,583,600	
4933	I - n e	10,300	1,800.00	18,540,000	貸付有価証券 100株
4936	アクシージア	25,600	1,039.00	26,598,400	貸付有価証券 600株
4951	エステー	30,100	1,570.00	47,257,000	
4955	アグロ カネショウ	15,600	1,218.00	19,000,800	貸付有価証券 1,900株
4956	コニシ	112,500	1,308.00	147,150,000	
4958	長谷川香料	74,400	3,345.00	248,868,000	
4967	小林製薬	113,300	5,621.00	636,859,300	貸付有価証券 4,000株
4968	荒川化学工業	33,000	1,196.00	39,468,000	
4971	メック	32,100	4,590.00	147,339,000	
4973	日本高純度化学	8,800	3,375.00	29,700,000	
4974	タカラバイオ	104,900	1,053.00	110,459,700	
4975	J C U	43,000	3,980.00	171,140,000	
4977	新田ゼラチン	7,900	780.00	6,162,000	
4979	O A T アグリオ	14,500	1,687.00	24,461,500	
4980	デクセリアルズ	96,200	7,190.00	691,678,000	

4985	アース製薬	35,400	4,765.00	168,681,000	貸付有価証券 1,300株
4992	北興化学工業	39,200	1,481.00	58,055,200	貸付有価証券 1,400株
4994	大成ラミック	11,300	2,829.00	31,967,700	
4996	クミアイ化学工業	154,700	797.00	123,295,900	
4997	日本農薬	71,400	781.00	55,763,400	貸付有価証券 2,600株
5142	アキレス	24,500	1,629.00	39,910,500	
5208	有沢製作所	68,200	1,597.00	108,915,400	
6988	日東電工	250,100	12,890.00	3,223,789,000	
7874	レック	49,900	1,356.00	67,664,400	貸付有価証券 2,000株
7888	三光合成	49,000	712.00	34,888,000	
7908	きもと	20,100	222.00	4,462,200	
7917	藤森工業	30,800	4,195.00	129,206,000	
7925	前澤化成工業	25,100	1,814.00	45,531,400	
7931	未来工業	13,900	3,985.00	55,391,500	貸付有価証券 2,400株
7940	ウェーブロックホールディングス	4,200	655.00	2,751,000	
7942	J S P	27,400	2,294.00	62,855,600	
7947	エフビコ	73,700	2,412.00	177,764,400	
7958	天馬	28,200	2,696.00	76,027,200	
7970	信越ポリマー	84,000	1,500.00	126,000,000	
7971	東リ	27,900	393.00	10,964,700	
7988	ニフコ	116,500	3,821.00	445,146,500	
7995	バルカー	32,600	3,630.00	118,338,000	
8113	ユニ・チャーム	811,200	5,271.00	4,275,835,200	
9385	ショーエイコーポレーション	3,600	600.00	2,160,000	貸付有価証券 700株
4151	協和キリン	470,400	2,747.50	1,292,424,000	貸付有価証券 500株
4502	武田薬品工業	3,446,300	4,176.00	14,391,748,800	
4503	アステラス製薬	3,415,700	1,578.50	5,391,682,450	
4506	住友ファーマ	288,900	357.00	103,137,300	
4507	塩野義製薬	473,600	6,224.00	2,947,686,400	
4512	わかもと製薬	12,700	258.00	3,276,600	貸付有価証券 5,200株
4516	日本新薬	102,000	3,207.00	327,114,000	貸付有価証券 3,300株
4519	中外製薬	1,218,900	5,637.00	6,870,939,300	
4521	科研製薬	66,700	3,800.00	253,460,000	貸付有価証券 800株
4523	エーザイ	473,600	6,632.00	3,140,915,200	
4527	ロート製薬	377,200	3,336.00	1,258,339,200	貸付有価証券 400株

4528	小野薬品工業	796,500	2,230.50	1,776,593,250	貸付有価証券 21,600株
4530	久光製薬	86,600	3,768.00	326,308,800	貸付有価証券 600株
4534	持田製薬	43,500	3,100.00	134,850,000	
4536	参天製薬	687,000	1,627.00	1,117,749,000	
4538	扶桑薬品工業	13,700	2,399.00	32,866,300	
4539	日本ケミファ	1,400	1,598.00	2,237,200	貸付有価証券 600株
4540	ツムラ	122,600	4,259.00	522,153,400	貸付有価証券 1,200株
4547	キッセイ薬品工業	64,400	3,225.00	207,690,000	
4548	生化学工業	66,000	889.00	58,674,000	
4549	栄研化学	67,100	2,205.00	147,955,500	
4551	鳥居薬品	20,900	3,720.00	77,748,000	
4552	J C R ファーマ	131,800	606.00	79,870,800	
4553	東和薬品	59,800	2,908.00	173,898,400	
4554	富士製薬工業	28,800	1,437.00	41,385,600	貸付有価証券 1,400株
4559	ゼリア新薬工業	54,000	2,079.00	112,266,000	
4565	ネクセラファーマ	170,400	1,588.00	270,595,200	貸付有価証券 1,400株
4568	第一三共	3,392,300	5,558.00	18,854,403,400	
4569	杏林製薬	84,400	1,706.00	143,986,400	
4574	大幸薬品	80,900	408.00	33,007,200	
4577	ダイト	29,600	2,309.00	68,346,400	貸付有価証券 100株
4578	大塚ホールディングス	809,900	6,588.00	5,335,621,200	
4587	ペプチドリーム	188,800	2,365.50	446,606,400	貸付有価証券 3,400株
4880	セルソース	14,400	1,272.00	18,316,800	貸付有価証券 100株
4886	あすか製薬ホールディングス	39,900	2,656.00	105,974,400	
4887	サワイグループホールディングス	89,000	5,865.00	521,985,000	
3315	日本コークス工業	395,100	124.00	48,992,400	貸付有価証券 8,500株
5011	ニチレキ	50,600	2,483.00	125,639,800	貸付有価証券 200株
5013	ユシロ化学工業	20,200	1,850.00	37,370,000	
5015	ビービー・カストロール	4,700	991.00	4,657,700	貸付有価証券 400株
5017	富士石油	113,500	518.00	58,793,000	貸付有価証券 11,800株
5018	MORESCO	4,300	1,340.00	5,762,000	貸付有価証券 1,600株
5019	出光興産	2,022,000	1,052.00	2,127,144,000	
5020	E N E O S ホールディングス	6,164,700	832.40	5,131,496,280	
5021	コスモエネルギーホールディングス	115,500	8,116.00	937,398,000	

5101	横浜ゴム	196,900	3,627.00	714,156,300	
5105	ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	223,800	2,658.50	594,972,300	貸付有価証券 600株
5108	ブリヂストン	1,139,800	6,490.00	7,397,302,000	
5110	住友ゴム工業	381,900	1,630.50	622,687,950	
5121	藤倉コンポジット	33,700	1,392.00	46,910,400	
5122	オカモト	18,400	5,030.00	92,552,000	
5185	フコク	20,500	2,331.00	47,785,500	
5186	ニッタ	39,600	4,105.00	162,558,000	
5191	住友理工	60,400	1,453.00	87,761,200	
5192	三ツ星ベルト	45,200	4,435.00	200,462,000	
5195	バンドー化学	57,800	1,994.00	115,253,200	
3110	日東紡績	49,300	6,300.00	310,590,000	
5201	A G C	347,300	5,331.00	1,851,456,300	
5202	日本板硝子	185,800	430.00	79,894,000	貸付有価証券 7,000株
5204	石塚硝子	2,100	2,921.00	6,134,100	貸付有価証券 800株
5210	日本山村硝子	4,600	1,699.00	7,815,400	貸付有価証券 1,900株
5214	日本電気硝子	158,900	3,686.00	585,705,400	
5218	オハラ	18,500	1,349.00	24,956,500	
5232	住友大阪セメント	64,800	3,907.00	253,173,600	
5233	太平洋セメント	230,200	3,999.00	920,569,800	
5262	日本ヒューム	34,100	1,180.00	40,238,000	
5269	日本コンクリート工業	75,500	379.00	28,614,500	貸付有価証券 2,700株
5273	三谷セキサン	16,300	5,940.00	96,822,000	
5288	アジアパイルホールディングス	55,300	980.00	54,194,000	
5301	東海カーボン	359,300	943.30	338,927,690	
5302	日本カーボン	20,600	5,390.00	111,034,000	
5310	東洋炭素	27,400	6,680.00	183,032,000	
5331	ノリタケカンパニーリミテド	43,100	3,945.00	170,029,500	貸付有価証券 1,400株
5332	ＴＯＴＯ	257,000	3,903.00	1,003,071,000	貸付有価証券 9,100株
5333	日本碍子	452,900	2,041.00	924,368,900	
5334	日本特殊陶業	326,100	4,660.00	1,519,626,000	貸付有価証券 10,500株
5337	ダントーホールディングス	8,000	763.00	6,104,000	貸付有価証券 4,800株
5344	M A R U W A	14,400	38,350.00	552,240,000	貸付有価証券 600株
5351	品川リフラクトリーズ	47,900	1,985.00	95,081,500	
5352	黒崎播磨	31,800	2,835.00	90,153,000	
5357	ヨータイ	22,800	1,840.00	41,952,000	

5363	東京窯業	13,000	438.00	5,694,000	
5367	ニッカトー	5,400	569.00	3,072,600	貸付有価証券 2,000株
5384	フジミインコーポレーテッド	104,700	2,948.00	308,655,600	貸付有価証券 3,300株
5388	クニミネ工業	3,400	1,148.00	3,903,200	
5391	エーアンドエーマテリアル	2,200	1,364.00	3,000,800	
5393	ニチアス	98,500	4,570.00	450,145,000	
7943	ニチハ	48,800	3,380.00	164,944,000	
5401	日本製鉄	1,795,900	3,395.00	6,097,080,500	貸付有価証券 63,100株
5406	神戸製鋼所	805,600	1,980.00	1,595,088,000	貸付有価証券 28,400株
5408	中山製鋼所	91,600	951.00	87,111,600	
5410	合同製鐵	22,400	5,200.00	116,480,000	貸付有価証券 200株
5411	J F E ホールディングス	1,114,100	2,321.00	2,585,826,100	
5423	東京製鐵	112,600	1,663.00	187,253,800	貸付有価証券 4,000株
5440	共英製鋼	45,600	2,095.00	95,532,000	貸付有価証券 800株
5444	大和工業	75,500	7,894.00	595,997,000	貸付有価証券 500株
5445	東京鐵鋼	17,700	5,090.00	90,093,000	貸付有価証券 200株
5449	大阪製鐵	18,400	2,362.00	43,460,800	
5451	淀川製鋼所	45,500	5,490.00	249,795,000	貸付有価証券 500株
5461	中部鋼鈑	26,300	2,973.00	78,189,900	
5463	丸一鋼管	122,000	3,736.00	455,792,000	
5464	モリ工業	9,100	5,200.00	47,320,000	
5471	大同特殊鋼	252,300	1,487.50	375,296,250	貸付有価証券 500株
5476	日本高周波鋼業	4,700	473.00	2,223,100	貸付有価証券 2,000株
5480	日本冶金工業	29,300	4,550.00	133,315,000	
5481	山陽特殊製鋼	39,600	2,134.00	84,506,400	
5482	愛知製鋼	23,100	3,630.00	83,853,000	
5491	日本金属	3,200	780.00	2,496,000	貸付有価証券 1,000株
5541	大平洋金属	34,100	1,287.00	43,886,700	
5563	新日本電工	199,200	298.00	59,361,600	
5602	栗本鐵工所	18,600	4,780.00	88,908,000	
5603	虹技	1,500	1,164.00	1,746,000	貸付有価証券 600株
5612	日本鑄鉄管	1,400	1,648.00	2,307,200	
5632	三菱製鋼	29,700	1,514.00	44,965,800	
5658	日亜鋼業	12,600	325.00	4,095,000	

5659	日本精線	31,800	1,237.00	39,336,600	
5698	エンビプロ・ホールディングス	35,500	481.00	17,075,500	
6319	シンニッタン	15,700	233.00	3,658,100	貸付有価証券 6,100株
7305	新家工業	2,700	5,300.00	14,310,000	貸付有価証券 1,000株
5702	大紀アルミニウム工業所	50,700	1,313.00	66,569,100	
5703	日本軽金属ホールディングス	117,000	1,832.00	214,344,000	
5706	三井金属鉱業	116,600	5,084.00	592,794,400	
5707	東邦亜鉛	25,600	858.00	21,964,800	貸付有価証券 900株
5711	三菱マテリアル	286,400	2,992.50	857,052,000	
5713	住友金属鉱山	464,500	4,948.00	2,298,346,000	
5714	DOWAホールディングス	99,000	5,782.00	572,418,000	
5715	古河機械金属	52,900	1,861.00	98,446,900	
5721	エス・サイエンス	60,400	22.00	1,328,800	貸付有価証券 19,300株
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	69,500	2,807.00	195,086,500	貸付有価証券 4,600株
5727	東邦チタニウム	82,800	1,430.00	118,404,000	貸付有価証券 7,800株
5741	U A C J	56,100	3,970.00	222,717,000	
5757	C K サンエツ	9,700	3,845.00	37,296,500	
5801	古河電気工業	133,400	4,055.00	540,937,000	
5802	住友電気工業	1,498,500	2,512.50	3,764,981,250	貸付有価証券 12,700株
5803	フジクラ	472,500	3,111.00	1,469,947,500	
5805	S W C C	44,800	4,835.00	216,608,000	
5809	タツタ電線	71,300	728.00	51,906,400	貸付有価証券 8,600株
5819	カナレ電気	2,000	1,600.00	3,200,000	
5821	平河ヒューテック	25,600	1,508.00	38,604,800	
5851	リョービ	42,700	2,344.00	100,088,800	
5852	アーレスティ	13,700	737.00	10,096,900	貸付有価証券 5,700株
5857	A R E ホールディングス	150,400	2,079.00	312,681,600	
3421	稲葉製作所	22,200	1,931.00	42,868,200	
3431	宮地エンジニアリンググループ	20,100	4,765.00	95,776,500	
3433	トーカロ	115,500	2,013.00	232,501,500	
3434	アルファＣｏ	4,600	1,420.00	6,532,000	
3436	S U M C O	711,800	2,338.00	1,664,188,400	
3443	川田テクノロジーズ	28,400	2,755.00	78,242,000	
3445	R S T e c h n o l o g i e s	26,800	3,440.00	92,192,000	
3446	ジェイテックコーポレーション	1,600	1,618.00	2,588,800	貸付有価証券 500株
3447	信和	7,900	764.00	6,035,600	

5901	東洋製罐グループホールディングス	229,800	2,542.00	584,151,600	貸付有価証券 500株
5902	ホッカンホールディングス	19,600	1,788.00	35,044,800	貸付有価証券 700株
5909	コロナ	22,400	997.00	22,332,800	
5911	横河ブリッジホールディングス	62,700	2,686.00	168,412,200	
5915	駒井ハルテック	2,200	1,856.00	4,083,200	貸付有価証券 800株
5923	高田機工	900	3,735.00	3,361,500	貸付有価証券 100株
5929	三和ホールディングス	399,000	2,923.50	1,166,476,500	貸付有価証券 9,800株
5930	文化シャッター	104,800	1,712.00	179,417,600	
5932	三協立山	50,400	815.00	41,076,000	貸付有価証券 1,700株
5933	アルインコ	30,500	1,103.00	33,641,500	
5936	東洋シャッター	2,800	930.00	2,604,000	
5938	ＬＩＸＩＬ	625,500	1,718.50	1,074,921,750	
5942	日本フィルコン	8,100	528.00	4,276,800	
5943	ノーリツ	63,400	1,794.00	113,739,600	
5946	長府製作所	39,800	2,216.00	88,196,800	
5947	リンナイ	191,700	3,745.00	717,916,500	
5951	ダイニチ工業	6,200	694.00	4,302,800	
5957	日東精工	58,100	589.00	34,220,900	
5958	三洋工業	1,400	3,240.00	4,536,000	
5959	岡部	71,600	782.00	55,991,200	貸付有価証券 2,600株
5970	ジーテクト	51,000	1,959.00	99,909,000	
5975	東プレ	70,600	2,144.00	151,366,400	
5976	高周波熱錬	59,300	1,092.00	64,755,600	貸付有価証券 4,400株
5981	東京製綱	26,000	1,376.00	35,776,000	貸付有価証券 500株
5985	サンコール	40,100	470.00	18,847,000	
5986	モリテック スチール	10,500	231.00	2,425,500	貸付有価証券 3,400株
5988	パイオラックス	49,700	2,325.00	115,552,500	貸付有価証券 300株
5989	エイチワン	41,200	1,012.00	41,694,400	
5991	日本発條	354,400	1,603.00	568,103,200	
5992	中央発條	29,700	1,251.00	37,154,700	
5998	アドバネクス	1,600	1,111.00	1,777,600	貸付有価証券 600株
7989	立川ブラインド工業	18,100	1,365.00	24,706,500	
8155	三益半導体工業	36,100	3,695.00	133,389,500	
1909	日本ドライケミカル	2,800	2,682.00	7,509,600	

5631	日本製鋼所	108,000	4,227.00	456,516,000	貸付有価証券 200株
6005	三浦工業	163,700	3,099.00	507,306,300	
6013	タクマ	132,600	1,670.00	221,442,000	
6101	ツガミ	87,100	1,552.00	135,179,200	
6103	オークマ	34,300	6,933.00	237,801,900	貸付有価証券 1,400株
6104	芝浦機械	39,200	3,755.00	147,196,000	
6113	アマダ	594,300	1,755.00	1,042,996,500	
6118	アイダエンジニアリング	90,700	904.00	81,992,800	
6134	F U J I	184,600	2,518.00	464,822,800	貸付有価証券 2,400株
6135	牧野フライス製作所	43,400	6,660.00	289,044,000	
6136	オーエスジー	172,800	1,973.50	341,020,800	貸付有価証券 6,100株
6138	ダイジェット工業	1,200	862.00	1,034,400	
6140	旭ダイヤモンド工業	90,400	973.00	87,959,200	
6141	D M G 森精機	267,900	4,306.00	1,153,577,400	貸付有価証券 700株
6143	ソディック	95,500	731.00	69,810,500	
6146	ディスコ	188,800	59,700.00	11,271,360,000	
6151	日東工器	19,000	2,404.00	45,676,000	
6157	日進工具	36,300	1,002.00	36,372,600	
6165	パンチ工業	11,700	480.00	5,616,000	
6167	富士ダイス	26,100	841.00	21,950,100	貸付有価証券 200株
6203	豊和工業	6,600	834.00	5,504,400	貸付有価証券 1,000株
6208	石川製作所	3,100	1,667.00	5,167,700	貸付有価証券 1,000株
6209	リケン N P R	42,500	2,827.00	120,147,500	
6210	東洋機械金属	8,800	730.00	6,424,000	
6217	津田駒工業	2,200	405.00	891,000	貸付有価証券 800株
6218	エンシュウ	2,900	706.00	2,047,400	貸付有価証券 1,000株
6222	島精機製作所	62,400	1,675.00	104,520,000	貸付有価証券 100株
6235	オプトラ	64,400	2,013.00	129,637,200	
6236	N C ホールディングス	2,900	2,206.00	6,397,400	貸付有価証券 1,300株
6237	イワキポンプ	26,100	2,832.00	73,915,200	
6238	フリー	37,000	1,067.00	39,479,000	
6240	ヤマシンフィルタ	93,200	406.00	37,839,200	
6247	日阪製作所	42,800	1,067.00	45,667,600	
6250	やまびこ	64,000	2,237.00	143,168,000	

6254	野村マイクロ・サイエンス	53,100	4,245.00	225,409,500	貸付有価証券 4,000株
6258	平田機工	18,700	6,630.00	123,981,000	
6262	P E G A S U S	43,300	590.00	25,547,000	
6264	マルマエ	17,100	2,045.00	34,969,500	貸付有価証券 1,800株
6266	タツモ	23,700	3,490.00	82,713,000	貸付有価証券 2,000株
6268	ナブテスコ	246,100	2,778.00	683,665,800	
6269	三井海洋開発	49,600	2,959.00	146,766,400	
6272	レオン自動機	45,300	1,703.00	77,145,900	
6273	S M C	117,400	76,260.00	8,952,924,000	
6277	ホソカワミクロン	27,400	4,205.00	115,217,000	
6278	ユニオンツール	17,200	6,000.00	103,200,000	
6279	瑞光	28,200	1,083.00	30,540,600	貸付有価証券 1,200株
6282	オイレス工業	53,200	2,366.00	125,871,200	貸付有価証券 400株
6284	日精エー・エス・ピー機械	13,400	5,480.00	73,432,000	
6287	サトーホールディングス	55,800	2,139.00	119,356,200	
6289	技研製作所	36,800	1,953.00	71,870,400	貸付有価証券 100株
6291	日本エアーテック	18,300	1,209.00	22,124,700	貸付有価証券 600株
6292	カワタ	3,800	897.00	3,408,600	貸付有価証券 1,300株
6293	日精樹脂工業	29,100	1,080.00	31,428,000	貸付有価証券 400株
6294	オカダアイヨン	4,100	2,525.00	10,352,500	
6298	ワイエイシイホールディングス	16,600	2,454.00	40,736,400	
6301	小松製作所	1,838,000	4,644.00	8,535,672,000	
6302	住友重機械工業	232,000	4,261.00	988,552,000	貸付有価証券 1,900株
6305	日立建機	156,200	4,270.00	666,974,000	
6306	日工	58,100	783.00	45,492,300	
6309	巴工業	15,300	4,720.00	72,216,000	
6310	井関農機	36,700	1,068.00	39,195,600	貸付有価証券 1,300株
6315	T O W A	43,600	10,810.00	471,316,000	
6316	丸山製作所	2,100	2,439.00	5,121,900	
6317	北川鉄工所	15,400	1,526.00	23,500,400	
6323	ローツェ	20,500	30,150.00	618,075,000	貸付有価証券 800株
6325	タカキタ	4,000	460.00	1,840,000	貸付有価証券 1,600株
6326	クボタ	2,050,100	2,295.00	4,704,979,500	
6328	荏原実業	20,700	4,055.00	83,938,500	

6331	三菱化工機	13,800	4,340.00	59,892,000	
6332	月島ホールディングス	53,000	1,459.00	77,327,000	
6333	帝国電機製作所	26,800	2,506.00	67,160,800	
6335	東京機械製作所	3,200	407.00	1,302,400	貸付有価証券 1,000株
6339	新東工業	79,200	1,141.00	90,367,200	
6340	澁谷工業	36,800	3,740.00	137,632,000	
6345	アイチ コーポレーション	54,100	1,244.00	67,300,400	
6349	小森コーポレーション	96,600	1,366.00	131,955,600	
6351	鶴見製作所	29,900	4,745.00	141,875,500	貸付有価証券 1,000株
6356	日本ギア工業	4,600	588.00	2,704,800	貸付有価証券 1,300株
6358	酒井重工業	6,900	5,900.00	40,710,000	
6361	荏原製作所	160,900	11,975.00	1,926,777,500	
6362	石井鐵工所	1,400	2,860.00	4,004,000	
6363	西島製作所	33,700	3,175.00	106,997,500	
6364	北越工業	39,400	2,445.00	96,333,000	
6367	ダイキン工業	468,100	23,020.00	10,775,662,000	
6368	オルガノ	47,100	8,300.00	390,930,000	
6369	トーヨーカネツ	13,300	3,950.00	52,535,000	
6370	栗田工業	219,300	6,776.00	1,485,976,800	貸付有価証券 400株
6371	椿本チエイン	53,800	6,050.00	325,490,000	
6373	大同工業	5,400	968.00	5,227,200	貸付有価証券 1,300株
6378	木村化工機	29,900	723.00	21,617,700	
6381	アネスト岩田	60,600	1,695.00	102,717,000	
6383	ダイフク	661,800	2,936.50	1,943,375,700	貸付有価証券 21,400株
6387	サムコ	9,300	3,975.00	36,967,500	貸付有価証券 1,200株
6390	加藤製作所	6,200	1,258.00	7,799,600	
6393	油研工業	2,000	2,397.00	4,794,000	貸付有価証券 300株
6395	タダノ	225,600	1,134.50	255,943,200	
6406	フジテック	91,600	4,431.00	405,879,600	
6407	C K D	108,500	3,120.00	338,520,000	
6412	平和	115,900	2,059.00	238,638,100	
6413	理想科学工業	31,400	3,295.00	103,463,000	貸付有価証券 300株
6417	S A N K Y O	377,500	1,704.50	643,448,750	
6418	日本金銭機械	47,400	1,325.00	62,805,000	貸付有価証券 4,900株
6419	マースグループホールディングス	19,800	3,705.00	73,359,000	
6420	フクシマガリレイ	25,600	6,540.00	167,424,000	

6428	オーイズミ	4,600	364.00	1,674,400	貸付有価証券 1,900株
6430	ダイコク電機	19,300	3,980.00	76,814,000	貸付有価証券 2,100株
6432	竹内製作所	71,100	5,680.00	403,848,000	
6436	アマノ	111,300	4,089.00	455,105,700	貸付有価証券 4,000株
6440	J U K I	60,700	521.00	31,624,700	
6444	サンデン	18,200	167.00	3,039,400	貸付有価証券 7,600株
6445	ジャノメ	39,700	696.00	27,631,200	
6454	マックス	55,200	3,795.00	209,484,000	
6457	グローリー	94,100	2,807.00	264,138,700	
6458	新晃工業	39,500	4,005.00	158,197,500	
6459	大和冷機工業	60,100	1,568.00	94,236,800	
6460	セガサミーホールディングス	350,200	2,373.50	831,199,700	貸付有価証券 1,200株
6463	T P R	49,800	2,584.00	128,683,200	
6464	ツバキ・ナカシマ	78,500	803.00	63,035,500	貸付有価証券 6,500株
6465	ホシザキ	231,400	5,109.00	1,182,222,600	
6470	大豊工業	33,900	820.00	27,798,000	
6471	日本精工	725,900	784.90	569,758,910	
6472	N T N	850,400	314.70	267,620,880	貸付有価証券 27,200株
6473	ジェイテクト	348,900	1,130.50	394,431,450	
6474	不二越	28,900	3,510.00	101,439,000	貸付有価証券 1,100株
6480	日本トムソン	106,700	613.00	65,407,100	
6481	T H K	226,200	2,895.00	654,849,000	貸付有価証券 300株
6482	ユーシン精機	31,000	765.00	23,715,000	
6485	前澤給装工業	28,100	1,335.00	37,513,500	貸付有価証券 100株
6486	イーグル工業	43,300	1,903.00	82,399,900	
6489	前澤工業	7,000	1,464.00	10,248,000	
6490	日本ビラー工業	36,400	5,300.00	192,920,000	
6498	キッツ	131,200	1,137.00	149,174,400	
6586	マキタ	447,200	4,386.00	1,961,419,200	
7003	三井 E & S	194,600	1,449.00	281,975,400	貸付有価証券 22,600株
7004	日立造船	346,000	1,046.00	361,916,000	
7011	三菱重工業	6,857,500	1,650.00	11,314,875,000	
7013	I H I	292,000	4,477.00	1,307,284,000	
7022	サノヤスホールディングス	15,600	208.00	3,244,800	貸付有価証券 5,400株
7718	スター精密	72,100	2,110.00	152,131,000	

3105	日清紡ホールディングス	294,800	1,117.00	329,291,600	
4062	イビデン	204,500	6,565.00	1,342,542,500	貸付有価証券 1,700株
4902	コニカミノルタ	875,800	444.50	389,293,100	
6448	ブラザー工業	523,900	2,827.50	1,481,327,250	貸付有価証券 200株
6479	ミネベアミツミ	682,100	3,300.00	2,250,930,000	貸付有価証券 14,000株
6501	日立製作所	1,884,600	17,525.00	33,027,615,000	
6503	三菱電機	4,364,500	2,539.00	11,081,465,500	
6504	富士電機	238,400	9,098.00	2,168,963,200	
6505	東洋電機製造	4,000	1,095.00	4,380,000	
6506	安川電機	425,900	5,755.00	2,451,054,500	貸付有価証券 9,500株
6507	シンフォニアテクノロジー	43,300	3,275.00	141,807,500	
6508	明電舎	72,700	3,765.00	273,715,500	
6513	オリジン	2,700	1,330.00	3,591,000	
6516	山洋電気	17,000	7,090.00	120,530,000	
6517	デンヨー	29,900	2,911.00	87,038,900	貸付有価証券 700株
6523	ＰＨＣホールディングス	73,300	1,164.00	85,321,200	貸付有価証券 8,000株
6525	ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	203,500	4,560.00	927,960,000	
6526	ソシオネクスト	285,600	3,871.00	1,105,557,600	貸付有価証券 9,500株
6588	東芝テック	50,200	3,475.00	174,445,000	
6590	芝浦メカトロニクス	22,300	7,930.00	176,839,000	貸付有価証券 2,400株
6592	マブチモーター	192,800	2,462.00	474,673,600	
6594	ニデック	865,700	7,291.00	6,311,818,700	
6615	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	24,600	378.00	9,298,800	
6616	トレックス・セミコンダクター	20,100	1,908.00	38,350,800	貸付有価証券 900株
6617	東光高岳	23,600	2,057.00	48,545,200	
6619	ダブル・スコープ	112,300	528.00	59,294,400	貸付有価証券 6,900株
6622	ダイヘン	37,200	8,270.00	307,644,000	
6630	ヤーマン	76,200	833.00	63,474,600	貸付有価証券 6,400株
6632	ＪＶＣケンウッド	309,500	926.00	286,597,000	
6638	ミマキエンジニアリング	37,200	1,879.00	69,898,800	
6640	Ｉ－ＰＥＸ	27,200	2,004.00	54,508,800	貸付有価証券 1,000株
6644	大崎電気工業	85,800	690.00	59,202,000	
6645	オムロン	299,400	5,621.00	1,682,927,400	
6651	日東工業	52,900	3,440.00	181,976,000	
6652	ＩＤＥＣ	57,900	2,928.00	169,531,200	

6653	正興電機製作所	4,200	1,465.00	6,153,000	
6654	不二電機工業	2,400	1,142.00	2,740,800	貸付有価証券 700株
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	153,000	3,303.00	505,359,000	
6675	サクサホールディングス	2,800	2,720.00	7,616,000	
6676	メルコホールディングス	12,300	3,515.00	43,234,500	
6678	テクノメディカ	9,500	1,810.00	17,195,000	
6699	ダイヤモンドエレクトリックホールディング	14,600	714.00	10,424,400	貸付有価証券 1,300株
6701	日本電気	515,000	13,005.00	6,697,575,000	
6702	富士通	3,608,400	2,426.50	8,755,782,600	
6703	沖電気工業	177,300	1,034.00	183,328,200	
6704	岩崎通信機	5,500	1,480.00	8,140,000	貸付有価証券 400株
6706	電気興業	15,800	2,120.00	33,496,000	貸付有価証券 300株
6707	サンケン電気	36,400	7,026.00	255,746,400	
6715	ナカヨ	1,900	1,185.00	2,251,500	
6718	アイホン	21,200	3,050.00	64,660,000	貸付有価証券 500株
6723	ルネサスエレクトロニクス	2,444,300	2,978.00	7,279,125,400	貸付有価証券 89,900株
6724	セイコーエプソン	503,100	2,490.50	1,252,970,550	
6727	ワコム	286,900	727.00	208,576,300	貸付有価証券 2,300株
6728	アルバック	86,000	10,495.00	902,570,000	
6730	アクセル	17,600	1,488.00	26,188,800	
6737	E I Z O	28,700	4,925.00	141,347,500	
6740	ジャパンディスプレイ	1,690,200	16.00	27,043,200	貸付有価証券 126,800株
6741	日本信号	89,300	1,034.00	92,336,200	
6742	京三製作所	82,100	692.00	56,813,200	
6744	能美防災	53,000	2,370.00	125,610,000	
6745	ホーチキ	29,300	2,310.00	67,683,000	
6748	星和電機	5,000	568.00	2,840,000	
6750	エレコム	93,700	1,653.00	154,886,100	
6752	パナソニック ホールディングス	4,632,300	1,323.00	6,128,532,900	貸付有価証券 162,800株
6753	シャープ	661,000	979.10	647,185,100	貸付有価証券 50,900株
6754	アンリツ	276,200	1,198.50	331,025,700	
6755	富士通ゼネラル	111,200	2,158.00	239,969,600	
6758	ソニーグループ	2,718,900	13,170.00	35,807,913,000	
6762	T D K	620,900	9,560.00	5,935,804,000	
6763	帝国通信工業	17,200	2,080.00	35,776,000	貸付有価証券 600株

6768	タムラ製作所	156,200	712.00	111,214,400	貸付有価証券 14,900株
6770	アルプスアルパイン	350,200	1,545.50	541,234,100	
6771	池上通信機	3,800	819.00	3,112,200	
6779	日本電波工業	47,000	1,348.00	63,356,000	
6785	鈴木	20,900	1,471.00	30,743,900	
6787	メイコー	38,900	7,010.00	272,689,000	
6788	日本トリム	8,800	3,480.00	30,624,000	
6789	ローランド ディー．ジー．	8,900	5,340.00	47,526,000	
6794	フォスター電機	29,000	1,782.00	51,678,000	
6798	S M K	10,500	2,607.00	27,373,500	貸付有価証券 400株
6800	ヨコオ	34,600	2,119.00	73,317,400	
6803	ティアック	20,000	97.00	1,940,000	貸付有価証券 3,200株
6804	ホシデン	89,200	2,140.00	190,888,000	貸付有価証券 3,900株
6806	ヒロセ電機	57,900	17,770.00	1,028,883,000	
6807	日本航空電子工業	93,800	2,555.00	239,659,000	
6809	T O A	44,600	1,110.00	49,506,000	
6810	マクセル	86,600	1,823.00	157,871,800	
6814	古野電気	50,900	2,076.00	105,668,400	貸付有価証券 1,300株
6817	スミダコーポレーション	52,500	1,170.00	61,425,000	
6820	アイコム	15,100	3,145.00	47,489,500	
6823	リオン	16,100	2,727.00	43,904,700	
6841	横河電機	429,000	3,839.00	1,646,931,000	
6844	新電元工業	15,000	2,974.00	44,610,000	
6845	アズビル	267,100	4,398.00	1,174,705,800	
6848	東亜ディーケーケー	5,600	852.00	4,771,200	貸付有価証券 2,200株
6849	日本光電工業	166,500	4,708.00	783,882,000	
6850	チノー	16,100	2,598.00	41,827,800	
6853	共和電業	11,200	453.00	5,073,600	貸付有価証券 1,200株
6855	日本電子材料	23,900	3,455.00	82,574,500	
6856	堀場製作所	74,100	12,035.00	891,793,500	
6857	アドバンテスト	1,112,400	5,814.00	6,467,493,600	
6858	小野測器	4,700	701.00	3,294,700	貸付有価証券 300株
6859	エスベック	31,100	3,200.00	99,520,000	
6861	キーエンス	388,400	70,570.00	27,409,388,000	
6866	日置電機	18,300	6,760.00	123,708,000	貸付有価証券 100株
6869	シスメックス	1,005,200	2,556.50	2,569,793,800	貸付有価証券 31,300株

6871	日本マイクロニクス	69,700	6,550.00	456,535,000	
6875	メガチップス	30,700	4,175.00	128,172,500	
6877	O B A R A G R O U P	24,200	4,170.00	100,914,000	
6901	澤藤電機	1,400	1,249.00	1,748,600	貸付有価証券 100株
6904	原田工業	5,400	580.00	3,132,000	貸付有価証券 2,100株
6905	コーセル	41,500	1,271.00	52,746,500	貸付有価証券 700株
6908	イリソ電子工業	35,700	3,090.00	110,313,000	
6914	オブテックスグループ	71,200	1,676.00	119,331,200	
6915	千代田インテグレ	15,200	3,150.00	47,880,000	
6920	レーザーテック	178,000	35,260.00	6,276,280,000	
6923	スタンレー電気	248,600	2,889.00	718,205,400	貸付有価証券 3,000株
6925	ウシオ電機	171,700	2,079.00	356,964,300	貸付有価証券 1,800株
6926	岡谷電機産業	9,200	249.00	2,290,800	貸付有価証券 3,500株
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	11,800	860.00	10,148,000	貸付有価証券 6,500株
6928	エノモト	3,400	1,544.00	5,249,600	
6929	日本セラミック	31,600	2,589.00	81,812,400	
6932	遠藤照明	5,400	1,546.00	8,348,400	
6937	古河電池	28,600	1,335.00	38,181,000	
6941	山一電機	34,900	3,200.00	111,680,000	
6947	図研	32,300	4,135.00	133,560,500	
6951	日本電子	97,300	6,760.00	657,748,000	
6952	カシオ計算機	280,500	1,211.50	339,825,750	貸付有価証券 2,300株
6954	ファナック	1,893,300	4,323.00	8,184,735,900	
6958	日本シイエムケイ	91,000	609.00	55,419,000	
6961	エンプラス	11,300	7,950.00	89,835,000	貸付有価証券 1,100株
6962	大真空	57,800	733.00	42,367,400	貸付有価証券 1,700株
6963	ローム	717,800	2,176.00	1,561,932,800	
6965	浜松ホトニクス	311,600	4,495.00	1,400,642,000	貸付有価証券 1,000株
6966	三井ハイテック	34,400	6,324.00	217,545,600	
6967	新光電気工業	137,400	5,645.00	775,623,000	
6971	京セラ	2,412,400	1,877.50	4,529,281,000	
6976	太陽誘電	189,100	3,966.00	749,970,600	
6981	村田製作所	3,532,400	3,300.00	11,656,920,000	
6986	双葉電子工業	73,900	653.00	48,256,700	
6989	北陸電気工業	4,500	1,433.00	6,448,500	

6996	ニチコン	101,900	1,205.00	122,789,500	
6997	日本ケミコン	41,300	1,680.00	69,384,000	貸付有価証券 200株
6999	K O A	58,800	1,514.00	89,023,200	貸付有価証券 1,200株
7244	市光工業	69,900	556.00	38,864,400	
7276	小糸製作所	402,200	2,187.50	879,812,500	貸付有価証券 14,000株
7280	ミツバ	72,800	1,125.00	81,900,000	
7735	S C R E E Nホールディングス	132,700	14,960.00	1,985,192,000	
7739	キヤノン電子	42,900	2,286.00	98,069,400	
7751	キヤノン	1,936,500	4,435.00	8,588,377,500	
7752	リコー	973,500	1,350.00	1,314,225,000	
7965	象印マホービン	105,400	1,535.00	161,789,000	
7999	M U T O Hホールディングス	1,500	2,432.00	3,648,000	
8035	東京エレクトロン	821,700	34,400.00	28,266,480,000	
9880	イノテック	25,900	1,753.00	45,402,700	
3116	トヨタ紡織	163,500	2,153.50	352,097,250	
3526	芦森工業	2,400	2,417.00	5,800,800	貸付有価証券 200株
5949	ユニプレス	69,700	1,362.00	94,931,400	貸付有価証券 5,500株
6201	豊田自動織機	331,200	13,630.00	4,514,256,000	
6455	モリタホールディングス	68,100	1,817.00	123,737,700	
6584	三櫻工業	59,300	1,016.00	60,248,800	貸付有価証券 2,100株
6902	デンソー	3,203,200	2,482.50	7,951,944,000	
6995	東海理化電機製作所	109,500	2,172.00	237,834,000	
7012	川崎重工業	316,900	6,032.00	1,911,540,800	貸付有価証券 1,600株
7014	名村造船所	108,700	2,297.00	249,683,900	貸付有価証券 14,200株
7102	日本車輛製造	12,800	2,474.00	31,667,200	
7105	三菱ロジスネクスト	62,000	1,476.00	91,512,000	
7122	近畿車輛	1,600	1,979.00	3,166,400	
7201	日産自動車	5,108,500	547.50	2,796,903,750	
7202	いすゞ自動車	1,090,200	2,096.00	2,285,059,200	
7203	トヨタ自動車	21,318,900	3,296.00	70,267,094,400	
7205	日野自動車	584,000	441.70	257,952,800	
7211	三菱自動車工業	1,514,600	459.60	696,110,160	貸付有価証券 53,200株
7212	エフテック	8,400	629.00	5,283,600	
7213	レシップホールディングス	5,200	662.00	3,442,400	貸付有価証券 1,600株
7214	G M B	2,300	1,604.00	3,689,200	貸付有価証券 1,000株

7215	ファルテック	2,200	548.00	1,205,600	貸付有価証券 300株
7220	武蔵精密工業	94,900	1,929.00	183,062,100	
7222	日産車体	39,300	982.00	38,592,600	貸付有価証券 3,800株
7224	新明和工業	111,800	1,419.00	158,644,200	
7226	極東開発工業	64,100	2,497.00	160,057,700	
7231	トピー工業	31,500	2,499.00	78,718,500	
7236	ティラド	8,600	3,655.00	31,433,000	
7238	曙ブレーキ工業	236,900	164.00	38,851,600	貸付有価証券 8,400株
7239	タチエス	71,600	1,950.00	139,620,000	貸付有価証券 4,100株
7240	ＮＯＫ	150,800	2,145.50	323,541,400	
7241	フタバ産業	104,000	886.00	92,144,000	
7242	カヤバ	36,600	5,370.00	196,542,000	
7245	大同メタル工業	75,900	642.00	48,727,800	
7246	プレス工業	155,100	646.00	100,194,600	
7247	ミクニ	15,200	407.00	6,186,400	貸付有価証券 1,100株
7250	太平洋工業	89,000	1,522.00	135,458,000	
7256	河西工業	16,900	196.00	3,312,400	貸付有価証券 6,000株
7259	アイシン	299,500	5,273.00	1,579,263,500	
7261	マツダ	1,284,200	1,578.50	2,027,109,700	貸付有価証券 500株
7266	今仙電機製作所	7,600	616.00	4,681,600	
7267	本田技研工業	9,199,200	1,730.00	15,914,616,000	
7269	スズキ	2,852,400	1,823.00	5,199,925,200	貸付有価証券 100,400株
7270	ＳＵＢＡＲＵ	1,204,000	3,448.00	4,151,392,000	
7271	安永	5,300	588.00	3,116,400	
7272	ヤマハ発動機	1,678,000	1,512.50	2,537,975,000	
7277	ＴＢＫ	13,000	304.00	3,952,000	
7278	エクセディ	63,500	3,050.00	193,675,000	
7282	豊田合成	111,200	2,859.00	317,920,800	貸付有価証券 300株
7283	愛三工業	64,400	1,383.00	89,065,200	
7284	盟和産業	1,700	1,025.00	1,742,500	
7291	日本プラスト	9,800	436.00	4,272,800	
7294	ヨロズ	36,400	1,168.00	42,515,200	
7296	エフ・シー・シー	68,800	2,353.00	161,886,400	
7309	シマノ	156,500	24,990.00	3,910,935,000	
7313	テイ・エス テック	138,200	1,923.00	265,758,600	
7408	ジャムコ	21,100	1,493.00	31,502,300	貸付有価証券 2,200株

4543	テルモ	2,164,300	2,599.50	5,626,097,850	
5187	クリエートメディック	3,900	990.00	3,861,000	
6376	日機装	90,400	1,161.00	104,954,400	
7600	日本エム・ディ・エム	30,800	677.00	20,851,600	
7701	島津製作所	515,800	4,020.00	2,073,516,000	貸付有価証券 15,900株
7702	J M S	35,900	540.00	19,386,000	
7709	クボテック	2,900	216.00	626,400	貸付有価証券 1,100株
7715	長野計器	28,200	2,976.00	83,923,200	貸付有価証券 900株
7717	ブイ・テクノロジー	20,400	3,095.00	63,138,000	貸付有価証券 600株
7721	東京計器	29,800	3,290.00	98,042,000	
7723	愛知時計電機	16,800	2,320.00	38,976,000	
7725	インターアクション	23,400	1,657.00	38,773,800	
7727	オーバル	10,600	465.00	4,929,000	
7729	東京精密	79,500	12,425.00	987,787,500	貸付有価証券 500株
7730	マニー	155,300	1,912.50	297,011,250	
7731	ニコン	561,300	1,615.00	906,499,500	貸付有価証券 900株
7732	トプコン	188,700	1,772.00	334,376,400	
7733	オリンパス	2,222,900	2,579.00	5,732,859,100	
7734	理研計器	55,000	3,920.00	215,600,000	
7740	タムロン	23,800	8,400.00	199,920,000	
7741	H O Y A	764,300	18,805.00	14,372,661,500	
7743	シード	6,000	560.00	3,360,000	貸付有価証券 300株
7744	ノーリツ鋼機	36,800	4,355.00	160,264,000	
7745	A & Dホロンホールディングス	56,600	2,787.00	157,744,200	
7747	朝日インテック	473,300	2,217.00	1,049,306,100	
7762	シチズン時計	357,200	1,034.00	369,344,800	
7769	リズム	2,700	3,900.00	10,530,000	
7775	大研医器	10,400	549.00	5,709,600	貸付有価証券 3,100株
7780	メニコン	133,500	1,327.50	177,221,250	
7782	シンシア	1,100	455.00	500,500	
7979	松風	17,500	4,635.00	81,112,500	貸付有価証券 700株
8050	セイコーグループ	54,100	4,820.00	260,762,000	
8086	ニプロ	323,600	1,264.00	409,030,400	
7795	K Y O R I T S U	18,000	169.00	3,042,000	
7811	中本パックス	3,800	1,649.00	6,266,200	貸付有価証券 1,100株
7817	パラマウントベッドホールディングス	80,700	2,770.00	223,539,000	

7818	トランザクション	25,600	1,974.00	50,534,400	貸付有価証券 800株
7819	粧美堂	3,300	555.00	1,831,500	
7820	ニホンフラッシュ	36,400	918.00	33,415,200	
7821	前田工織	34,600	3,310.00	114,526,000	
7822	永大産業	14,300	248.00	3,546,400	
7823	アートネイチャー	35,000	847.00	29,645,000	
7826	フルヤ金属	12,300	12,890.00	158,547,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	1,063,700	3,084.00	3,280,450,800	
7833	アイフィスジャパン	3,400	617.00	2,097,800	
7839	S H O E I	109,200	2,029.00	221,566,800	
7840	フランスベッドホールディングス	50,200	1,223.00	61,394,600	
7846	パイロットコーポレーション	54,600	4,253.00	232,213,800	
7856	萩原工業	26,000	1,558.00	40,508,000	貸付有価証券 1,700株
7864	フジシールインターナショナル	78,600	2,490.00	195,714,000	
7867	タカラトミー	176,700	3,106.00	548,830,200	貸付有価証券 400株
7868	広済堂ホールディングス	112,900	595.00	67,175,500	
7872	エステールホールディングス	2,900	655.00	1,899,500	
7885	タカノ	4,500	913.00	4,108,500	
7893	プロネクサス	40,200	1,312.00	52,742,400	
7897	ホクシン	9,300	120.00	1,116,000	貸付有価証券 4,600株
7898	ウッドワン	4,100	947.00	3,882,700	貸付有価証券 1,700株
7911	T O P P A Nホールディングス	477,200	4,360.00	2,080,592,000	
7912	大日本印刷	402,500	5,273.00	2,122,382,500	貸付有価証券 13,100株
7914	共同印刷	10,900	3,930.00	42,837,000	
7915	N I S S H A	66,500	2,045.00	135,992,500	
7916	光村印刷	900	1,609.00	1,448,100	貸付有価証券 400株
7921	T A K A R A & C O M P A N Y	22,900	3,135.00	71,791,500	
7936	アシックス	330,800	9,747.00	3,224,307,600	
7937	ツツミ	9,100	2,187.00	19,901,700	
7944	ローランド	28,600	4,175.00	119,405,000	
7949	小松ウオール工業	15,800	3,295.00	52,061,000	
7951	ヤマハ	244,700	3,735.00	913,954,500	
7952	河合楽器製作所	11,800	3,245.00	38,291,000	
7955	クリナップ	38,100	729.00	27,774,900	
7956	ビジョン	247,300	1,546.00	382,325,800	
7962	キングジム	34,300	878.00	30,115,400	貸付有価証券 1,500株
7966	リンテック	77,900	3,325.00	259,017,500	

7972	イトーキ	74,000	1,665.00	123,210,000	
7974	任天堂	2,451,200	8,632.00	21,158,758,400	
7976	三菱鉛筆	55,100	2,468.00	135,986,800	
7981	タカスタンダード	79,400	1,715.00	136,171,000	
7984	コクヨ	158,800	2,706.50	429,792,200	
7987	ナカバヤシ	41,800	548.00	22,906,400	
7990	グローブライド	34,800	2,182.00	75,933,600	貸付有価証券 1,200株
7994	オカムラ	116,900	2,187.00	255,660,300	
8022	美津濃	38,600	8,070.00	311,502,000	
9501	東京電力ホールディングス	3,499,800	863.80	3,023,127,240	
9502	中部電力	1,430,700	1,913.00	2,736,929,100	
9503	関西電力	1,499,200	2,700.00	4,047,840,000	
9504	中国電力	674,500	1,084.00	731,158,000	
9505	北陸電力	397,000	1,029.00	408,513,000	貸付有価証券 100株
9506	東北電力	1,022,200	1,441.00	1,472,990,200	貸付有価証券 1,100株
9507	四国電力	361,600	1,384.00	500,454,400	貸付有価証券 800株
9508	九州電力	895,000	1,660.00	1,485,700,000	貸付有価証券 6,400株
9509	北海道電力	375,100	1,267.00	475,251,700	貸付有価証券 6,500株
9511	沖縄電力	99,200	1,115.00	110,608,000	
9513	電源開発	318,900	2,516.50	802,511,850	
9514	エフオン	28,300	419.00	11,857,700	
9517	イーレックス	69,100	713.00	49,268,300	
9519	レノバ	103,600	1,021.00	105,775,600	貸付有価証券 7,300株
9531	東京瓦斯	755,800	3,516.00	2,657,392,800	貸付有価証券 21,400株
9532	大阪瓦斯	773,700	3,500.00	2,707,950,000	貸付有価証券 18,100株
9533	東邦瓦斯	168,100	3,948.00	663,658,800	
9534	北海道瓦斯	23,200	3,515.00	81,548,000	
9535	広島ガス	82,000	393.00	32,226,000	
9536	西部ガスホールディングス	40,500	2,015.00	81,607,500	
9543	静岡ガス	77,400	960.00	74,304,000	
9551	メタウォーター	46,500	1,950.00	90,675,000	
2384	S B S ホールディングス	34,600	2,689.00	93,039,400	
9001	東武鉄道	426,500	2,711.00	1,156,241,500	貸付有価証券 400株
9003	相鉄ホールディングス	138,900	2,444.00	339,471,600	
9005	東急	1,088,700	1,795.50	1,954,760,850	貸付有価証券 10,900株

9006	京浜急行電鉄	480,500	1,170.00	562,185,000	貸付有価証券 2,600株
9007	小田急電鉄	642,000	1,558.00	1,000,236,000	貸付有価証券 900株
9008	京王電鉄	186,600	3,690.00	688,554,000	
9009	京成電鉄	250,300	5,248.00	1,313,574,400	
9010	富士急行	47,800	3,100.00	148,180,000	
9020	東日本旅客鉄道	2,139,800	2,652.00	5,674,749,600	貸付有価証券 69,600株
9021	西日本旅客鉄道	921,100	2,954.50	2,721,389,950	貸付有価証券 34,800株
9022	東海旅客鉄道	1,495,500	3,431.00	5,131,060,500	貸付有価証券 53,000株
9024	西武ホールディングス	469,600	2,209.00	1,037,346,400	
9025	鴻池運輸	66,200	2,413.00	159,740,600	貸付有価証券 300株
9031	西日本鉄道	103,700	2,537.00	263,086,900	貸付有価証券 3,700株
9037	ハマキョウレックス	33,100	4,355.00	144,150,500	
9039	サカイ引越センター	43,000	2,592.00	111,456,000	
9041	近鉄グループホールディングス	387,600	3,455.00	1,339,158,000	貸付有価証券 12,600株
9042	阪急阪神ホールディングス	516,900	4,209.00	2,175,632,100	
9044	南海電気鉄道	172,900	2,665.00	460,778,500	
9045	京阪ホールディングス	213,600	2,882.50	615,702,000	
9046	神戸電鉄	10,500	2,746.00	28,833,000	
9048	名古屋鉄道	399,800	1,745.50	697,850,900	
9052	山陽電気鉄道	29,200	2,099.00	61,290,800	貸付有価証券 1,100株
9055	アルプス物流	30,900	5,720.00	176,748,000	
9064	ヤマトホールディングス	471,100	1,788.50	842,562,350	
9065	山九	93,500	5,468.00	511,258,000	
9067	丸運	6,200	372.00	2,306,400	貸付有価証券 2,400株
9068	丸全昭和運輸	23,900	5,330.00	127,387,000	
9069	センコーグループホールディングス	205,200	1,137.00	233,312,400	貸付有価証券 7,300株
9070	トナミホールディングス	8,500	6,290.00	53,465,000	
9072	ニッコンホールディングス	119,400	3,538.00	422,437,200	貸付有価証券 4,400株
9074	日本石油輸送	1,200	3,020.00	3,624,000	
9075	福山通運	44,200	3,845.00	169,949,000	
9076	セイノーホールディングス	218,000	2,137.50	465,975,000	貸付有価証券 7,700株
9078	エスライングループ本社	3,400	1,656.00	5,630,400	
9081	神奈川中央交通	11,000	3,095.00	34,045,000	
9090	A Z - C O M丸和ホールディングス	99,100	1,220.00	120,902,000	

9099	C & F ロジホールディングス	37,300	5,730.00	213,729,000	
9142	九州旅客鉄道	274,100	3,468.00	950,578,800	
9143	S Gホールディングス	650,900	1,493.00	971,793,700	
9147	N I P P O N E X P R E S Sホール ディン	131,500	7,579.00	996,638,500	
9101	日本郵船	1,004,000	4,649.00	4,667,596,000	貸付有価証券 36,500株
9104	商船三井	841,800	4,868.00	4,097,882,400	貸付有価証券 24,100株
9107	川崎汽船	933,900	2,289.00	2,137,697,100	貸付有価証券 23,700株
9110	N S ユナイテッド海運	20,900	4,965.00	103,768,500	
9115	明海グループ	13,000	713.00	9,269,000	
9119	飯野海運	142,300	1,278.00	181,859,400	
9130	共栄タンカー	2,200	1,309.00	2,879,800	貸付有価証券 1,600株
9308	乾汽船	45,400	1,181.00	53,617,400	貸付有価証券 2,500株
9201	日本航空	952,000	2,575.00	2,451,400,000	
9202	A N Aホールディングス	1,054,700	2,975.50	3,138,259,850	貸付有価証券 37,100株
9232	パスコ	2,200	1,786.00	3,929,200	
9058	トランコム	11,200	6,500.00	72,800,000	
9066	日新	29,400	4,700.00	138,180,000	
9301	三菱倉庫	92,400	5,375.00	496,650,000	貸付有価証券 300株
9302	三井倉庫ホールディングス	36,200	4,760.00	172,312,000	
9303	住友倉庫	103,600	2,590.00	268,324,000	
9304	澁澤倉庫	17,700	3,150.00	55,755,000	
9306	東陽倉庫	3,200	1,531.00	4,899,200	貸付有価証券 100株
9310	日本トランスシティ	78,000	1,067.00	83,226,000	
9312	ケイヒン	2,200	2,303.00	5,066,600	
9319	中央倉庫	20,800	1,285.00	26,728,000	
9322	川西倉庫	2,200	1,193.00	2,624,600	
9324	安田倉庫	26,400	1,618.00	42,715,200	
9325	ファイズホールディングス	1,700	1,135.00	1,929,500	
9351	東洋埠頭	3,500	1,380.00	4,830,000	
9364	上組	179,000	3,272.00	585,688,000	
9366	サンリツ	2,900	897.00	2,601,300	
9368	キムラユニティー	5,700	1,714.00	9,769,800	
9369	キューソー流通システム	19,900	1,666.00	33,153,400	
9380	東海運	7,000	296.00	2,072,000	貸付有価証券 4,400株
9381	エーアイティー	24,300	1,876.00	45,586,800	貸付有価証券 900株

9384	内外トランスライン	15,500	2,879.00	44,624,500	
9386	日本コンセプト	14,100	1,834.00	25,859,400	
1973	ＮＥＣネットスアイ	151,800	2,370.00	359,766,000	貸付有価証券 1,400株
2307	クロスキャット	24,700	1,429.00	35,296,300	
2317	システナ	589,200	309.00	182,062,800	
2326	デジタルアーツ	24,600	4,255.00	104,673,000	
2327	日鉄ソリューションズ	66,400	5,360.00	355,904,000	
2335	キューブシステム	20,600	1,195.00	24,617,000	
2359	コア	17,200	1,973.00	33,935,600	
2477	手間いらず	6,600	3,170.00	20,922,000	貸付有価証券 100株
3031	ラクーンホールディングス	29,100	563.00	16,383,300	
3040	ソリトンシステムズ	20,100	1,238.00	24,883,800	
3371	ソフトクリエイイトホールディングス	32,000	1,990.00	63,680,000	
3626	ＴＩＳ	411,600	3,088.00	1,271,020,800	
3627	テクミラホールディングス	5,500	396.00	2,178,000	貸付有価証券 2,400株
3632	グリー	130,500	538.00	70,209,000	貸付有価証券 2,400株
3633	ＧＭＯペパボ	4,800	1,510.00	7,248,000	貸付有価証券 500株
3635	コーエーテクモホールディングス	244,000	1,405.00	342,820,000	
3636	三菱総合研究所	19,100	4,920.00	93,972,000	
3639	ボルテージ	3,500	267.00	934,500	貸付有価証券 1,300株
3640	電算	1,400	1,495.00	2,093,000	貸付有価証券 500株
3648	ＡＧＳ	5,000	1,080.00	5,400,000	貸付有価証券 2,400株
3649	ファインデックス	30,900	1,009.00	31,178,100	
3655	ブレインパッド	32,400	1,073.00	34,765,200	貸付有価証券 1,000株
3656	ＫＬａｂ	71,600	233.00	16,682,800	貸付有価証券 8,400株
3657	ポールトゥウィンホールディングス	66,500	503.00	33,449,500	貸付有価証券 2,300株
3659	ネクソン	854,300	2,951.00	2,521,039,300	
3660	アイスタイル	130,100	492.00	64,009,200	貸付有価証券 11,100株
3661	エムアップホールディングス	47,700	1,425.00	67,972,500	貸付有価証券 100株
3662	エイチーム	25,900	743.00	19,243,700	
3665	エニグモ	49,500	332.00	16,434,000	貸付有価証券 5,500株
3666	テクノスジャパン	10,500	698.00	7,329,000	貸付有価証券 700株

3667	e n i s h	9,500	301.00	2,859,500	貸付有価証券 1,900株
3668	コロブラ	132,300	635.00	84,010,500	貸付有価証券 3,900株
3672	オルトプラス	9,700	131.00	1,270,700	貸付有価証券 2,400株
3673	ブロードリーフ	184,800	567.00	104,781,600	
3675	クロス・マーケティンググループ	5,100	600.00	3,060,000	貸付有価証券 900株
3676	デジタルハーツホールディングス	24,300	1,055.00	25,636,500	貸付有価証券 100株
3678	メディアドウ	17,600	1,504.00	26,470,400	
3679	じげん	113,500	599.00	67,986,500	
3681	ブイキューブ	46,700	252.00	11,768,400	貸付有価証券 2,700株
3682	エンカレッジ・テクノロジー	2,900	656.00	1,902,400	
3683	サイバーリンクス	4,100	817.00	3,349,700	
3686	ディー・エル・イー	8,600	166.00	1,427,600	貸付有価証券 3,000株
3687	フィックスターズ	39,100	1,936.00	75,697,600	
3688	C A R T A H O L D I N G S	18,400	1,636.00	30,102,400	貸付有価証券 2,100株
3694	オプティム	40,100	681.00	27,308,100	貸付有価証券 1,100株
3696	セレス	15,800	1,650.00	26,070,000	
3697	S H I F T	25,900	14,260.00	369,334,000	
3738	ティーガイア	40,700	2,865.00	116,605,500	
3741	セック	5,400	4,395.00	23,733,000	
3762	テクマトリックス	71,100	1,948.00	138,502,800	
3763	プロシップ	18,700	1,363.00	25,488,100	
3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	101,300	2,732.00	276,751,600	貸付有価証券 200株
3769	G M Oペイメントゲートウェイ	88,900	8,645.00	768,540,500	
3770	ザッパラス	2,900	444.00	1,287,600	貸付有価証券 1,800株
3771	システムリサーチ	26,700	1,660.00	44,322,000	
3774	インターネットイニシアティブ	186,200	2,331.50	434,125,300	
3778	さくらインターネット	48,700	4,200.00	204,540,000	貸付有価証券 6,700株
3788	G M Oグローバルサイン・ホールディングス	11,900	3,060.00	36,414,000	貸付有価証券 400株
3817	S R Aホールディングス	19,900	4,265.00	84,873,500	
3826	システムインテグレータ	3,500	370.00	1,295,000	貸付有価証券 1,300株
3834	朝日ネット	41,800	672.00	28,089,600	貸付有価証券 200株
3835	e B A S E	54,800	715.00	39,182,000	貸付有価証券 5,200株

3836	アバントグループ	49,200	1,367.00	67,256,400	
3837	アドソル日進	16,400	1,900.00	31,160,000	
3839	ＯＤＫソリューションズ	2,200	578.00	1,271,600	
3843	フリービット	17,000	1,281.00	21,777,000	貸付有価証券 2,600株
3844	コムチュア	56,200	1,783.00	100,204,600	
3853	アステリア	30,500	566.00	17,263,000	貸付有価証券 2,600株
3854	アイル	21,800	2,441.00	53,213,800	貸付有価証券 1,100株
3901	マークライNZ	21,100	3,055.00	64,460,500	貸付有価証券 100株
3902	メディカル・データ・ビジョン	46,500	581.00	27,016,500	貸付有価証券 900株
3903	g u m i	63,200	334.00	21,108,800	貸付有価証券 9,600株
3909	ショーケース	2,800	311.00	870,800	貸付有価証券 1,000株
3912	モバイルファクトリー	2,600	650.00	1,690,000	貸付有価証券 1,100株
3915	テラスカイ	16,900	2,011.00	33,985,900	貸付有価証券 3,400株
3916	デジタル・インフォメーション・テクノロジー	20,300	1,900.00	38,570,000	
3918	P C Iホールディングス	4,600	972.00	4,471,200	
3920	アイビーシー	1,800	467.00	840,600	
3921	ネオジャパン	13,000	1,689.00	21,957,000	
3922	P R T I M E S	7,800	1,878.00	14,648,400	
3923	ラクス	184,200	2,057.50	378,991,500	
3924	ランドコンピュータ	5,800	822.00	4,767,600	
3925	ダブルスタンダード	11,800	1,718.00	20,272,400	
3926	オーブンドア	22,700	647.00	14,686,900	貸付有価証券 3,100株
3928	マイネット	3,900	344.00	1,341,600	貸付有価証券 1,400株
3932	アカツキ	19,000	2,441.00	46,379,000	
3934	ベネフィットジャパン	700	1,280.00	896,000	貸付有価証券 300株
3937	U b i c o mホールディングス	12,200	1,286.00	15,689,200	
3939	カナミックネットワーク	48,900	559.00	27,335,100	
3940	ノムラシステムコーポレーション	11,800	132.00	1,557,600	貸付有価証券 4,000株
3962	チェンジホールディングス	84,800	1,228.00	104,134,400	貸付有価証券 5,400株
3963	シンクロ・フード	6,800	524.00	3,563,200	貸付有価証券 300株
3964	オークネット	14,400	2,740.00	39,456,000	
3965	キャピタル・アセット・プランニング	2,200	864.00	1,900,800	貸付有価証券 1,200株

3968	セグエグループ	10,300	597.00	6,149,100	貸付有価証券 1,800株
3969	エイトレッド	1,800	1,628.00	2,930,400	貸付有価証券 100株
3978	マクロミル	76,400	866.00	66,162,400	
3981	ビーグリー	2,200	1,096.00	2,411,200	貸付有価証券 300株
3983	オロ	14,100	2,609.00	36,786,900	
3984	ユーザーローカル	16,400	2,018.00	33,095,200	
3985	テモナ	2,400	213.00	511,200	貸付有価証券 600株
3992	ニーズウェル	13,200	391.00	5,161,200	貸付有価証券 2,000株
3994	マネーフォワード	87,100	5,254.00	457,623,400	
3996	サインポスト	4,300	691.00	2,971,300	貸付有価証券 700株
4053	S u n A s t e r i s k	27,600	865.00	23,874,000	貸付有価証券 1,200株
4071	プラスアルファ・コンサルティング	49,100	1,913.00	93,928,300	貸付有価証券 600株
4072	電算システムホールディングス	17,200	2,714.00	46,680,800	貸付有価証券 600株
4180	A p p i e r G r o u p	133,300	1,211.00	161,426,300	貸付有価証券 1,500株
4194	ビジョナル	45,600	7,100.00	323,760,000	
4284	ソルクシーズ	9,800	322.00	3,155,600	貸付有価証券 3,800株
4295	フェイス	3,400	454.00	1,543,600	貸付有価証券 1,500株
4298	プロトコーポレーション	42,600	1,483.00	63,175,800	
4299	ハイマックス	12,200	1,400.00	17,080,000	
4307	野村総合研究所	843,300	4,524.00	3,815,089,200	
4320	C E ホールディングス	5,900	585.00	3,451,500	
4323	日本システム技術	32,500	1,696.00	55,120,000	
4326	インテージホールディングス	44,000	1,510.00	66,440,000	
4333	東邦システムサイエンス	16,300	1,594.00	25,982,200	貸付有価証券 400株
4344	ソースネクスト	178,200	209.00	37,243,800	貸付有価証券 27,300株
4348	インフォコム	50,200	6,050.00	303,710,000	
4373	シンプレクス・ホールディングス	59,200	2,830.00	167,536,000	
4382	H E R O Z	15,300	1,223.00	18,711,900	貸付有価証券 1,100株
4384	ラクスル	94,000	958.00	90,052,000	貸付有価証券 9,600株
4385	メルカリ	189,900	1,967.00	373,533,300	貸付有価証券 8,300株
4390	I P S	11,200	2,101.00	23,531,200	貸付有価証券 200株

4392	F I G	14,000	356.00	4,984,000	貸付有価証券 900株
4396	システムサポート	15,100	1,853.00	27,980,300	
4420	イーソル	28,000	962.00	26,936,000	
4430	東海ソフト	1,800	1,298.00	2,336,400	
4432	ウイングアーク 1 s t	40,500	2,719.00	110,119,500	
4433	ヒト・コミュニケーションズ・ホール ディン	13,000	951.00	12,363,000	貸付有価証券 800株
4434	サーバーワークス	8,000	3,190.00	25,520,000	貸付有価証券 500株
4439	東名	1,000	2,493.00	2,493,000	貸付有価証券 500株
4440	ヴィッツ	1,100	815.00	896,500	貸付有価証券 400株
4441	トピラシステムズ	3,100	803.00	2,489,300	貸付有価証券 1,300株
4443	S a n s a n	127,900	1,741.00	222,673,900	貸付有価証券 4,500株
4446	L i n k - Uグループ	2,400	590.00	1,416,000	貸付有価証券 1,100株
4449	ギフティ	34,100	1,105.00	37,680,500	貸付有価証券 4,000株
4480	メドレー	52,300	3,590.00	187,757,000	貸付有価証券 1,800株
4481	ベース	13,600	2,861.00	38,909,600	
4483	J M D C	66,400	3,357.00	222,904,800	
4662	フォーカスシステムズ	26,000	1,245.00	32,370,000	
4674	クレスコ	31,900	2,574.00	82,110,600	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	374,000	1,846.00	690,404,000	
4684	オービック	130,100	20,625.00	2,683,312,500	貸付有価証券 2,100株
4686	ジャストシステム	55,900	2,948.00	164,793,200	
4687	T D Cソフト	72,900	1,218.00	88,792,200	
4689	L I N Eヤフー	5,544,200	391.30	2,169,445,460	
4704	トレンドマイクロ	184,100	6,440.00	1,185,604,000	
4709	I Dホールディングス	26,200	1,474.00	38,618,800	
4716	日本オラクル	74,500	11,755.00	875,747,500	
4719	アルファシステムズ	10,200	3,145.00	32,079,000	
4722	フューチャー	83,000	1,524.00	126,492,000	
4725	C A C H o l d i n g s	20,900	1,960.00	40,964,000	
4726	S Bテクノロジー	16,500	2,946.00	48,609,000	
4728	トーセ	3,400	693.00	2,356,200	貸付有価証券 700株
4733	オービックビジネスコンサルタント	54,700	6,590.00	360,473,000	
4743	アイティフォー	49,800	1,413.00	70,367,400	
4746	東計電算	10,900	3,885.00	42,346,500	

4762	エックスネット	1,600	1,483.00	2,372,800	貸付有価証券 100株
4768	大塚商会	386,200	3,039.00	1,173,661,800	
4776	サイボウズ	53,600	2,040.00	109,344,000	貸付有価証券 1,900株
4812	電通総研	47,300	5,220.00	246,906,000	貸付有価証券 100株
4813	A C C E S S	40,500	1,297.00	52,528,500	貸付有価証券 4,100株
4819	デジタルガレージ	62,200	2,453.00	152,576,600	
4820	E Mシステムズ	64,900	621.00	40,302,900	
4825	ウェザーニューズ	12,000	4,665.00	55,980,000	貸付有価証券 500株
4826	C I J	97,000	476.00	46,172,000	
4828	ビジネスエンジニアリング	8,200	3,655.00	29,971,000	
4829	日本エンタープライズ	12,500	139.00	1,737,500	
4839	WOWOW	29,300	1,118.00	32,757,400	
4845	スカラ	36,100	715.00	25,811,500	
4847	インテリジェント ウェイブ	6,400	1,096.00	7,014,400	
5032	A N Y C O L O R	55,100	2,766.00	152,406,600	貸付有価証券 100株
6879	I M A G I C A G R O U P	39,000	556.00	21,684,000	
7518	ネットワンシステムズ	151,600	2,911.00	441,307,600	貸付有価証券 300株
7527	システムソフト	135,500	66.00	8,943,000	貸付有価証券 10,300株
7595	アルゴグラフィックス	35,700	4,850.00	173,145,000	
7844	マーベラス	63,200	650.00	41,080,000	貸付有価証券 3,100株
7860	エイベックス	66,300	1,324.00	87,781,200	
8056	B I P R O G Y	127,400	4,354.00	554,699,600	
8157	都築電気	20,500	2,396.00	49,118,000	
9401	T B Sホールディングス	195,800	4,060.00	794,948,000	
9404	日本テレビホールディングス	344,700	2,328.50	802,633,950	
9405	朝日放送グループホールディングス	36,400	681.00	24,788,400	
9409	テレビ朝日ホールディングス	94,500	2,164.00	204,498,000	貸付有価証券 1,400株
9412	スカパーＪＳＡＴホールディングス	302,400	859.00	259,761,600	
9413	テレビ東京ホールディングス	28,000	3,790.00	106,120,000	貸付有価証券 900株
9414	日本ＢＳ放送	4,300	929.00	3,994,700	
9416	ビジョン	58,200	1,217.00	70,829,400	
9417	スマートバリュー	2,900	390.00	1,131,000	貸付有価証券 1,500株
9418	U - N E X T H O L D I N G S	43,600	4,475.00	195,110,000	
9419	ワイヤレスゲート	5,300	234.00	1,240,200	貸付有価証券 2,400株

9424	日本通信	383,300	191.00	73,210,300	
9428	クロップス	1,600	1,146.00	1,833,600	
9432	日本電信電話	115,827,900	150.90	17,478,430,110	
9433	K D D I	3,009,000	4,260.00	12,818,340,000	
9434	ソフトバンク	6,217,300	1,980.00	12,310,254,000	貸付有価証券 173,000株
9435	光通信	39,200	29,680.00	1,163,456,000	
9438	エムティーアイ	26,700	936.00	24,991,200	貸付有価証券 1,000株
9449	G M Oインターネットグループ	142,700	2,468.00	352,183,600	
9450	ファイバーゲート	20,900	1,136.00	23,742,400	
9466	アйдママーケティングコミュニケー ション	2,800	231.00	646,800	
9468	K A D O K A W A	205,900	2,846.50	586,094,350	
9470	学研ホールディングス	71,300	1,030.00	73,439,000	
9474	ゼンリン	66,600	956.00	63,669,600	
9475	昭文社ホールディングス	5,200	371.00	1,929,200	貸付有価証券 2,000株
9479	インプレスホールディングス	11,100	164.00	1,820,400	
9600	アイネット	23,600	2,140.00	50,504,000	
9601	松竹	20,200	9,451.00	190,910,200	貸付有価証券 2,900株
9602	東宝	216,600	4,647.00	1,006,540,200	
9605	東映	64,300	3,805.00	244,661,500	
9613	N T Tデータグループ	1,018,100	2,382.50	2,425,623,250	貸付有価証券 30,500株
9629	ピー・シー・エー	22,400	2,468.00	55,283,200	
9658	ビジネスブレイン太田昭和	15,200	2,233.00	33,941,600	
9682	D T S	81,600	4,240.00	345,984,000	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディ ングス	177,900	4,803.00	854,453,700	
9692	シーイーシー	49,100	2,147.00	105,417,700	
9697	カプコン	696,500	3,029.00	2,109,698,500	貸付有価証券 17,300株
9702	アイ・エス・ビー	19,900	1,426.00	28,377,400	
9717	ジャステック	23,900	1,934.00	46,222,600	
9719	S C S K	272,500	3,160.00	861,100,000	
9739	N S W	17,300	3,315.00	57,349,500	
9742	アイネス	30,300	1,835.00	55,600,500	
9746	T K C	69,500	3,385.00	235,257,500	
9749	富士ソフト	78,300	6,890.00	539,487,000	
9759	N S D	137,300	3,085.00	423,570,500	貸付有価証券 1,100株
9766	コナミグループ	145,800	11,235.00	1,638,063,000	貸付有価証券 5,900株
9790	福井コンピュータホールディングス	24,000	2,567.00	61,608,000	

9889	J B C C ホールディングス	25,800	3,570.00	92,106,000	
9928	ミロク情報サービス	35,400	1,958.00	69,313,200	
9984	ソフトバンクグループ	1,920,900	9,938.00	19,089,904,200	
167A	リョーサン菱洋ホールディングス	77,200	2,999.00	231,522,800	
2676	高千穂交易	14,600	3,930.00	57,378,000	貸付有価証券 900株
2689	オルバヘルスケアホールディングス	1,900	2,147.00	4,079,300	貸付有価証券 500株
2692	伊藤忠食品	9,200	7,190.00	66,148,000	
2715	エレマテック	36,900	1,982.00	73,135,800	
2733	あらた	62,800	3,550.00	222,940,000	
2737	トーメンデバイス	5,900	7,670.00	45,253,000	
2760	東京エレクトロン デバイス	40,900	4,305.00	176,074,500	
2767	円谷フィールズホールディングス	70,500	1,641.00	115,690,500	貸付有価証券 6,800株
2768	双日	457,300	3,908.00	1,787,128,400	
2784	アルフレッサ ホールディングス	412,300	2,210.00	911,183,000	貸付有価証券 500株
2874	横浜冷凍	103,300	1,044.00	107,845,200	
3004	神栄	1,800	1,872.00	3,369,600	貸付有価証券 600株
3023	ラサ商事	18,800	1,785.00	33,558,000	
3036	アルコニックス	54,100	1,557.00	84,233,700	
3038	神戸物産	317,800	3,560.00	1,131,368,000	貸付有価証券 8,100株
3054	ハイパー	2,500	329.00	822,500	
3076	あい ホールディングス	65,700	2,432.00	159,782,400	
3079	ディーブイエックス	3,400	1,004.00	3,413,600	貸付有価証券 400株
3107	ダイワボウホールディングス	181,900	2,819.50	512,867,050	
3132	マクニカホールディングス	97,200	6,705.00	651,726,000	
3139	ラクト・ジャパン	16,000	2,823.00	45,168,000	
3150	グリムス	17,300	2,560.00	44,288,000	貸付有価証券 1,400株
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	62,200	1,417.00	88,137,400	
3153	八洲電機	33,200	1,766.00	58,631,200	貸付有価証券 300株
3154	メディアスホールディングス	23,900	988.00	23,613,200	貸付有価証券 2,500株
3156	レスター	34,900	3,200.00	111,680,000	
3157	ジオリーブグループ	2,600	1,194.00	3,104,400	貸付有価証券 1,000株
3160	大光	5,400	610.00	3,294,000	貸付有価証券 2,100株
3166	O C H I ホールディングス	2,800	1,478.00	4,138,400	貸付有価証券 1,300株
3167	T O K A I ホールディングス	223,100	974.00	217,299,400	

3168	黒谷	3,400	716.00	2,434,400	貸付有価証券 1,000株
3173	C o m i n i x	2,300	909.00	2,090,700	
3176	三洋貿易	42,100	1,630.00	68,623,000	
3180	ビューティガレージ	13,000	1,580.00	20,540,000	
3183	ウイン・パートナーズ	26,600	1,218.00	32,398,800	
3321	ミタチ産業	3,200	1,123.00	3,593,600	
3360	シップヘルスケアホールディングス	147,600	2,311.50	341,177,400	
3388	明治電機工業	15,200	1,887.00	28,682,400	
3392	デリカフーズホールディングス	5,300	570.00	3,021,000	
3393	スターティアホールディングス	2,900	2,220.00	6,438,000	
3543	コメダホールディングス	100,700	2,745.00	276,421,500	貸付有価証券 800株
3559	ピーバンドットコム	1,500	375.00	562,500	貸付有価証券 200株
3565	アセンテック	15,700	565.00	8,870,500	
5009	富士興産	3,400	1,769.00	6,014,600	貸付有価証券 1,400株
6973	協栄産業	1,300	2,879.00	3,742,700	
7128	フルサト・マルカホールディングス	36,600	2,159.00	79,019,400	
7130	ヤマエグループホールディングス	36,200	2,495.00	90,319,000	貸付有価証券 3,200株
7414	小野建	41,100	1,677.00	68,924,700	
7417	南陽	5,200	1,134.00	5,896,800	
7420	佐島電機	25,800	2,011.00	51,883,800	
7427	エコートレーディング	2,400	1,382.00	3,316,800	貸付有価証券 1,000株
7433	伯東	23,500	5,100.00	119,850,000	貸付有価証券 2,700株
7438	コンドーテック	31,600	1,418.00	44,808,800	
7442	中山福	6,700	377.00	2,525,900	
7447	ナガイレーベン	51,900	2,597.00	134,784,300	
7451	三菱食品	37,900	5,450.00	206,555,000	
7456	松田産業	31,300	2,905.00	90,926,500	
7458	第一興商	158,900	1,661.50	264,012,350	
7459	メディパルホールディングス	417,700	2,449.00	1,022,947,300	貸付有価証券 500株
7466	S P K	18,200	2,313.00	42,096,600	
7467	萩原電気ホールディングス	17,600	3,960.00	69,696,000	
7476	アズワン	127,400	2,834.00	361,051,600	
7480	スズデン	14,400	1,963.00	28,267,200	
7481	尾家産業	3,000	2,128.00	6,384,000	
7482	シモジマ	27,500	1,367.00	37,592,500	
7483	ドウシシャ	38,000	2,300.00	87,400,000	
7487	小津産業	2,900	1,627.00	4,718,300	貸付有価証券 500株

7504	高速	24,400	2,430.00	59,292,000	
7510	たけびし	15,700	2,202.00	34,571,400	
7525	リックス	9,300	3,055.00	28,411,500	
7537	丸文	36,700	1,263.00	46,352,100	
7552	ハピネット	34,900	3,365.00	117,438,500	
7570	橋本総業ホールディングス	16,200	1,350.00	21,870,000	
7575	日本ライフライン	110,000	1,130.00	124,300,000	
7590	タカショー	35,800	540.00	19,332,000	貸付有価証券 3,700株
7599	I D O M	108,600	1,448.00	157,252,800	
7607	進和	25,100	2,905.00	72,915,500	貸付有価証券 900株
7608	エスケイジャパン	3,000	843.00	2,529,000	
7609	ダイトロン	16,200	2,953.00	47,838,600	
7613	シークス	58,500	1,323.00	77,395,500	
7619	田中商事	3,500	822.00	2,877,000	
7628	オーハシテクニカ	21,500	1,831.00	39,366,500	
7637	白銅	11,500	2,873.00	33,039,500	
7673	ダイコー通産	1,300	1,215.00	1,579,500	
8001	伊藤忠商事	2,761,300	7,615.00	21,027,299,500	
8002	丸紅	3,407,300	2,965.00	10,102,644,500	貸付有価証券 28,300株
8007	高島	7,700	1,052.00	8,100,400	貸付有価証券 500株
8012	長瀬産業	188,300	3,029.00	570,360,700	
8014	蝶理	25,700	3,510.00	90,207,000	
8015	豊田通商	359,800	9,538.00	3,431,772,400	
8018	三共生興	56,900	743.00	42,276,700	
8020	兼松	171,800	2,642.00	453,895,600	貸付有価証券 400株
8025	ツカモトコーポレーション	1,800	1,201.00	2,161,800	貸付有価証券 200株
8031	三井物産	3,076,800	7,446.00	22,909,852,800	貸付有価証券 19,500株
8032	日本紙パルプ商事	19,600	6,000.00	117,600,000	
8037	カメイ	43,700	2,415.00	105,535,500	
8038	東都水産	600	6,530.00	3,918,000	貸付有価証券 300株
8041	O U Gホールディングス	1,800	2,735.00	4,923,000	
8043	スターゼン	28,300	3,030.00	85,749,000	
8051	山善	124,500	1,433.00	178,408,500	
8052	椿本興業	25,500	2,258.00	57,579,000	
8053	住友商事	2,486,100	3,969.00	9,867,330,900	貸付有価証券 36,800株
8057	内田洋行	16,600	8,210.00	136,286,000	
8058	三菱商事	7,887,800	3,165.00	24,964,887,000	

8059	第一実業	38,600	2,397.00	92,524,200	
8060	キヤノンマーケティングジャパン	95,200	4,501.00	428,495,200	
8061	西華産業	16,100	4,515.00	72,691,500	
8065	佐藤商事	28,500	1,695.00	48,307,500	
8070	東京産業	37,500	719.00	26,962,500	貸付有価証券 200株
8074	ユアサ商事	32,100	5,630.00	180,723,000	
8075	神鋼商事	10,300	7,690.00	79,207,000	
8077	トルク	6,800	233.00	1,584,400	貸付有価証券 2,600株
8078	阪和興業	73,800	6,160.00	454,608,000	
8079	正栄食品工業	27,300	4,690.00	128,037,000	貸付有価証券 2,900株
8081	カナデン	30,800	1,680.00	51,744,000	
8084	R Y O D E N	33,100	2,746.00	90,892,600	
8088	岩谷産業	93,500	9,684.00	905,454,000	
8089	ナイス	4,000	1,885.00	7,540,000	貸付有価証券 400株
8091	ニチモウ	3,200	2,183.00	6,985,600	
8093	極東貿易	24,500	1,772.00	43,414,000	貸付有価証券 900株
8095	アステナホールディングス	77,200	518.00	39,989,600	
8097	三愛オブリ	95,800	2,057.00	197,060,600	
8098	稲畑産業	81,200	3,520.00	285,824,000	
8101	G S I クレオス	22,000	2,250.00	49,500,000	
8103	明和産業	48,500	736.00	35,696,000	
8104	クワザワホールディングス	4,600	825.00	3,795,000	貸付有価証券 1,600株
8125	ワキタ	68,000	1,724.00	117,232,000	
8129	東邦ホールディングス	111,000	4,169.00	462,759,000	
8130	サンゲツ	94,500	3,010.00	284,445,000	
8131	ミツウロコグループホールディングス	52,400	1,661.00	87,036,400	
8132	シナネンホールディングス	11,400	4,960.00	56,544,000	貸付有価証券 500株
8133	伊藤忠エネクス	101,800	1,515.00	154,227,000	
8136	サンリオ	333,600	2,850.00	950,760,000	
8137	サンワテクノス	21,000	2,290.00	48,090,000	貸付有価証券 200株
8141	新光商事	55,200	947.00	52,274,400	貸付有価証券 200株
8142	トーヨー	16,000	3,805.00	60,880,000	貸付有価証券 1,200株
8150	三信電気	16,500	2,200.00	36,300,000	
8151	東陽テクニカ	37,900	1,718.00	65,112,200	
8153	モスフードサービス	60,400	3,645.00	220,158,000	貸付有価証券 2,100株

8154	加賀電子	37,500	5,670.00	212,625,000	
8158	ソーダニッカ	39,000	1,142.00	44,538,000	
8159	立花エレクトック	27,300	3,095.00	84,493,500	
8275	フォーバル	16,100	1,489.00	23,972,900	
8283	P A L T A C	55,400	4,459.00	247,028,600	
8285	三谷産業	71,700	373.00	26,744,100	
8835	太平洋興発	4,800	799.00	3,835,200	
9260	西本W i s m e t t a cホールディングス	10,400	4,325.00	44,980,000	貸付有価証券 800株
9265	ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	2,663.00	2,663,000	
9273	コア商事ホールディングス	30,300	708.00	21,452,400	貸付有価証券 3,500株
9274	K P P グループホールディングス	106,300	814.00	86,528,200	
9305	ヤマタネ	18,100	2,888.00	52,272,800	
9763	丸紅建材リース	900	3,145.00	2,830,500	
9824	泉州電業	25,500	5,310.00	135,405,000	
9830	トラスコ中山	86,300	2,478.00	213,851,400	
9832	オートバックスセブン	143,000	1,554.50	222,293,500	
9837	モリト	29,400	1,514.00	44,511,600	
9869	加藤産業	50,800	4,315.00	219,202,000	
9872	北恵	3,000	886.00	2,658,000	貸付有価証券 800株
9882	イエローハット	65,200	2,284.00	148,916,800	
9896	J K ホールディングス	31,500	1,025.00	32,287,500	
9902	日伝	26,900	3,560.00	95,764,000	貸付有価証券 400株
9930	北沢産業	7,100	351.00	2,492,100	貸付有価証券 3,300株
9932	杉本商事	19,900	2,513.00	50,008,700	
9934	因幡電機産業	106,500	3,920.00	417,480,000	
9960	東テク	41,100	2,494.00	102,503,400	貸付有価証券 1,300株
9962	ミスミグループ本社	620,500	2,826.00	1,753,533,000	
9972	アルテック	6,700	274.00	1,835,800	
9982	タキヒヨー	3,000	1,222.00	3,666,000	貸付有価証券 1,300株
9986	蔵王産業	2,200	2,570.00	5,654,000	
9987	スズケン	146,700	4,935.00	723,964,500	貸付有価証券 1,500株
9991	ジェコス	24,500	1,006.00	24,647,000	貸付有価証券 300株
2651	ローソン	29,100	10,330.00	300,603,000	
2659	サンエー	31,300	4,970.00	155,561,000	
2664	カワチ薬品	32,100	2,950.00	94,695,000	
2670	エービーシー・マート	179,800	2,912.00	523,577,600	
2674	ハードオフコーポレーション	16,400	2,080.00	34,112,000	

2678	アスクル	99,200	2,226.00	220,819,200	
2681	ゲオホールディングス	46,100	1,662.00	76,618,200	
2685	アダストリア	49,600	3,675.00	182,280,000	
2686	ジーフット	8,100	293.00	2,373,300	貸付有価証券 3,900株
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,600	659.00	1,054,400	貸付有価証券 600株
2695	くら寿司	48,100	4,375.00	210,437,500	
2698	キャンドウ	14,600	3,360.00	49,056,000	貸付有価証券 700株
2722	I Kホールディングス	4,100	374.00	1,533,400	貸付有価証券 1,800株
2726	バルグループホールディングス	80,600	1,829.00	147,417,400	貸付有価証券 3,000株
2730	エディオン	162,600	1,605.00	260,973,000	
2734	サーラコーポレーション	86,300	875.00	75,512,500	
2735	ワッツ	5,700	702.00	4,001,400	貸付有価証券 1,900株
2742	ハローズ	18,700	4,540.00	84,898,000	
2752	フジオフードグループ本社	46,200	1,448.00	66,897,600	
2753	あみやき亭	9,900	6,190.00	61,281,000	
2764	ひらまつ	28,600	218.00	6,234,800	貸付有価証券 8,600株
2791	大黒天物産	12,600	8,400.00	105,840,000	
2792	ハニーズホールディングス	36,500	1,603.00	58,509,500	
2796	ファーマライズホールディングス	2,800	639.00	1,789,200	
3028	アルペン	33,900	2,041.00	69,189,900	貸付有価証券 2,400株
3030	ハブ	4,100	876.00	3,591,600	貸付有価証券 1,300株
3034	クオールホールディングス	56,500	1,484.00	83,846,000	
3046	ジンズホールディングス	31,300	3,950.00	123,635,000	貸付有価証券 1,200株
3048	ビックカメラ	245,900	1,559.00	383,358,100	
3050	D C Mホールディングス	212,700	1,466.00	311,818,200	
3053	ベッパーフードサービス	103,300	129.00	13,325,700	貸付有価証券 7,000株
3064	M o n o t a R O	582,300	1,866.50	1,086,862,950	
3067	東京一番フーズ	2,900	517.00	1,499,300	貸付有価証券 500株
3073	D Dグループ	7,100	1,207.00	8,569,700	貸付有価証券 1,700株
3082	きちりホールディングス	3,000	920.00	2,760,000	貸付有価証券 700株
3086	J . フロント リテイリング	471,400	1,641.00	773,567,400	貸付有価証券 2,600株
3087	ドトール・日レスホールディングス	72,800	2,223.00	161,834,400	

3088	マツキヨココカラ＆カンパニー	747,300	2,302.50	1,720,658,250	貸付有価証券 11,800株
3091	ブロンコビリー	24,100	3,875.00	93,387,500	
3092	Z O Z O	261,800	3,971.00	1,039,607,800	
3093	トレジャー・ファクトリー	25,500	1,840.00	46,920,000	貸付有価証券 800株
3097	物語コーポレーション	68,600	3,450.00	236,670,000	貸付有価証券 2,400株
3099	三越伊勢丹ホールディングス	680,000	2,906.00	1,976,080,000	
3134	H a m e e	16,600	1,164.00	19,322,400	
3135	マーケットエンタープライズ	1,100	994.00	1,093,400	貸付有価証券 100株
3141	ウエルシアホールディングス	213,100	2,048.00	436,428,800	
3148	クリエイトＳＤホールディングス	58,200	3,660.00	213,012,000	
3159	丸善ＣＨＩホールディングス	15,000	344.00	5,160,000	貸付有価証券 400株
3169	ミサワ	2,600	624.00	1,622,400	貸付有価証券 900株
3172	ティーライフ	1,700	1,424.00	2,420,800	貸付有価証券 200株
3175	エー・ピーホールディングス	2,600	951.00	2,472,600	貸付有価証券 1,100株
3178	チムニー	3,900	1,347.00	5,253,300	貸付有価証券 1,300株
3179	シュッピン	37,100	1,382.00	51,272,200	
3182	オイシックス・ラ・大地	55,200	1,241.00	68,503,200	貸付有価証券 4,400株
3186	ネクステージ	93,800	2,438.00	228,684,400	貸付有価証券 3,200株
3191	ジョイフル本田	119,500	2,197.00	262,541,500	貸付有価証券 4,200株
3193	エターナルホスピタリティグループ	15,200	3,670.00	55,784,000	貸付有価証券 600株
3196	ホットランド	31,400	2,550.00	80,070,000	
3197	すかいらくホールディングス	561,500	2,239.50	1,257,479,250	貸付有価証券 19,700株
3198	S F Pホールディングス	19,900	2,153.00	42,844,700	貸付有価証券 1,900株
3199	綿半ホールディングス	31,800	1,755.00	55,809,000	
3221	ヨシックスホールディングス	9,500	2,912.00	27,664,000	
3222	ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	114,700	877.00	100,591,900	貸付有価証券 12,700株
3319	ゴルフダイジェスト・オンライン	18,600	589.00	10,955,400	
3328	B E E N O S	24,400	2,415.00	58,926,000	
3333	あさひ	38,100	1,538.00	58,597,800	貸付有価証券 1,300株
3341	日本調剤	27,000	1,481.00	39,987,000	
3349	コスモス薬品	34,800	13,345.00	464,406,000	

3361	トーエル	5,600	850.00	4,760,000	貸付有価証券 600株
3382	セブン＆アイ・ホールディングス	4,205,500	1,964.50	8,261,704,750	
3387	クリエイト・レストランツ・ホールディング	278,100	1,105.00	307,300,500	貸付有価証券 10,800株
3391	ツルハホールディングス	86,300	9,620.00	830,206,000	
3395	サンマルクホールディングス	33,100	2,212.00	73,217,200	
3396	フェリシモ	2,800	937.00	2,623,600	
3397	トリドールホールディングス	115,200	3,646.00	420,019,200	
3415	T O K Y O B A S E	43,800	308.00	13,490,400	
3538	ウイルプラスホールディングス	2,100	1,131.00	2,375,100	貸付有価証券 100株
3539	J Mホールディングス	31,000	2,913.00	90,303,000	貸付有価証券 1,000株
3544	サツドラホールディングス	5,400	831.00	4,487,400	貸付有価証券 600株
3546	アレンザホールディングス	30,700	1,138.00	34,936,600	貸付有価証券 1,000株
3547	串カツ田中ホールディングス	11,000	1,696.00	18,656,000	貸付有価証券 1,200株
3548	パロックジャパンリミテッド	32,000	808.00	25,856,000	貸付有価証券 4,400株
3549	クスリのアオキホールディングス	123,600	3,143.00	388,474,800	貸付有価証券 600株
3561	力の源ホールディングス	23,800	1,452.00	34,557,600	貸付有価証券 1,900株
3563	F O O D & L I F E C O M P A N I E	219,100	2,703.50	592,336,850	
4350	メディカルシステムネットワーク	44,500	582.00	25,899,000	
7127	一家ホールディングス	2,800	686.00	1,920,800	貸付有価証券 1,300株
7135	ジャパクラフトホールディングス	7,400	160.00	1,184,000	貸付有価証券 1,700株
7416	はるやまホールディングス	6,100	594.00	3,623,400	貸付有価証券 400株
7419	ノジマ	119,100	1,590.00	189,369,000	
7421	カップ・クリエイト	64,600	1,735.00	112,081,000	
7445	ライトオン	9,600	380.00	3,648,000	貸付有価証券 5,800株
7453	良品計画	489,200	2,642.00	1,292,466,400	貸付有価証券 10,900株
7455	パリミキホールディングス	15,900	399.00	6,344,100	貸付有価証券 4,700株
7463	アドヴァングループ	35,100	974.00	34,187,400	
7475	アルビス	13,400	2,646.00	35,456,400	
7494	コナカ	13,800	278.00	3,836,400	貸付有価証券 5,100株
7506	ハウス オブ ローゼ	1,600	1,587.00	2,539,200	貸付有価証券 300株

7508	G - 7 ホールディングス	44,800	1,631.00	73,068,800	
7512	イオン北海道	121,500	915.00	111,172,500	
7513	コジマ	79,200	967.00	76,586,400	
7514	ヒマラヤ	4,100	913.00	3,743,300	
7516	コーナン商事	50,400	4,185.00	210,924,000	
7520	エコス	15,200	2,310.00	35,112,000	
7522	ワタミ	43,400	937.00	40,665,800	
7524	マルシェ	4,400	254.00	1,117,600	貸付有価証券 1,500株
7532	パン・パシフィック・インターナショナルホ	829,700	3,847.00	3,191,855,900	
7545	西松屋チェーン	80,800	2,254.00	182,123,200	
7550	ゼンショーホールディングス	209,200	6,045.00	1,264,614,000	貸付有価証券 1,700株
7554	幸楽苑ホールディングス	30,400	1,373.00	41,739,200	
7561	ハークスレイ	4,000	799.00	3,196,000	
7581	サイゼリヤ	60,700	5,400.00	327,780,000	
7593	V T ホールディングス	160,200	510.00	81,702,000	
7596	魚力	14,300	2,491.00	35,621,300	
7601	ポブラ	2,900	256.00	742,400	貸付有価証券 1,100株
7605	フジ・コーポレーション	19,500	2,192.00	42,744,000	
7606	ユナイテッドアローズ	48,300	1,927.00	93,074,100	
7611	ハイデイ日高	60,900	3,070.00	186,963,000	貸付有価証券 1,400株
7615	Y U - W A C r e a t i o n H o l d i	7,100	137.00	972,700	貸付有価証券 3,300株
7616	コロワイド	176,600	2,042.50	360,705,500	貸付有価証券 14,500株
7630	壱番屋	162,200	1,105.00	179,231,000	貸付有価証券 6,000株
7640	トップカルチャー	4,200	167.00	701,400	貸付有価証券 1,900株
7646	P L A N T	2,900	1,523.00	4,416,700	貸付有価証券 100株
7649	スギホールディングス	248,300	2,380.50	591,078,150	貸付有価証券 2,700株
7679	薬王堂ホールディングス	20,100	2,865.00	57,586,500	
7918	ヴィア・ホールディングス	17,800	113.00	2,011,400	貸付有価証券 6,600株
8005	スクロール	61,200	1,091.00	66,769,200	貸付有価証券 100株
8008	ヨンドシーホールディングス	38,900	1,947.00	75,738,300	貸付有価証券 4,400株
8160	木曽路	62,200	2,595.00	161,409,000	
8163	S R S ホールディングス	67,700	1,355.00	91,733,500	
8165	千趣会	75,600	326.00	24,645,600	
8166	タカキュー	9,000	98.00	882,000	

8167	リテールパートナーズ	61,000	1,714.00	104,554,000	
8173	上新電機	40,700	2,622.00	106,715,400	
8174	日本瓦斯	217,700	2,358.50	513,445,450	貸付有価証券 7,700株
8179	ロイヤルホールディングス	72,400	2,545.00	184,258,000	貸付有価証券 2,500株
8181	東天紅	1,000	911.00	911,000	貸付有価証券 300株
8182	いなげや	39,900	1,244.00	49,635,600	
8185	チヨダ	39,200	937.00	36,730,400	貸付有価証券 1,400株
8194	ライフコーポレーション	43,100	3,890.00	167,659,000	
8200	リンガーハット	53,000	2,351.00	124,603,000	貸付有価証券 7,200株
8203	M r M a x H D	51,800	680.00	35,224,000	
8207	テンアライド	13,600	297.00	4,039,200	貸付有価証券 8,300株
8214	A O K I ホールディングス	88,100	1,344.00	118,406,400	
8217	オークワ	59,100	962.00	56,854,200	貸付有価証券 2,300株
8218	コメリ	63,200	3,535.00	223,412,000	貸付有価証券 400株
8219	青山商事	87,800	1,488.00	130,646,400	
8227	しまむら	96,500	7,565.00	730,022,500	貸付有価証券 300株
8230	はせがわ	6,000	356.00	2,136,000	
8233	高島屋	261,600	2,638.00	690,100,800	貸付有価証券 10,900株
8237	松屋	69,600	1,081.00	75,237,600	
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	181,800	2,333.00	424,139,400	
8244	近鉄百貨店	17,600	2,270.00	39,952,000	貸付有価証券 2,000株
8252	丸井グループ	272,700	2,267.00	618,210,900	
8255	アクシアル リテイリング	112,100	1,054.00	118,153,400	
8260	井筒屋	6,000	453.00	2,718,000	貸付有価証券 2,300株
8267	イオン	1,392,500	3,466.00	4,826,405,000	貸付有価証券 40,500株
8273	イズミ	72,800	3,215.00	234,052,000	
8276	平和堂	68,700	2,330.00	160,071,000	
8278	フジ	63,100	2,017.00	127,272,700	貸付有価証券 7,500株
8279	ヤオコー	48,700	9,634.00	469,175,800	
8281	ゼビオホールディングス	55,600	1,150.00	63,940,000	
8282	ケーズホールディングス	275,900	1,493.50	412,056,650	
8289	O l y m p i c グループ	5,500	546.00	3,003,000	貸付有価証券 2,200株
8291	日産東京販売ホールディングス	18,900	496.00	9,374,400	

9262	シルバーライフ	11,000	972.00	10,692,000	貸付有価証券 400株
9267	Genky Drug Stores	36,000	2,801.00	100,836,000	
9275	ナルミヤ・インターナショナル	2,100	1,383.00	2,904,300	貸付有価証券 700株
9278	ブックオフグループホールディングス	26,800	1,568.00	42,022,400	貸付有価証券 3,400株
9279	ギフトホールディングス	17,400	2,760.00	48,024,000	
9627	アインホールディングス	56,600	6,114.00	346,052,400	
9828	元気寿司	23,200	3,300.00	76,560,000	
9831	ヤマダホールディングス	1,263,400	431.60	545,283,440	貸付有価証券 2,200株
9842	アークランズ	122,200	1,939.00	236,945,800	
9843	ニトリホールディングス	149,500	17,245.00	2,578,127,500	
9850	グルメ杵屋	33,300	1,113.00	37,062,900	貸付有価証券 200株
9854	愛眼	9,400	181.00	1,701,400	
9856	ケーユーホールディングス	19,200	1,320.00	25,344,000	
9861	吉野家ホールディングス	151,300	3,108.00	470,240,400	貸付有価証券 200株
9887	松屋フーズホールディングス	19,400	6,020.00	116,788,000	
9900	サガミホールディングス	61,600	1,685.00	103,796,000	貸付有価証券 100株
9919	関西フードマーケット	27,800	2,403.00	66,803,400	
9936	王将フードサービス	30,400	8,790.00	267,216,000	
9946	ミニストップ	29,900	1,708.00	51,069,200	
9948	アークス	75,300	2,917.00	219,650,100	貸付有価証券 2,700株
9956	パローホールディングス	78,400	2,443.00	191,531,200	
9974	ベルク	20,500	7,550.00	154,775,000	
9979	大庄	22,200	1,253.00	27,816,600	貸付有価証券 400株
9983	ファーストリテイリング	231,000	40,890.00	9,445,590,000	
9989	サンドラッグ	138,600	4,076.00	564,933,600	
9990	サックスパー ホールディングス	34,700	791.00	27,447,700	
9993	ヤマザワ	2,700	1,307.00	3,528,900	貸付有価証券 1,000株
9994	やまや	2,600	3,120.00	8,112,000	
9997	ベルーナ	98,800	761.00	75,186,800	
5830	いよぎんホールディングス	455,000	1,412.00	642,460,000	
5831	しずおかフィナンシャルグループ	849,500	1,483.00	1,259,808,500	貸付有価証券 5,600株
5832	ちゅうぎんフィナンシャルグループ	321,900	1,654.00	532,422,600	
5838	楽天銀行	177,300	2,897.00	513,638,100	貸付有価証券 3,400株
5844	京都フィナンシャルグループ	481,300	2,820.00	1,357,266,000	貸付有価証券 800株

7150	島根銀行	3,400	562.00	1,910,800	貸付有価証券 900株
7161	じもとホールディングス	9,000	379.00	3,411,000	貸付有価証券 2,900株
7167	めぶきフィナンシャルグループ	1,772,000	609.40	1,079,856,800	
7173	東京きらぼしフィナンシャルグループ	49,000	4,715.00	231,035,000	
7180	九州フィナンシャルグループ	740,100	931.70	689,551,170	
7182	ゆうちょ銀行	4,201,900	1,489.50	6,258,730,050	貸付有価証券 37,000株
7184	富山第一銀行	121,400	1,223.00	148,472,200	
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,034,300	936.60	1,905,325,380	貸付有価証券 72,200株
7189	西日本フィナンシャルホールディングス	214,000	1,971.00	421,794,000	
7322	三十三フィナンシャルグループ	34,200	2,100.00	71,820,000	
7327	第四北越フィナンシャルグループ	60,000	5,130.00	307,800,000	
7337	ひろぎんホールディングス	544,200	1,219.50	663,651,900	貸付有価証券 1,200株
7350	おきなわフィナンシャルグループ	32,600	2,569.00	83,749,400	
7380	十六フィナンシャルグループ	49,600	4,675.00	231,880,000	
7381	北國フィナンシャルホールディングス	40,300	5,250.00	211,575,000	
7384	プロクレアホールディングス	43,700	1,904.00	83,204,800	
7389	あいちフィナンシャルグループ	78,500	2,701.00	212,028,500	貸付有価証券 1,900株
8304	あおぞら銀行	274,800	2,588.00	711,182,400	
8306	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	23,287,000	1,641.50	38,225,610,500	
8308	りそなホールディングス	4,422,300	1,044.00	4,616,881,200	貸付有価証券 2,200株
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	1,374,200	3,694.00	5,076,294,800	貸付有価証券 2,900株
8316	三井住友フィナンシャルグループ	2,677,800	10,350.00	27,715,230,000	貸付有価証券 17,800株
8331	千葉銀行	1,065,600	1,406.50	1,498,766,400	貸付有価証券 19,100株
8334	群馬銀行	742,000	1,004.50	745,339,000	貸付有価証券 4,000株
8336	武蔵野銀行	53,400	3,250.00	173,550,000	
8337	千葉興業銀行	81,300	1,005.00	81,706,500	貸付有価証券 2,200株
8338	筑波銀行	167,800	320.00	53,696,000	
8341	七十七銀行	111,300	4,315.00	480,259,500	
8343	秋田銀行	25,600	2,678.00	68,556,800	
8344	山形銀行	42,500	1,208.00	51,340,000	
8345	岩手銀行	24,200	2,816.00	68,147,200	
8346	東邦銀行	302,400	322.00	97,372,800	
8349	東北銀行	5,800	1,225.00	7,105,000	貸付有価証券 2,100株
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	333,000	4,262.00	1,419,246,000	

8358	スルガ銀行	286,200	1,042.00	298,220,400	
8359	八十二銀行	820,500	1,029.50	844,704,750	
8360	山梨中央銀行	42,800	2,049.00	87,697,200	
8361	大垣共立銀行	72,900	2,231.00	162,639,900	
8362	福井銀行	34,200	2,208.00	75,513,600	
8364	清水銀行	15,200	1,692.00	25,718,400	
8365	富山銀行	2,000	1,783.00	3,566,000	貸付有価証券 800株
8366	滋賀銀行	63,600	4,175.00	265,530,000	
8367	南都銀行	57,500	3,515.00	202,112,500	貸付有価証券 100株
8368	百五銀行	359,700	678.00	243,876,600	
8370	紀陽銀行	136,800	1,869.00	255,679,200	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	236,600	2,096.00	495,913,600	
8381	山陰合同銀行	239,300	1,370.00	327,841,000	
8383	鳥取銀行	4,200	1,381.00	5,800,200	貸付有価証券 200株
8386	百十四銀行	37,600	3,325.00	125,020,000	
8387	四国銀行	56,100	1,176.00	65,973,600	
8388	阿波銀行	53,600	2,768.00	148,364,800	
8392	大分銀行	23,000	3,500.00	80,500,000	
8393	宮崎銀行	23,000	3,450.00	79,350,000	
8395	佐賀銀行	22,400	2,699.00	60,457,600	
8399	琉球銀行	81,400	1,261.00	102,645,400	
8410	セブン銀行	1,198,600	268.40	321,704,240	貸付有価証券 48,200株
8411	みずほフィナンシャルグループ	5,161,400	3,265.00	16,851,971,000	
8416	高知銀行	4,100	925.00	3,792,500	
8418	山口フィナンシャルグループ	374,900	1,800.50	675,007,450	
8522	名古屋銀行	24,300	7,600.00	184,680,000	
8524	北洋銀行	579,400	532.00	308,240,800	
8537	大光銀行	3,800	1,645.00	6,251,000	
8541	愛媛銀行	51,500	1,277.00	65,765,500	
8542	トマト銀行	4,200	1,281.00	5,380,200	
8544	京葉銀行	157,400	866.00	136,308,400	
8550	栃木銀行	191,000	373.00	71,243,000	
8551	北日本銀行	12,400	2,778.00	34,447,200	
8558	東和銀行	70,200	711.00	49,912,200	
8562	福島銀行	12,400	281.00	3,484,400	貸付有価証券 4,100株
8563	大東銀行	5,200	761.00	3,957,200	貸付有価証券 2,200株
8600	トモニホールディングス	361,900	420.00	151,998,000	
8713	フィデアホールディングス	39,500	1,641.00	64,819,500	
8714	池田泉州ホールディングス	530,400	390.00	206,856,000	

7148	F P G	142,300	2,171.00	308,933,300	
7172	ジャパンインベストメントアドバイザ	62,000	1,600.00	99,200,000	
7347	マーキュリアホールディングス	6,000	919.00	5,514,000	貸付有価証券 800株
8473	S B Iホールディングス	613,700	4,020.00	2,467,074,000	
8518	日本アジア投資	8,600	239.00	2,055,400	貸付有価証券 3,700株
8595	ジャフコ グループ	114,000	1,917.00	218,538,000	
8601	大和証券グループ本社	2,962,100	1,207.00	3,575,254,700	
8604	野村ホールディングス	6,430,400	934.60	6,009,851,840	貸付有価証券 93,800株
8609	岡三証券グループ	335,700	781.00	262,181,700	貸付有価証券 4,400株
8613	丸三証券	127,200	1,057.00	134,450,400	貸付有価証券 4,500株
8614	東洋証券	101,500	392.00	39,788,000	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	454,000	572.00	259,688,000	
8617	光世証券	2,700	612.00	1,652,400	貸付有価証券 1,300株
8622	水戸証券	112,900	569.00	64,240,100	
8624	いちよし証券	71,600	854.00	61,146,400	
8628	松井証券	188,200	840.00	158,088,000	
8698	マネックスグループ	374,500	730.00	273,385,000	
8706	極東証券	52,400	1,470.00	77,028,000	貸付有価証券 4,000株
8707	岩井コスモホールディングス	43,600	2,277.00	99,277,200	
8708	アイザワ証券グループ	55,200	2,349.00	129,664,800	
8732	マネーパートナーズグループ	12,400	253.00	3,137,200	貸付有価証券 4,600株
8739	スパークス・グループ	42,600	1,708.00	72,760,800	
8742	小林洋行	4,700	285.00	1,339,500	貸付有価証券 500株
7181	かんぽ生命保険	389,400	3,080.00	1,199,352,000	
7388	F P パートナー	10,100	2,803.00	28,310,300	貸付有価証券 100株
8630	S O M P Oホールディングス	1,725,700	3,389.00	5,848,397,300	
8715	アニコム ホールディングス	129,900	675.00	87,682,500	
8725	M S & A Dインシュアランスグループホール	2,568,500	3,366.00	8,645,571,000	貸付有価証券 9,400株
8750	第一生命ホールディングス	1,797,900	4,198.00	7,547,584,200	貸付有価証券 1,700株
8766	東京海上ホールディングス	3,733,400	5,780.00	21,579,052,000	貸付有価証券 132,900株
8795	T & Dホールディングス	1,026,800	2,737.00	2,810,351,600	貸付有価証券 2,200株
8798	アドバンスクリエイト	29,500	1,067.00	31,476,500	貸付有価証券 2,000株

4346	N E X Y Z . G r o u p	3,800	642.00	2,439,600	貸付有価証券 1,500株
7164	全国保証	100,000	5,931.00	593,100,000	貸付有価証券 3,600株
7183	あんしん保証	5,100	223.00	1,137,300	
7187	ジェイリース	25,700	1,305.00	33,538,500	
7191	イントラスト	4,600	834.00	3,836,400	
7192	日本モーゲージサービス	6,600	424.00	2,798,400	貸付有価証券 1,800株
7196	C a s a	4,600	903.00	4,153,800	貸付有価証券 800株
7198	S B I アルヒ	36,700	906.00	33,250,200	
7199	プレミアグループ	64,600	2,175.00	140,505,000	
7383	ネットプロテクションズホールディングス	127,200	189.00	24,040,800	
8253	クレディセゾン	242,300	3,251.00	787,717,300	
8424	芙蓉総合リース	35,200	12,105.00	426,096,000	
8425	みずほリース	320,200	1,107.00	354,461,400	
8439	東京センチュリー	285,800	1,482.00	423,555,600	
8511	日本証券金融	140,500	1,587.00	222,973,500	
8515	アイフル	562,900	388.00	218,405,200	貸付有価証券 15,600株
8566	リコーリース	36,300	5,250.00	190,575,000	
8570	イオンフィナンシャルサービス	219,500	1,326.00	291,057,000	
8572	アコム	680,500	408.90	278,256,450	
8584	ジャックス	40,700	4,830.00	196,581,000	貸付有価証券 800株
8585	オリエントコーポレーション	124,800	1,039.00	129,667,200	
8591	オリックス	2,293,200	3,512.00	8,053,718,400	貸付有価証券 32,500株
8593	三菱ＨＣキャピタル	1,703,800	1,039.00	1,770,248,200	
8596	九州リースサービス	4,800	1,092.00	5,241,600	
8697	日本取引所グループ	985,800	3,728.00	3,675,062,400	
8771	イー・ギャランティ	62,300	1,426.00	88,839,800	
8772	アサックス	5,400	839.00	4,530,600	
8793	NECキャピタルソリューション	18,800	4,065.00	76,422,000	
1435	r o b o t h o m e	105,800	185.00	19,573,000	
1878	大東建託	140,100	16,815.00	2,355,781,500	
187A	サムティホールディングス	60,900	2,477.00	150,849,300	
2337	いちご	388,100	396.00	153,687,600	貸付有価証券 15,500株
2353	日本駐車場開発	455,300	207.00	94,247,100	
2975	スター・マイカ・ホールディングス	44,400	639.00	28,371,600	
2980	S R E ホールディングス	16,500	4,630.00	76,395,000	貸付有価証券 1,300株

2982	A Dワークスグループ	29,900	231.00	6,906,900	貸付有価証券 11,700株
3003	ヒューリック	891,900	1,450.50	1,293,700,950	
3231	野村不動産ホールディングス	212,900	3,984.00	848,193,600	
3232	三重交通グループホールディングス	81,800	607.00	49,652,600	
3245	ディア・ライフ	65,200	929.00	60,570,800	
3246	コーセーアールイー	3,800	727.00	2,762,600	貸付有価証券 2,000株
3252	地主	29,200	2,693.00	78,635,600	
3254	プレサンスコーポレーション	50,600	1,922.00	97,253,200	
3271	T H E グローバル社	6,900	547.00	3,774,300	貸付有価証券 2,400株
3275	ハウスコム	1,900	1,040.00	1,976,000	
3276	J P M C	22,100	1,207.00	26,674,700	
3277	サンセイランディック	3,500	1,013.00	3,545,500	貸付有価証券 300株
3280	エストラスト	1,200	725.00	870,000	
3284	フージャースホールディングス	59,000	1,171.00	69,089,000	
3288	オープンハウスグループ	140,100	4,937.00	691,673,700	
3289	東急不動産ホールディングス	1,149,600	1,060.00	1,218,576,000	
3291	飯田グループホールディングス	366,400	2,151.50	788,309,600	貸付有価証券 200株
3294	イーランド	1,800	1,559.00	2,806,200	
3299	ムゲンエステート	7,900	1,252.00	9,890,800	貸付有価証券 600株
3452	ビーロッド	8,100	926.00	7,500,600	
3454	ファーストブラザーズ	2,300	1,209.00	2,780,700	貸付有価証券 400株
3457	A n d D oホールディングス	23,100	1,119.00	25,848,900	
3458	シーアールイー	17,000	1,530.00	26,010,000	
3465	ケイアイスター不動産	18,400	3,475.00	63,940,000	貸付有価証券 600株
3467	アグレ都市デザイン	2,200	1,585.00	3,487,000	貸付有価証券 700株
3475	グッドコムアセット	35,500	791.00	28,080,500	貸付有価証券 2,600株
3480	ジェイ・エス・ビー	19,000	3,040.00	57,760,000	
3482	ロードスターキャピタル	24,900	2,814.00	70,068,600	
3484	テンポイノベーション	3,500	894.00	3,129,000	貸付有価証券 1,400株
3486	グローバル・リンク・マネジメント	2,200	2,204.00	4,848,800	貸付有価証券 200株
3489	フェイスネットワーク	3,200	1,816.00	5,811,200	
3498	霞ヶ関キャピタル	15,700	13,710.00	215,247,000	貸付有価証券 100株
4666	パーク 2 4	248,300	1,630.00	404,729,000	貸付有価証券 8,800株
4809	パラカ	12,000	2,087.00	25,044,000	

5535	ミガロホールディングス	1,900	4,315.00	8,198,500	貸付有価証券 800株
6620	宮越ホールディングス	17,400	1,801.00	31,337,400	貸付有価証券 1,600株
8801	三井不動産	5,305,000	1,463.50	7,763,867,500	
8802	三菱地所	2,499,500	2,492.50	6,230,003,750	貸付有価証券 81,100株
8803	平和不動産	62,100	3,920.00	243,432,000	
8804	東京建物	334,100	2,521.00	842,266,100	
8818	京阪神ビルディング	71,500	1,653.00	118,189,500	
8830	住友不動産	553,000	4,713.00	2,606,289,000	
8841	テーオーシー	68,100	746.00	50,802,600	
8848	レオパレス 2 1	382,600	516.00	197,421,600	
8850	スターツコーポレーション	54,900	3,380.00	185,562,000	
8860	フジ住宅	48,200	780.00	37,596,000	
8864	空港施設	53,800	603.00	32,441,400	
8869	明和地所	24,500	940.00	23,030,000	貸付有価証券 2,400株
8871	ゴールドクレスト	31,200	2,643.00	82,461,600	
8877	エスリード	18,000	4,515.00	81,270,000	
8881	日神グループホールディングス	61,400	555.00	34,077,000	
8892	日本エスコン	71,600	1,085.00	77,686,000	貸付有価証券 2,600株
8897	M I R A R T Hホールディングス	198,900	508.00	101,041,200	
8904	A V A N T I A	6,300	843.00	5,310,900	
8905	イオンモール	198,200	1,897.00	375,985,400	貸付有価証券 500株
8908	毎日コムネット	4,300	739.00	3,177,700	
8917	ファースト住建	4,700	1,078.00	5,066,600	貸付有価証券 2,600株
8918	ランド	2,122,400	9.00	19,101,600	
8919	カチタス	102,800	1,750.00	179,900,000	
8923	トーセイ	63,600	2,418.00	153,784,800	
8928	穴吹興産	2,200	2,198.00	4,835,600	貸付有価証券 1,000株
8934	サンフロンティア不動産	56,600	1,964.00	111,162,400	
8935	F J ネクストホールディングス	40,200	1,293.00	51,978,600	
8940	インテリックス	2,800	542.00	1,517,600	
8944	ランドビジネス	4,300	241.00	1,036,300	
8945	サンネクスタグループ	3,400	1,068.00	3,631,200	
8999	グランディハウス	32,200	604.00	19,448,800	
9706	日本空港ビルデング	135,200	5,518.00	746,033,600	
1717	明豊ファシリティワークス	6,000	883.00	5,298,000	
2120	L I F U L L	97,500	160.00	15,600,000	
2121	M I X I	85,600	2,988.00	255,772,800	貸付有価証券 600株

2124	ジェイエイシーリクルートメント	144,200	665.00	95,893,000	
2127	日本M & A センターホールディングス	636,000	861.50	547,914,000	
2130	メンバーズ	13,600	910.00	12,376,000	貸付有価証券 1,300株
2139	中広	2,000	527.00	1,054,000	
2146	ＵＴグループ	51,900	3,215.00	166,858,500	
2148	アイティメディア	15,300	1,891.00	28,932,300	貸付有価証券 1,800株
2150	ケアネット	81,700	550.00	44,935,000	
2153	Ｅ・Ｊホールディングス	23,300	1,899.00	44,246,700	
2154	オープンアップグループ	119,900	1,995.00	239,200,500	
2157	コシダカホールディングス	119,500	863.00	103,128,500	貸付有価証券 4,200株
2163	アルトナー	3,100	1,949.00	6,041,900	
2168	パソナグループ	48,400	2,192.00	106,092,800	
2169	ＣＤＳ	3,000	1,825.00	5,475,000	貸付有価証券 200株
2170	リンクアンドモチベーション	114,900	454.00	52,164,600	貸付有価証券 4,200株
2175	エス・エム・エス	139,800	2,049.00	286,450,200	
2180	サニーサイドアップグループ	3,700	669.00	2,475,300	
2181	パーソルホールディングス	4,063,000	220.90	897,516,700	
2183	リニカル	7,300	408.00	2,978,400	貸付有価証券 2,100株
2193	クックパッド	109,200	182.00	19,874,400	貸付有価証券 14,800株
2196	エスクリ	5,000	289.00	1,445,000	
2198	アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,000	791.00	4,746,000	貸付有価証券 900株
2301	学情	20,300	1,951.00	39,605,300	貸付有価証券 1,500株
2305	スタジオアリス	20,000	2,150.00	43,000,000	貸付有価証券 2,200株
2311	エプコ	2,800	828.00	2,318,400	
2325	ＮＪＳ	8,800	3,875.00	34,100,000	
2331	総合警備保障	666,700	938.60	625,764,620	
2371	カカクコム	259,000	2,062.00	534,058,000	貸付有価証券 600株
2372	アイロムグループ	16,100	2,765.00	44,516,500	
2374	セントケア・ホールディング	29,000	880.00	25,520,000	
2376	サイネックス	2,200	738.00	1,623,600	貸付有価証券 700株
2378	ルネサンス	31,000	990.00	30,690,000	
2379	ディップ	61,100	2,830.00	172,913,000	
2389	デジタルホールディングス	20,700	1,097.00	22,707,900	
2395	新日本科学	36,300	1,444.00	52,417,200	
2410	キャリアデザインセンター	2,400	1,794.00	4,305,600	

2413	エムスリー	788,700	1,531.50	1,207,894,050	貸付有価証券 27,800株
2418	ツカダ・グローバルホールディング	8,000	473.00	3,784,000	
2424	プラス	1,400	689.00	964,600	貸付有価証券 700株
2428	ウェルネット	9,400	644.00	6,053,600	貸付有価証券 800株
2429	ワールドホールディングス	18,000	2,197.00	39,546,000	
2432	ディー・エヌ・エー	141,900	1,608.00	228,175,200	
2433	博報堂ＤＹホールディングス	509,000	1,166.00	593,494,000	
2440	ぐるなび	74,400	309.00	22,989,600	貸付有価証券 7,300株
2445	タカミヤ	54,100	497.00	26,887,700	
2461	ファンコミュニケーションズ	55,800	414.00	23,101,200	貸付有価証券 2,000株
2462	ライク	14,900	1,521.00	22,662,900	貸付有価証券 900株
2464	A o b a - B B T	4,600	354.00	1,628,400	
2471	エスプール	114,700	314.00	36,015,800	貸付有価証券 9,900株
2475	W D Bホールディングス	20,400	1,860.00	37,944,000	
2485	ティア	7,400	461.00	3,411,400	貸付有価証券 500株
2487	C D G	1,400	1,324.00	1,853,600	
2489	アドウェイズ	54,900	410.00	22,509,000	貸付有価証券 7,400株
2491	バリューコマース	35,000	1,202.00	42,070,000	貸付有価証券 2,100株
2492	インフォマート	414,300	285.00	118,075,500	
2749	J Pホールディングス	102,000	529.00	53,958,000	
3521	エコナックホールディングス	10,700	130.00	1,391,000	貸付有価証券 3,800株
4286	C Lホールディングス	9,400	1,284.00	12,069,600	
4290	プレステージ・インターナショナル	186,800	693.00	129,452,400	貸付有価証券 6,000株
4301	アミューズ	24,300	1,627.00	39,536,100	
4310	ドリームインキュベータ	13,700	2,064.00	28,276,800	貸付有価証券 1,800株
4318	クイック	27,700	2,175.00	60,247,500	
4319	T A C	6,100	183.00	1,116,300	
4324	電通グループ	392,300	4,070.00	1,596,661,000	
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	17,200	980.00	16,856,000	
4337	ぴあ	13,600	3,130.00	42,568,000	貸付有価証券 1,200株
4343	イオンファンタジー	14,400	2,300.00	33,120,000	
4345	シーティーエス	50,400	839.00	42,285,600	貸付有価証券 1,600株

4544	H . U . グループホールディングス	116,800	2,375.50	277,458,400	貸付有価証券 11,900株
4641	アルプス技研	37,900	2,573.00	97,516,700	
4651	サニックス	63,900	301.00	19,233,900	
4658	日本空調サービス	42,900	1,108.00	47,533,200	
4661	オリエンタルランド	2,112,200	4,504.00	9,513,348,800	貸付有価証券 74,300株
4665	ダスキン	87,100	3,685.00	320,963,500	貸付有価証券 800株
4668	明光ネットワークジャパン	48,400	759.00	36,735,600	貸付有価証券 2,600株
4671	ファルコホールディングス	17,700	2,297.00	40,656,900	
4678	秀英予備校	2,800	302.00	845,600	
4679	田谷	2,100	386.00	810,600	貸付有価証券 200株
4680	ラウンドワン	376,100	809.00	304,264,900	
4681	リゾートトラスト	173,300	2,408.50	417,393,050	
4694	ビー・エム・エル	49,100	2,871.00	140,966,100	
4714	リソー教育	204,400	252.00	51,508,800	
4718	早稲田アカデミー	22,100	1,622.00	35,846,200	
4732	ユー・エス・エス	895,500	1,319.00	1,181,164,500	
4745	東京個別指導学院	47,300	413.00	19,534,900	貸付有価証券 1,500株
4751	サイバーエージェント	882,100	997.60	879,982,960	貸付有価証券 31,000株
4755	楽天グループ	3,425,600	848.00	2,904,908,800	
4763	クリーク・アンド・リバー社	20,000	1,828.00	36,560,000	貸付有価証券 900株
4765	S B I グローバルアセットマネジメン ト	78,100	669.00	52,248,900	
4767	テー・オー・ダブリュー	78,200	366.00	28,621,200	貸付有価証券 2,800株
4792	山田コンサルティンググループ	17,300	2,034.00	35,188,200	
4801	セントラルスポーツ	15,000	2,539.00	38,085,000	
4848	フルキャストホールディングス	38,100	1,481.00	56,426,100	
4849	エン・ジャパン	65,000	2,605.00	169,325,000	
5261	リソルホールディングス	1,000	4,810.00	4,810,000	貸付有価証券 300株
6028	テクノプロ・ホールディングス	233,700	2,671.00	624,212,700	貸付有価証券 600株
6029	アトラグループ	2,900	166.00	481,400	貸付有価証券 300株
6035	アイ・アールジャパンホールディング ス	20,700	1,215.00	25,150,500	
6036	K e e P e r 技研	24,600	4,150.00	102,090,000	貸付有価証券 4,100株
6037	ファーストロジック	2,800	548.00	1,534,400	
6044	三機サービス	1,800	1,153.00	2,075,400	

6047	G u n o s y	31,700	786.00	24,916,200	貸付有価証券 1,800株
6048	デザインワン・ジャパン	3,000	152.00	456,000	貸付有価証券 800株
6050	イー・ガーディアン	19,100	1,993.00	38,066,300	
6054	リブセンス	5,700	222.00	1,265,400	貸付有価証券 3,200株
6055	ジャパンマテリアル	122,100	2,080.00	253,968,000	
6058	ベクトル	47,700	1,238.00	59,052,600	貸付有価証券 2,100株
6059	ウチヤマホールディングス	5,300	349.00	1,849,700	貸付有価証券 2,500株
6062	チャーム・ケア・コーポレーション	33,200	1,615.00	53,618,000	貸付有価証券 1,100株
6070	キャリアリンク	14,600	2,470.00	36,062,000	
6071	I B J	30,500	595.00	18,147,500	貸付有価証券 2,900株
6073	アサンテ	19,700	1,755.00	34,573,500	
6078	バリューＨＲ	34,900	1,501.00	52,384,900	貸付有価証券 1,600株
6080	M & Aキャピタルパートナーズ	32,300	2,259.00	72,965,700	貸付有価証券 1,600株
6082	ライドオンエクスプレスホールディングス	15,800	1,040.00	16,432,000	
6083	E R Iホールディングス	3,100	2,317.00	7,182,700	貸付有価証券 500株
6087	アピスト	1,900	3,300.00	6,270,000	貸付有価証券 800株
6088	シグマクシス・ホールディングス	52,300	1,510.00	78,973,000	
6089	ウィルグループ	33,400	993.00	33,166,200	貸付有価証券 200株
6093	エスクロー・エージェント・ジャパン	13,700	141.00	1,931,700	
6095	メドピア	31,900	622.00	19,841,800	貸付有価証券 1,200株
6096	レアジョブ	2,300	436.00	1,002,800	貸付有価証券 1,000株
6098	リクルートホールディングス	2,874,500	8,308.00	23,881,346,000	
6099	エラン	52,800	895.00	47,256,000	
6171	土木管理総合試験所	5,400	328.00	1,771,200	
6178	日本郵政	4,172,100	1,572.50	6,560,627,250	貸付有価証券 135,100株
6183	ベルシステム 2 4 ホールディングス	42,800	1,600.00	68,480,000	
6184	鎌倉新書	34,000	437.00	14,858,000	貸付有価証券 5,200株
6185	S M N	2,300	308.00	708,400	貸付有価証券 900株
6186	一蔵	1,600	579.00	926,400	
6189	グローバルキッズCOMPANY	2,000	667.00	1,334,000	貸付有価証券 400株

6191	エアトリ	29,300	1,409.00	41,283,700	貸付有価証券 1,900株
6194	アトラエ	30,100	768.00	23,116,800	
6196	ストライク	19,700	4,720.00	92,984,000	貸付有価証券 600株
6197	ソラスト	110,000	466.00	51,260,000	
6199	セラク	12,200	1,268.00	15,469,600	
6200	インソース	86,600	849.00	73,523,400	
6532	ベйкаレント・コンサルティング	293,300	3,221.00	944,719,300	
6533	Orchestra Holdings	8,700	1,265.00	11,005,500	
6535	アイモバイル	50,700	475.00	24,082,500	
6538	キャリアインデックス	4,200	187.00	785,400	貸付有価証券 1,700株
6539	MS - Japan	16,300	1,048.00	17,082,400	
6540	船場	2,200	1,255.00	2,761,000	貸付有価証券 1,200株
6544	ジャパンエレベーターサービスホールディング	129,300	2,680.00	346,524,000	
6546	フルテック	1,700	1,148.00	1,951,600	貸付有価証券 300株
6547	グリーンズ	4,500	1,932.00	8,694,000	貸付有価証券 700株
6551	ツナググループ・ホールディングス	3,400	671.00	2,281,400	貸付有価証券 500株
6552	GameWith	3,700	259.00	958,300	貸付有価証券 900株
6555	MS & Consulting	1,600	626.00	1,001,600	貸付有価証券 800株
6560	エル・ティー・エス	4,600	2,166.00	9,963,600	
6564	ミダックホールディングス	24,200	1,538.00	37,219,600	貸付有価証券 1,000株
6571	キュービーネットホールディングス	22,900	1,161.00	26,586,900	貸付有価証券 2,600株
6572	オープングループ	54,200	281.00	15,230,200	
7030	スプリックス	3,500	803.00	2,810,500	貸付有価証券 600株
7033	マネジメントソリューションズ	17,100	1,410.00	24,111,000	
7034	プロレド・パートナーズ	9,800	727.00	7,124,600	
7035	and factory	3,600	321.00	1,155,600	貸付有価証券 1,000株
7037	テノ・ホールディングス	1,600	419.00	670,400	貸付有価証券 600株
7038	フロンティア・マネジメント	10,000	1,317.00	13,170,000	貸付有価証券 1,700株
7044	ピアラ	2,200	277.00	609,400	貸付有価証券 700株
7059	コプロ・ホールディングス	4,100	1,641.00	6,728,100	貸付有価証券 1,400株

7060	ギークス	1,600	481.00	769,600	
7071	アンビスホールディングス	85,400	2,320.00	198,128,000	貸付有価証券 1,500株
7085	カーブスホールディングス	109,000	772.00	84,148,000	貸付有価証券 3,900株
7088	フォーラムエンジニアリング	54,300	908.00	49,304,400	
7092	F a s t F i t n e s s J a p a n	13,600	1,453.00	19,760,800	貸付有価証券 1,500株
7354	ダイレクトマーケティングミックス	41,100	250.00	10,275,000	
7358	ポピンズ	5,900	1,205.00	7,109,500	
7366	L I T A L I C O	31,100	1,758.00	54,673,800	
7374	コンフィデンス・インターワークス	1,200	1,934.00	2,320,800	
8769	アドバンテッジリスクマネジメント	6,300	490.00	3,087,000	貸付有価証券 2,100株
8876	リログループ	199,900	1,730.00	345,827,000	貸付有価証券 1,500株
8920	東祥	27,800	715.00	19,877,000	貸付有価証券 2,700株
9161	I D & E ホールディングス	24,100	4,395.00	105,919,500	
9216	ビーウィズ	8,200	1,834.00	15,038,800	貸付有価証券 500株
9247	T R E ホールディングス	76,400	1,268.00	96,875,200	
9248	人・夢・技術グループ	16,400	1,769.00	29,011,600	貸付有価証券 600株
9332	N I S S O ホールディングス	34,600	857.00	29,652,200	貸付有価証券 2,000株
9336	大栄環境	72,500	2,659.00	192,777,500	
9347	日本管財ホールディングス	41,900	2,741.00	114,847,900	
9552	M & A 総研ホールディングス	42,500	4,190.00	178,075,000	
9603	エイチ・アイ・エス	115,900	1,640.00	190,076,000	貸付有価証券 7,200株
9612	ラックランド	18,100	2,142.00	38,770,200	貸付有価証券 800株
9616	共立メンテナンス	125,300	2,985.00	374,020,500	
9619	イチネンホールディングス	42,300	1,700.00	71,910,000	
9621	建設技術研究所	20,600	5,020.00	103,412,000	
9622	スペース	26,100	1,129.00	29,466,900	
9628	燦ホールディングス	37,400	1,195.00	44,693,000	
9632	スバル興業	13,900	2,735.00	38,016,500	貸付有価証券 500株
9633	東京テアトル	4,600	1,127.00	5,184,200	貸付有価証券 300株
9644	タナベコンサルティンググループ	15,400	1,095.00	16,863,000	
9663	ナガワ	12,500	8,070.00	100,875,000	貸付有価証券 1,600株
9672	東京都競馬	33,400	4,020.00	134,268,000	
9675	常磐興産	4,600	1,211.00	5,570,600	
9678	カナモト	61,900	2,989.00	185,019,100	

9699	ニシオホールディングス	33,000	4,105.00	135,465,000	
9704	アゴーラ ホスピタリティーズ グループ	72,100	44.00	3,172,400	貸付有価証券 27,100株
9715	トランス・コスモス	49,600	3,405.00	168,888,000	
9716	乃村工藝社	174,100	865.00	150,596,500	
9722	藤田観光	16,000	9,060.00	144,960,000	
9726	KNT-CTホールディングス	23,800	1,352.00	32,177,600	
9729	トーカイ	35,300	2,281.00	80,519,300	
9731	白洋舎	1,200	2,465.00	2,958,000	貸付有価証券 500株
9735	セコム	406,500	9,582.00	3,895,083,000	
9740	セントラル警備保障	21,500	3,075.00	66,112,500	
9743	丹青社	77,300	1,007.00	77,841,100	
9744	メイテックグループホールディングス	135,900	3,234.00	439,500,600	
9755	応用地質	37,300	2,720.00	101,456,000	
9757	船井総研ホールディングス	79,900	2,304.00	184,089,600	
9760	進学会ホールディングス	3,300	240.00	792,000	貸付有価証券 1,200株
9765	オオバ	7,700	1,090.00	8,393,000	
9768	いであ	2,800	2,370.00	6,636,000	
9769	学究社	15,900	2,114.00	33,612,600	
9787	イオンディライト	42,800	4,020.00	172,056,000	
9788	ナック	33,800	580.00	19,604,000	
9793	ダイセキ	81,500	3,670.00	299,105,000	
9795	ステップ	14,500	1,912.00	27,724,000	
合 計		626,396,300		1,525,268,823,520	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

日本短期債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[2024年 6月25日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	53,141,430
国債証券	6,463,659,400
特殊債券	597,333,000
社債券	6,179,228,000
未収利息	9,496,958
前払費用	1,137,006
流動資産合計	13,303,995,794
資産合計	13,303,995,794

[2024年 6月25日現在]

負債の部	
流動負債	
未払解約金	232,593
流動負債合計	232,593
負債合計	232,593
純資産の部	
元本等	
元本	11,858,751,183
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,445,012,018
元本等合計	13,303,763,201
純資産合計	13,303,763,201
負債純資産合計	13,303,995,794

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。
--------------------	---

（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）

	[2024年 6月25日現在]
1. 期首	2023年 6月27日
期首元本額	1,434,595,979円
期中追加設定元本額	25,958,890,178円
期中一部解約元本額	15,534,734,974円
元本の内訳	
三菱ＵＦＪ グローバル・エコ・ウォーター・ファンド	88,421円
国内債券セクション（ラップ向け）	2,918,175,326円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	6,650,925,827円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	180,331,196円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	41,473,584円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	72,930,744円
日本短期債券ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	5,239,764円
日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）	103,005,701円
アドバンスト・バランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	32,074,630円
アドバンスト・バランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	51,910,374円
三菱ＵＦＪ 積立ファンド（日本バランス型）	1,100,289,295円
三菱ＵＦＪ 国内バランス２０	702,306,321円
合計	11,858,751,183円
2. 受益権の総数	11,858,751,183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 2023年 6月27日 至 2024年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク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	[2024年 6月25日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[2024年 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	8,281,300
特殊債券	204,000
社債券	18,775,000
合計	10,697,700

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[2024年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	1.1219円
(1万口当たり純資産額)	(11,219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４６０回利付国債（２年）	5,130,000,000	5,131,385,100	
	第４６１回利付国債（２年）	1,300,000,000	1,302,496,000	
	第３４７回利付国債（１０年）	30,000,000	29,778,300	
国債証券 合計		6,460,000,000	6,463,659,400	
特殊債券	第３８０回信金中金債	300,000,000	297,213,000	
	第２９２号商工債券（３年）	300,000,000	300,120,000	
特殊債券 合計		600,000,000	597,333,000	
社債券	第３５回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	98,847,000	
	第１５回クレディ・アグリコル・エス・エー（２０２４）	200,000,000	199,786,000	

第１２回ロイズ・バンキング・グループ期限前償還条項付	200,000,000	199,680,000	
第１回サタンデール銀行（２０１９）	200,000,000	199,822,000	
第２４回ルノー	200,000,000	200,052,000	
第２２回大和ハウス工業（グリーン）	200,000,000	199,364,000	
第２９回大和ハウス工業	100,000,000	99,803,000	
第１２回アサヒグループホールディングス	100,000,000	99,048,000	
第１４回森ビル	100,000,000	100,067,000	
第１２回セブン＆アイ・ホールディングス	100,000,000	100,406,000	
第１４回セブン＆アイ・ホールディングス	100,000,000	99,621,000	
第６３回神戸製鋼所	100,000,000	100,325,000	
第６７回神戸製鋼所	100,000,000	98,964,000	
第３９回ソニーグループ	300,000,000	298,881,000	
第１８回デンソー	100,000,000	98,619,000	
第４３回ＩＨＩ	100,000,000	99,933,000	
第４９回ＩＨＩ	100,000,000	98,771,000	
第２５回ＪＡ三井リース	100,000,000	99,447,000	
第２７回ＪＡ三井リース	100,000,000	99,334,000	
第１４回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	100,000,000	99,824,000	
第１９回三井住友信託銀行	100,000,000	99,178,000	
第３９回芙蓉総合リース	200,000,000	198,332,000	
第１６回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	200,000,000	199,066,000	
第３１回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	200,000,000	200,706,000	
第８１回ホンダファイナンス	100,000,000	98,605,000	
第２５回ＳＢＩホールディングス	100,000,000	99,994,000	
第２９回ＳＢＩホールディングス	100,000,000	99,949,000	
第１０３回トヨタファイナンス	200,000,000	198,630,000	
第４２回リコーリース	100,000,000	99,058,000	
第４４回リコーリース	100,000,000	99,995,000	
第１７回イオンフィナンシャルサービス	200,000,000	198,034,000	
第２０回イオンフィナンシャルサービス	100,000,000	99,717,000	
第７９回アコム	100,000,000	99,877,000	
第８０回アコム	100,000,000	99,336,000	
第８４回アコム	100,000,000	99,471,000	
第５７回日立キャピタル	100,000,000	100,123,000	
第２１９回オリックス	100,000,000	99,494,000	
第１回三井住友ファイナンス＆リース（グリーン）	100,000,000	99,839,000	
第３５回三井住友ファイナンス＆リース	100,000,000	99,825,000	
第３２回三菱ＵＦＪリース	100,000,000	100,137,000	
第７５回三菱ＵＦＪリース	100,000,000	99,901,000	
第１８回大和証券グループ本社	100,000,000	100,088,000	
第４０回大和証券グループ本社	100,000,000	99,626,000	

第４４回大和証券グループ本社（グリーン）	100,000,000	99,508,000	
第３回野村ホールディングス	100,000,000	98,726,000	
第２７回野村ホールディングス	100,000,000	101,688,000	
第３７回イオンモール（グリーン）	100,000,000	99,501,000	
第２５回ソフトバンク	200,000,000	200,374,000	
第６回ファーストリテイリング	100,000,000	99,856,000	
社債券 合計	6,200,000,000	6,179,228,000	
合計	13,260,000,000	13,240,220,400	

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。

東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[2024年 6月25日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,553,157,944
投資証券	116,582,625,500
派生商品評価勘定	35,464,750
未収配当金	627,990,452
未収利息	6,167
その他未収収益	211,903
差入委託証拠金	105,354,748
流動資産合計	120,904,811,464
資産合計	120,904,811,464
負債の部	
流動負債	
前受金	16,905,000
未払金	72,860,102
未払解約金	39,811,621
未払利息	124,447
受入担保金	2,269,923,495
流動負債合計	2,399,624,665
負債合計	2,399,624,665
純資産の部	
元本等	
元本	34,066,817,211
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	84,438,369,588
元本等合計	118,505,186,799
純資産合計	118,505,186,799
負債純資産合計	120,904,811,464

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）

	[2024年 6月25日現在]
1. 期首	2023年 6月27日
期首元本額	24,950,627,372円
期中追加設定元本額	12,159,604,397円
期中一部解約元本額	3,043,414,558円
元本の内訳	
eMAXIS 国内リートインデックス	4,209,056,331円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,883,738,523円
eMAXIS バランス（波乗り型）	169,257,202円
三菱ＵＦＪ <DC> J - REITインデックスファンド	758,062,371円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	500,077,579円
J - REITインデックスファンド（ラップ向け）	66,514,731円
オルタナティブ資産セレクション（ラップ向け）	868,112,812円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	10,289,223,085円
つみたて8資産均等バランス	5,156,683,032円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	873,434円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,626,065円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	733,567円
eMAXIS Slim 国内リートインデックス	5,521,478,376円
ラップ向けインデックスf 国内リート	674,544,383円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）	137,186,187円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）	1,229,953,710円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）	190,872,755円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	4,355,081円
三菱ＵＦＪ 国内リートインデックスファンド	64,023,957円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	7,757,825円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス（為替リスク軽減型）コンサバティブコース	1,554,509円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス（為替リスク軽減型）スタンダードコース	11,088,626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）	16,263,810円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	32,306,539円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	53,484,048円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	249,787,737円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	217,799,740円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	93,410,506円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	16,313,578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）	241,171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）	384,789,467円
日本リートインデックスファンドS	561,779,434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）	36,726,590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）	36,230,204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）	36,241,552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）	36,025,976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）	36,223,712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）	36,352,007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）	35,722,908円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09（適格機関投資家限定）	35,571,556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）	36,160,507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）	37,092,372円

	[2024年 6月25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）	38,938,060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）	40,203,912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）	41,261,256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）	41,579,926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）	41,642,416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）	41,643,078円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03（適格機関投資家限定）	41,636,571円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05（適格機関投資家限定）	41,650,050円
合計	34,066,817,211円
2. 貸付有価証券 貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っております。 投資証券	2,198,380,200円
3. 受益権の総数	34,066,817,211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 2023年 6月27日 至 2024年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、不動産投信指数先物取引を利用してあります。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク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	[2024年 6月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[2024年 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	2,955,696,983
合計	2,955,696,983

(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

[2024年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	1,914,748,000	—	1,950,232,000	35,484,000
合計		1,914,748,000	—	1,950,232,000	35,484,000

（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 ）

	[2024年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	3.4786円
(1万口当たり純資産額)	(34,786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	2,362	289,817,400	貸付有価証券 189口
	サンケイリアルエステート投資法人	3,722	315,997,800	
	S O S i L A物流リート投資法人	5,797	688,103,900	貸付有価証券 258口
	東海道リート投資法人	1,985	244,949,000	貸付有価証券 82口
	日本アコモデーションファンド投資法人	4,012	2,575,704,000	
	森ヒルズリート投資法人	13,662	1,803,384,000	
	産業ファンド投資法人	21,162	2,676,993,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	11,399	3,687,576,500	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,095	2,258,197,500	貸付有価証券 580口
	G L P 投資法人	39,025	5,241,057,500	

コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,713	1,819,590,500	
日本プロロジスリート投資法人	20,239	5,215,590,300	貸付有価証券 1,750口
星野リゾート・リート投資法人	2,442	1,306,470,000	
One リート投資法人	2,027	522,560,600	貸付有価証券 180口
イオンリート投資法人	14,252	1,902,642,000	
ヒューリックリート投資法人	10,870	1,597,890,000	
日本リート投資法人	3,774	1,277,499,000	
積水ハウス・リート投資法人	34,912	2,792,960,000	
トーセイ・リート投資法人	2,446	342,440,000	貸付有価証券 256口
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,865	372,163,500	貸付有価証券 247口
サムティ・レジデンシャル投資法人	3,166	332,430,000	貸付有価証券 223口
野村不動産マスターファンド投資法人	37,571	5,444,037,900	
いちごホテルリート投資法人	1,925	213,675,000	
ラサールロジポート投資法人	14,851	2,220,224,500	
スターアジア不動産投資法人	17,905	1,074,300,000	
マリモ地方創生リート投資法人	1,791	234,083,700	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,832	2,118,832,000	
日本ホテル&レジデンシャル投資法人	1,777	135,229,700	貸付有価証券 187口
投資法人みらい	15,944	725,452,000	
三菱地所物流リート投資法人	4,012	1,532,584,000	
CRE ロジスティクスファンド投資法人	5,002	722,288,800	
ザイマックス・リート投資法人	1,885	226,765,500	貸付有価証券 177口
タカラレーベン不動産投資法人	6,189	614,567,700	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	5,091	627,211,200	
日本ビルファンド投資法人	13,554	8,064,630,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	11,934	6,146,010,000	
日本都市ファンド投資法人	55,689	5,112,250,200	
オリックス不動産投資法人	23,149	3,726,989,000	
日本プライムリアルティ投資法人	7,946	2,634,099,000	
N T T 都市開発リート投資法人	11,779	1,371,075,600	
東急リアル・エステート投資法人	7,790	1,228,483,000	貸付有価証券 775口
グローバル・ワン不動産投資法人	8,579	864,763,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	25,989	3,760,608,300	貸付有価証券 2,473口
森トラストリート投資法人	22,394	1,567,580,000	
インヴィンシブル投資法人	56,253	3,892,707,600	

フロンティア不動産投資法人	4,311	1,952,883,000	
平和不動産リート投資法人	9,004	1,209,237,200	貸付有価証券 720口
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,416	1,993,420,800	
福岡リート投資法人	6,009	968,049,900	
KDX不動産投資法人	32,921	5,290,404,700	貸付有価証券 3,156口
いちごオフィスリート投資法人	9,521	785,482,500	
大和証券オフィス投資法人	4,814	1,385,950,600	貸付有価証券 494口
阪急阪神リート投資法人	5,539	733,917,500	貸付有価証券 522口
スタートプロシード投資法人	2,014	407,230,800	
大和ハウスリート投資法人	17,513	4,336,218,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	38,892	2,967,459,600	
大和証券リビング投資法人	17,109	1,793,023,200	
ジャパンエクセレント投資法人	10,097	1,236,882,500	
合計	740,918	116,582,625,500	

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）

[2024年 6月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	24,946,819,369
コール・ローン	7,808,902,069
株式	5,822,135,315,794
投資証券	108,126,792,786
派生商品評価勘定	278,095,712
未収入金	64,553,351
未収配当金	5,709,158,156
未収利息	13,555
差入委託証拠金	78,142,420,441
流動資産合計	6,047,212,071,233
資産合計	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	478,282,559
未払解約金	2,660,838,782
流動負債合計	3,139,121,341
負債合計	
純資産の部	
元本等	
元本	810,464,613,732
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,233,608,336,160

[2024年 6月25日現在]

元本等合計	6,044,072,949,892
純資産合計	6,044,072,949,892
負債純資産合計	6,047,212,071,233

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 6月25日現在]
1. 期首	2023年 6月27日
期首元本額	513,699,458,357円
期中追加設定元本額	368,062,572,882円
期中一部解約元本額	71,297,417,507円
元本の内訳	
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	166,519,583円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	887,790,600円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	892,867,431円
MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信	3,067,704,789円
MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信	6,236,844,809円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	1,235,617,158円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	8,014,995,778円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	9,915,798,959円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	38,541,890円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（成長型）	107,648,772円
ファンド・マネジャー（海外株式）	777,008円
eMAXIS 先進国株式インデックス	14,076,245,011円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	914,869,083円
eMAXIS バランス（波乗り型）	124,240,437円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	1,620,273,745円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	189,328,583円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	265,234,551円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	247,962,878円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	105,765,637,542円
海外株式セレクション（ラップ向け）	2,126,964,720円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	4,941,901,419円
つみたて先進国株式	35,840,778,656円
つみたて8資産均等バランス	2,466,198,150円
つみたて4資産均等バランス	921,748,862円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,868,585円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,332,897円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	7,163,685円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	161,220,753円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	216,203,381円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	154,206,354円

	[2024年 6月25日現在]
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式１５）	59,846,368円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式４０）	496,191,450円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式６５）	1,482,011,033円
eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）	63,781,994,517円
eMAXIS Slim 全世界株式（３地域均等型）	730,299,469円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金インデックス（先進国株式）	4,957,293,996円
eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）	426,927,697,046円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）	150,670,859円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式２５）	40,375,057円
つみたて全世界株式	3,366,475,850円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６５（確定拠出年金）	73,496,372円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	2,448,576,681円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式８０）	66,097,700円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	2,659,879,643円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	74,205,548円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	10,598,651円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	17,971,677円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０７０（確定拠出年金）	941,698円
三菱ＵＦＪ ＤＣ海外株式インデックスファンド	33,928,202,764円
eMAXIS 全世界株式インデックス	6,902,090,725円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	480,419,010円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	1,143,615,541円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	192,996,739円
三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	704,323,044円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	128,378,872円
eMAXIS バランス（４資産均等型）	379,404,925円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	75,666,776円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	112,726,823円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	508,915,755円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	434,333,852円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	911,918,964円
三菱ＵＦＪ 外国株式ファンドVA（適格機関投資家限定）	1,080,146,334円
三菱ＵＦＪ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	4,257,497円
三菱ＵＦＪ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	2,628,379,435円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	26,559,407円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	534,048,788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）	8,539,623,652円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	55,413円
三菱ＵＦＪ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	423,471,185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）	4,160,410,598円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	6,434,619円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	44,336,907円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	1,528,732,007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）	463,684,703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）	163,183,895円
世界８資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	52,856,697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）	1,493,814,468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）	68,314,458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）	2,565,196,293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）	82,874,954円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	7,112,893,708円

	[2024年 6月25日現在]
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付）	14,197,081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）	199,817円
海外株式インデックスファンドS	9,079,683,331円
外国株式インデックスオープンV（適格機関投資家限定）	274,859,225円
全世界株式インデックスファンドV（適格機関投資家限定）	145,901,846円
グローバルバランスオープンV（適格機関投資家限定）	1,358,695円
全世界株式（除く日本）インデックスファンドV（適格機関投資家限定）	41,760,429円
MUAM グローバルバランス（退職給付信託向け）（適格機関投資家限定）	4,776,531,798円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンド	2,965,386,007円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	585,968円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	1,426,255円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	377,095円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	1,592,087円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンドVA	19,741,373円
三菱ＵＦＪ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	660,397円
三菱ＵＦＪ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	5,631,086円
三菱ＵＦＪ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	628,221円
三菱ＵＦＪ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	6,594,779円
三菱ＵＦＪ <DC>外国株式インデックスファンド	7,243,784,458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）	68,454,375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）	293,812,980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）	331,275,052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）	352,792,885円
合計	810,464,613,732円
2. 受益権の総数	810,464,613,732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 2023年 6月27日 至 2024年 6月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク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	[2024年 6月25日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

区分	[2024年 6月25日現在]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記) に記載しております。
	(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
	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	[2024年 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	153,982,790,981
投資証券	2,200,016,426
合計	156,182,807,407

(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

[2024年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	121,952,346,960	—	121,755,810,856	196,536,104
合計		121,952,346,960	—	121,755,810,856	196,536,104

(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

[2024年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	10,405,260,312	—	10,398,461,532	6,798,780
	カナダドル	745,750,992	—	747,877,063	2,126,071
	オーストラリアドル	260,363,519	—	260,379,698	16,179
	イギリスポンド	447,817,195	—	447,946,050	128,855
	スイスフラン	360,165,816	—	360,163,984	1,832
	香港ドル	33,248,778	—	33,169,737	79,041
	シンガポールドル	49,892,427	—	49,900,041	7,614
	ニュージーランドドル	24,345,477	—	24,311,115	34,362

	スウェーデンク ローネ	92,692,344	—	92,723,339	30,995
	デンマーククロ ーネ	154,589,724	—	154,706,164	116,440
	ユーロ	1,206,025,763	—	1,206,862,881	837,118
合計		13,780,152,347	—	13,776,501,604	3,650,743

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

- （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）

	[2024年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	7.4575円
(1万口当たり純資産額)	(74,575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	220,657	29.34	6,474,076.38	
	BAKER HUGHES CO	593,714	34.41	20,429,698.74	
	CHENIERE ENERGY INC	135,380	165.96	22,467,664.80	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	69,421	84.78	5,885,512.38	
	CHEVRON CORP	1,044,372	159.31	166,378,903.32	
	CHORD ENERGY CORP	36,000	168.90	6,080,400.00	
	CONOCOPHILLIPS	701,781	115.17	80,824,117.77	
	COTERRA ENERGY INC	444,081	27.65	12,278,839.65	
	DEVON ENERGY CORP	374,397	47.64	17,836,273.08	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	98,666	198.03	19,538,827.98	
	EOG RESOURCES INC	347,149	125.30	43,497,769.70	
	EQT CORP	253,672	38.52	9,771,445.44	
	EXXON MOBIL CORP	2,669,118	114.05	304,412,907.90	
	HALLIBURTON CO	539,772	34.34	18,535,770.48	
	HESS CORP	161,590	150.37	24,298,288.30	
	HF SINCLAIR CORP	99,576	53.81	5,358,184.56	
	KINDER MORGAN INC	1,193,504	20.11	24,001,365.44	

MARATHON OIL CORP	355,072	28.74	10,204,769.28
MARATHON PETROLEUM CORP	214,673	173.99	37,350,955.27
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	393,509	63.25	24,889,444.25
ONEOK INC	348,473	80.89	28,187,980.97
OVINTIV INC	156,183	47.21	7,373,399.43
PHILLIPS 66	252,751	138.55	35,018,651.05
SCHLUMBERGER LTD	841,519	47.48	39,955,322.12
TARGA RESOURCES CORP	125,671	128.60	16,161,290.60
TEXAS PACIFIC LAND CORP	11,740	747.70	8,777,998.00
VALERO ENERGY CORP	196,645	150.73	29,640,300.85
WILLIAMS COS INC	726,040	43.11	31,299,584.40
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	132,809	270.90	35,977,958.10
ALBEMARLE CORP	72,787	96.40	7,016,666.80
AMCOR PLC	830,703	10.01	8,315,337.03
AVERY DENNISON CORP	47,408	229.52	10,881,084.16
BALL CORP	181,633	61.58	11,184,960.14
CELANESE CORP	69,532	139.05	9,668,424.60
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	113,599	75.60	8,588,084.40
CLEVELAND-CLIFFS INC	275,888	14.74	4,066,589.12
CORTEVA INC	413,021	52.91	21,852,941.11
CRH PLC	402,939	74.10	29,857,779.90
CROWN HOLDINGS INC	73,912	79.20	5,853,830.40
DOW INC	423,533	54.62	23,133,372.46
DUPONT DE NEMOURS INC	250,741	81.08	20,330,080.28
EASTMAN CHEMICAL CO	72,970	100.65	7,344,430.50
ECOLAB INC	153,251	244.64	37,491,324.64
FREEPORT-MCMORAN INC	848,529	50.38	42,748,891.02
INTERNATIONAL PAPER CO	197,342	47.32	9,338,223.44
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	145,984	97.86	14,285,994.24
LINDE PLC	286,616	443.14	127,011,014.24
LYONDELLBASELL INDU-CL A	154,531	97.52	15,069,863.12
MARTIN MARIETTA MATERIALS	36,908	541.17	19,973,502.36
MOSAIC CO/THE	174,017	29.11	5,065,634.87
NEWMONT CORP	675,828	42.60	28,790,272.80
NUCOR CORP	144,492	155.56	22,477,175.52
PACKAGING CORP OF AMERICA	55,207	189.76	10,476,080.32
PPG INDUSTRIES INC	136,514	128.15	17,494,269.10
RELIANCE INC	32,720	282.10	9,230,312.00
RPM INTERNATIONAL INC	77,162	109.94	8,483,190.28
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	144,005	300.55	43,280,702.75
STEEL DYNAMICS INC	87,241	126.34	11,022,027.94
VULCAN MATERIALS CO	79,155	247.58	19,597,194.90

WESTLAKE CORP	25,469	150.46	3,832,065.74
WESTROCK CO	151,038	51.09	7,716,531.42
3M CO	326,811	102.99	33,658,264.89
AECOM	82,034	91.10	7,473,297.40
AERCAP HOLDINGS NV	120,566	93.31	11,250,013.46
ALLEGION PLC	47,118	118.39	5,578,300.02
AMETEK INC	137,964	171.46	23,655,307.44
AXON ENTERPRISE INC	43,457	292.70	12,719,863.90
BOEING CO/THE	345,680	179.10	61,911,288.00
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	71,496	142.22	10,168,161.12
CARLISLE COS INC	28,880	426.43	12,315,298.40
CARRIER GLOBAL CORP	484,742	64.63	31,328,875.46
CATERPILLAR INC	297,143	330.00	98,057,190.00
CNH INDUSTRIAL NV	529,492	10.20	5,400,818.40
CUMMINS INC	81,646	283.96	23,184,198.16
DEERE & CO	157,488	378.17	59,557,236.96
DOVER CORP	81,759	184.40	15,076,359.60
EATON CORP PLC	237,816	322.08	76,595,777.28
EMCOR GROUP INC	27,910	380.78	10,627,569.80
EMERSON ELECTRIC CO	340,781	109.32	37,254,178.92
FASTENAL CO	339,252	65.04	22,064,950.08
FERGUSON PLC	120,783	195.37	23,597,374.71
FORTIVE CORP	205,604	74.24	15,264,040.96
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	73,576	67.12	4,938,421.12
GE VERNOVA INC	162,132	178.14	28,882,194.48
GENERAL DYNAMICS CORP	139,085	298.53	41,521,045.05
GENERAL ELECTRIC CO	650,673	160.54	104,459,043.42
GRACO INC	105,925	79.79	8,451,755.75
HEICO CORP	23,226	227.45	5,282,753.70
HEICO CORP-CLASS A	47,152	178.71	8,426,533.92
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	387,958	215.89	83,756,252.62
HOWMET AEROSPACE INC	232,071	78.63	18,247,742.73
HUBBELL INC	31,805	379.56	12,071,905.80
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	25,628	251.20	6,437,753.60
IDEX CORP	47,065	204.50	9,624,792.50
ILLINOIS TOOL WORKS	178,691	242.59	43,348,649.69
INGERSOLL-RAND INC	235,808	92.92	21,911,279.36
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	84,100	36.76	3,091,516.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	406,088	68.77	27,926,671.76
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	113,719	225.49	25,642,497.31
LENNOX INTERNATIONAL INC	19,484	547.32	10,663,982.88
LOCKHEED MARTIN CORP	128,990	471.51	60,820,074.90

MASCO CORP	135,869	68.09	9,251,320.21
NORDSON CORP	34,650	232.27	8,048,155.50
NORTHROP GRUMMAN CORP	83,958	430.67	36,158,191.86
OTIS WORLDWIDE CORP	241,010	96.87	23,346,638.70
OWENS CORNING	53,631	178.24	9,559,189.44
PACCAR INC	312,672	106.89	33,421,510.08
PARKER HANNIFIN CORP	75,859	510.29	38,710,089.11
PENTAIR PLC	101,158	80.00	8,092,640.00
QUANTA SERVICES INC	87,412	274.23	23,970,992.76
ROCKWELL AUTOMATION INC	66,320	265.87	17,632,498.40
RTX CORP	791,396	101.96	80,690,736.16
SMITH (A.O.) CORP	75,351	84.43	6,361,884.93
SNAP-ON INC	31,639	267.40	8,460,268.60
STANLEY BLACK & DECKER INC	85,688	84.74	7,261,201.12
TEXTRON INC	113,409	87.48	9,921,019.32
TORO CO	66,459	94.98	6,312,275.82
TRANE TECHNOLOGIES PLC	135,200	338.14	45,716,528.00
TRANSDIGM GROUP INC	32,879	1,328.05	43,664,955.95
UNITED RENTALS INC	40,208	645.37	25,949,036.96
VERTIV HOLDINGS CO-A	215,191	89.14	19,182,125.74
WABTEC CORP	102,624	162.01	16,626,114.24
WATSCO INC	20,130	482.47	9,712,121.10
WW GRAINGER INC	26,323	915.50	24,098,706.50
XYLEM INC	144,817	138.34	20,033,983.78
AUTOMATIC DATA PROCESSING	244,766	249.20	60,995,687.20
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	75,179	157.22	11,819,642.38
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	71,234	201.84	14,377,870.56
CINTAS CORP	54,425	711.00	38,696,175.00
COPART INC	518,391	54.90	28,459,665.90
DAYFORCE INC	81,226	50.21	4,078,357.46
EQUIFAX INC	72,867	240.33	17,512,126.11
JACOBS SOLUTIONS INC	74,200	142.09	10,543,078.00
LEIDOS HOLDINGS INC	76,768	148.56	11,404,654.08
PAYCHEX INC	193,743	126.08	24,427,117.44
PAYCOM SOFTWARE INC	35,074	145.00	5,085,730.00
PAYLOCITY HOLDING CORP	24,837	135.10	3,355,478.70
REPUBLIC SERVICES INC	130,386	194.66	25,380,938.76
ROLLINS INC	176,448	49.92	8,808,284.16
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	132,756	63.13	8,380,886.28
TRANSUNION	118,417	75.55	8,946,404.35
VERALTO CORP	147,431	99.75	14,706,242.25
VERISK ANALYTICS INC	85,451	271.77	23,223,018.27

WASTE CONNECTIONS INC	153,566	175.58	26,963,118.28
WASTE MANAGEMENT INC	239,454	212.44	50,869,607.76
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	75,471	88.49	6,678,428.79
CSX CORP	1,166,495	33.21	38,739,298.95
DELTA AIR LINES INC	96,256	49.40	4,755,046.40
EXPEDITORS INTL WASH INC	85,680	126.98	10,879,646.40
FEDEX CORP	139,441	256.51	35,768,010.91
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	1,217,326	3.53	4,297,160.78
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	51,842	157.97	8,189,480.74
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	86,238	48.89	4,216,175.82
NORFOLK SOUTHERN CORP	135,064	218.68	29,535,795.52
OLD DOMINION FREIGHT LINE	117,111	176.07	20,619,733.77
SOUTHWEST AIRLINES CO	96,494	28.49	2,749,114.06
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	55,698	60.99	3,397,021.02
UBER TECHNOLOGIES INC	1,116,177	70.54	78,735,125.58
UNION PACIFIC CORP	362,529	226.36	82,062,064.44
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	433,555	138.60	60,090,723.00
APTIV PLC	162,072	76.09	12,332,058.48
FORD MOTOR CO	2,336,882	12.23	28,580,066.86
GENERAL MOTORS CO	689,472	48.11	33,170,497.92
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	458,916	11.01	5,052,665.16
TESLA INC	1,706,316	182.58	311,539,175.28
DECKERS OUTDOOR CORP	15,095	978.08	14,764,117.60
DR HORTON INC	179,113	144.05	25,801,227.65
GARMIN LTD	92,146	162.29	14,954,374.34
LENNAR CORP-A	142,731	150.66	21,503,852.46
LULULEMON ATHLETICA INC	68,961	312.28	21,535,141.08
NIKE INC -CL B	722,321	97.17	70,187,931.57
NVR INC	1,822	7,740.78	14,103,701.16
PULTEGROUP INC	124,567	112.68	14,036,209.56
AIRBNB INC-CLASS A	263,819	148.39	39,148,101.41
BOOKING HOLDINGS INC	20,352	3,981.20	81,025,382.40
CAESARS ENTERTAINMENT INC	115,054	38.99	4,485,955.46
CARNIVAL CORP	615,701	16.39	10,091,339.39
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	16,485	3,193.74	52,648,803.90
DARDEN RESTAURANTS INC	69,659	154.13	10,736,541.67
DOMINO'S PIZZA INC	20,479	533.42	10,923,908.18
DOORDASH INC - A	167,406	110.70	18,531,844.20
DRAFTKINGS INC-CL A	259,420	40.01	10,379,394.20
EXPEDIA GROUP INC	79,073	128.16	10,133,995.68
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	150,791	217.04	32,727,678.64
HYATT HOTELS CORP - CL A	24,388	150.27	3,664,784.76

LAS VEGAS SANDS CORP	225,905	44.84	10,129,580.20
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	145,398	245.66	35,718,472.68
MCDONALD'S CORP	429,151	260.38	111,742,337.38
MGM RESORTS INTERNATIONAL	154,928	42.45	6,576,693.60
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	146,154	154.52	22,583,716.08
STARBUCKS CORP	676,535	79.73	53,940,135.55
WYNN RESORTS LTD	54,362	89.10	4,843,654.20
YUM! BRANDS INC	168,884	133.99	22,628,767.16
ALPHABET INC-CL A	3,507,171	179.22	628,555,186.62
ALPHABET INC-CL C	3,036,997	180.79	549,058,687.63
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	56,692	285.85	16,205,408.20
COMCAST CORP-CLASS A	2,362,596	38.48	90,912,694.08
ELECTRONIC ARTS INC	152,181	141.23	21,492,522.63
FOX CORP - CLASS A	120,205	34.46	4,142,264.30
FOX CORP - CLASS B	88,642	32.07	2,842,748.94
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	239,094	29.51	7,055,663.94
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	109,976	72.02	7,920,471.52
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	96,075	89.38	8,587,183.50
MATCH GROUP INC	170,281	30.80	5,244,654.80
META PLATFORMS INC-CLASS A	1,303,990	498.91	650,573,650.90
NETFLIX INC	257,760	669.02	172,446,595.20
NEWS CORP - CLASS A	205,514	27.51	5,653,690.14
OMNICOM GROUP	113,234	90.73	10,273,720.82
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	317,208	10.29	3,264,070.32
PINTEREST INC- CLASS A	357,685	43.12	15,423,377.20
ROBLOX CORP -CLASS A	286,836	35.19	10,093,758.84
ROKU INC	78,724	54.45	4,286,521.80
SEA LTD-ADR	212,887	75.89	16,155,994.43
SNAP INC - A	613,729	15.67	9,617,133.43
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	95,193	159.71	15,203,274.03
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	266,299	95.76	25,500,792.24
WALT DISNEY CO/THE	1,092,844	101.98	111,448,231.12
WARNER BROS DISCOVERY INC	1,344,492	7.31	9,828,236.52
AMAZON.COM INC	5,571,070	185.57	1,033,823,459.90
AUTOZONE INC	10,211	2,985.44	30,484,327.84
BATH & BODY WORKS INC	130,365	41.50	5,410,147.50
BEST BUY CO INC	118,391	89.33	10,575,868.03
BURLINGTON STORES INC	37,211	242.53	9,024,783.83
CARMAX INC	97,497	73.18	7,134,830.46
DICK'S SPORTING GOODS INC	33,562	229.78	7,711,876.36
EBAY INC	298,311	54.01	16,111,777.11
ETSY INC	73,449	59.95	4,403,267.55

GENUINE PARTS CO	83,745	142.05	11,895,977.25
GLOBAL-E ONLINE LTD	65,600	32.10	2,105,760.00
HOME DEPOT INC	590,039	350.88	207,032,884.32
LKQ CORP	157,065	41.97	6,592,018.05
LOWE'S COS INC	340,917	228.39	77,862,033.63
MERCADOLIBRE INC	26,855	1,582.86	42,507,705.30
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	34,821	1,083.52	37,729,249.92
POOL CORP	21,752	337.91	7,350,218.32
ROSS STORES INC	200,794	149.25	29,968,504.50
TJX COMPANIES INC	674,447	111.05	74,897,339.35
TRACTOR SUPPLY COMPANY	63,516	277.37	17,617,432.92
ULTA BEAUTY INC	29,313	389.72	11,423,862.36
WILLIAMS-SONOMA INC	36,901	307.55	11,348,902.55
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	183,466	19.79	3,630,792.14
COSTCO WHOLESALE CORP	264,499	848.16	224,337,471.84
DOLLAR GENERAL CORP	126,974	130.49	16,568,837.26
DOLLAR TREE INC	124,919	107.35	13,410,054.65
KROGER CO	409,658	50.02	20,491,093.16
SYSCO CORP	297,984	74.58	22,223,646.72
TARGET CORP	271,942	149.69	40,706,997.98
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	463,168	15.91	7,369,002.88
WALMART INC	2,634,480	68.90	181,515,672.00
ALTRIA GROUP INC	1,024,165	46.45	47,572,464.25
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	296,589	62.13	18,427,074.57
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	123,147	43.66	5,376,598.02
BUNGE GLOBAL SA	83,582	108.17	9,041,064.94
CAMPBELL SOUP CO	120,360	45.27	5,448,697.20
CELSIUS HOLDINGS INC	100,388	59.77	6,000,190.76
COCA-COLA CO/THE	2,445,044	63.97	156,409,464.68
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	116,740	75.97	8,868,737.80
CONAGRA BRANDS INC	284,657	29.34	8,351,836.38
CONSTELLATION BRANDS INC-A	97,400	265.13	25,823,662.00
GENERAL MILLS INC	334,850	68.07	22,793,239.50
HERSHEY CO/THE	89,177	187.30	16,702,852.10
HORMEL FOODS CORP	189,173	30.96	5,856,796.08
JM SMUCKER CO/THE	67,667	111.86	7,569,230.62
KELLANOVA	155,222	58.26	9,043,233.72
KEURIG DR PEPPER INC	648,712	34.67	22,490,845.04
KRAFT HEINZ CO/THE	539,608	33.21	17,920,381.68
LAMB WESTON HOLDINGS INC	79,379	84.95	6,743,246.05
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	148,517	69.20	10,277,376.40
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	99,682	51.40	5,123,654.80

MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	803,762	68.42	54,993,396.04
MONSTER BEVERAGE CORP	448,501	49.49	22,196,314.49
PEPSICO INC	817,917	168.08	137,475,489.36
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	924,033	101.87	94,131,241.71
TYSON FOODS INC-CL A	165,986	57.68	9,574,072.48
CHURCH & DWIGHT CO INC	146,911	107.48	15,789,994.28
CLOROX COMPANY	70,270	136.12	9,565,152.40
COLGATE-PALMOLIVE CO	466,218	98.99	46,150,919.82
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	140,245	115.13	16,146,406.85
KENVUE INC	1,154,935	18.90	21,828,271.50
KIMBERLY-CLARK CORP	197,469	139.70	27,586,419.30
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,399,438	168.45	235,735,331.10
ABBOTT LABORATORIES	1,032,489	105.30	108,721,091.70
ALIGN TECHNOLOGY INC	43,175	237.08	10,235,929.00
BAXTER INTERNATIONAL INC	311,132	34.19	10,637,603.08
BECTON DICKINSON AND CO	170,891	235.91	40,314,895.81
BOSTON SCIENTIFIC CORP	873,923	76.71	67,038,633.33
CARDINAL HEALTH INC	146,172	104.90	15,333,442.80
CENCORA INC	107,448	239.36	25,718,753.28
CENTENE CORP	318,203	68.04	21,650,532.12
COOPER COS INC/THE	119,122	89.81	10,698,346.82
CVS HEALTH CORP	741,928	61.73	45,799,215.44
DAVITA INC	29,535	143.88	4,249,495.80
DEXCOM INC	230,630	110.57	25,500,759.10
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	359,436	90.17	32,410,344.12
ELEVANCE HEALTH INC	138,410	541.71	74,978,081.10
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	254,562	78.85	20,072,213.70
HCA HEALTHCARE INC	118,152	341.37	40,333,548.24
HENRY SCHEIN INC	70,861	67.27	4,766,819.47
HOLOGIC INC	144,223	72.48	10,453,283.04
HUMANA INC	71,884	358.04	25,737,347.36
IDEXX LABORATORIES INC	49,687	491.49	24,420,663.63
INSULET CORP	41,321	203.94	8,427,004.74
INTUITIVE SURGICAL INC	211,086	429.04	90,564,337.44
LABCORP HOLDINGS INC	50,788	208.00	10,563,904.00
MCKESSON CORP	78,196	607.81	47,528,310.76
MEDTRONIC PLC	792,145	81.04	64,195,430.80
MOLINA HEALTHCARE INC	35,487	308.98	10,964,773.26
QUEST DIAGNOSTICS INC	68,501	140.23	9,605,895.23
RESMED INC	88,892	182.20	16,196,122.40
SOLVENTUM CORP	89,642	51.30	4,598,634.60
STERIS PLC	59,503	216.56	12,885,969.68

STRYKER CORP	203,677	339.07	69,060,760.39
TELEFLEX INC	29,262	200.73	5,873,761.26
THE CIGNA GROUP	169,038	343.14	58,003,699.32
UNITEDHEALTH GROUP INC	548,652	489.98	268,828,506.96
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	31,888	191.01	6,090,926.88
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	88,545	186.70	16,531,351.50
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	117,535	108.46	12,747,846.10
ABBVIE INC	1,054,544	172.74	182,161,930.56
AGILENT TECHNOLOGIES INC	175,421	135.08	23,695,868.68
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	73,985	222.90	16,491,256.50
AMGEN INC	319,406	318.15	101,619,018.90
AVANTOR INC	389,080	22.50	8,754,300.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	11,720	283.88	3,327,073.60
BIO-TECHNE CORP	96,405	74.49	7,181,208.45
BIOGEN INC	86,956	226.60	19,704,229.60
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	118,650	85.14	10,101,861.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,211,235	42.23	51,150,454.05
CATALENT INC	109,349	56.47	6,174,938.03
CHARLES RIVER LABORATORIES	29,813	209.85	6,256,258.05
DANAHER CORP	418,877	256.76	107,550,858.52
ELI LILLY & CO	480,913	890.11	428,065,470.43
EXACT SCIENCES CORP	103,405	41.95	4,337,839.75
GILEAD SCIENCES INC	745,108	70.73	52,701,488.84
ILLUMINA INC	91,078	110.24	10,040,438.72
INCYTE CORP	115,210	63.75	7,344,637.50
IQVIA HOLDINGS INC	107,104	214.09	22,929,895.36
JOHNSON & JOHNSON	1,432,762	149.12	213,653,469.44
MERCK & CO. INC.	1,506,810	132.96	200,345,457.60
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	12,868	1,453.98	18,709,814.64
MODERNA INC	190,577	137.00	26,109,049.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	60,837	133.62	8,129,039.94
PFIZER INC	3,366,652	28.36	95,478,250.72
REGENERON PHARMACEUTICALS	64,363	1,063.89	68,475,152.07
REPLIGEN CORP	27,634	123.65	3,416,944.10
REVVITY INC	76,788	106.90	8,208,637.20
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	208,355	27.11	5,648,504.05
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	671,525	16.49	11,073,447.25
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	227,234	565.95	128,603,082.30
UNITED THERAPEUTICS CORP	24,588	318.94	7,842,096.72
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	153,999	474.95	73,141,825.05
VIATRIS INC	726,962	10.47	7,611,292.14
WATERS CORP	35,175	289.27	10,175,072.25

WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	43,055	331.00	14,251,205.00
ZOETIS INC	270,463	171.84	46,476,361.92
BANK OF AMERICA CORP	4,228,403	40.02	169,220,688.06
CITIGROUP INC	1,142,740	61.34	70,095,671.60
CITIZENS FINANCIAL GROUP	256,640	35.39	9,082,489.60
FIFTH THIRD BANCORP	394,016	36.64	14,436,746.24
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	6,156	1,640.93	10,101,565.08
HUNTINGTON BANCSHARES INC	909,206	12.98	11,801,493.88
JPMORGAN CHASE & CO	1,708,697	198.88	339,825,659.36
KEYCORP	568,234	13.92	7,909,817.28
M & T BANK CORP	100,291	149.59	15,002,530.69
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	237,992	154.90	36,864,960.80
REGIONS FINANCIAL CORP	526,791	19.31	10,172,334.21
TRUIST FINANCIAL CORP	802,257	37.46	30,052,547.22
US BANCORP	918,645	40.55	37,251,054.75
WELLS FARGO & CO	2,106,901	59.01	124,328,228.01
ALLY FINANCIAL INC	150,075	40.40	6,063,030.00
AMERICAN EXPRESS CO	342,915	231.47	79,374,535.05
AMERIPRISE FINANCIAL INC	59,388	440.35	26,151,505.80
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	314,765	20.17	6,348,810.05
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	238,294	118.28	28,185,414.32
ARES MANAGEMENT CORP - A	108,433	133.85	14,513,757.05
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	451,190	59.48	26,836,781.20
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	780,398	413.98	323,069,164.04
BLACKROCK INC	88,687	798.95	70,856,478.65
BLACKSTONE INC	421,522	125.26	52,799,845.72
BLOCK INC	333,864	64.40	21,500,841.60
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	228,788	137.68	31,499,531.84
CARLYLE GROUP INC/THE	126,277	40.47	5,110,430.19
CBOE GLOBAL MARKETS INC	62,382	171.33	10,687,908.06
CME GROUP INC	214,666	195.08	41,877,043.28
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	111,163	212.31	23,601,016.53
COREBRIDGE FINANCIAL INC	135,682	29.55	4,009,403.10
CORPAY INC	40,935	269.67	11,038,941.45
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	147,039	127.67	18,772,469.13
EQUITABLE HOLDINGS INC	194,443	41.43	8,055,773.49
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	21,946	424.89	9,324,635.94
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	345,987	75.55	26,139,317.85
FISERV INC	352,483	150.27	52,967,620.41
FRANKLIN RESOURCES INC	152,703	23.17	3,538,128.51
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	37,000	69.46	2,570,020.00
GLOBAL PAYMENTS INC	151,430	97.04	14,694,767.20

GOLDMAN SACHS GROUP INC	193,365	462.09	89,352,032.85
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	341,231	138.72	47,335,564.32
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	46,021	166.43	7,659,275.03
KKR & CO INC	370,316	107.47	39,797,860.52
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	42,069	277.68	11,681,719.92
MARKETAXESS HOLDINGS INC	23,552	196.29	4,623,022.08
MASTERCARD INC - A	495,140	456.96	226,259,174.40
MOODY'S CORP	96,730	425.64	41,172,157.20
MORGAN STANLEY	731,364	97.10	71,015,444.40
MSCI INC	47,493	489.16	23,231,675.88
NASDAQ INC	240,048	60.10	14,426,884.80
NORTHERN TRUST CORP	120,683	83.51	10,078,237.33
PAYPAL HOLDINGS INC	587,337	59.49	34,940,678.13
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	119,700	122.38	14,648,886.00
ROBINHOOD MARKETS INC - A	320,415	21.37	6,847,268.55
S&P GLOBAL INC	191,130	444.97	85,047,116.10
SCHWAB (CHARLES) CORP	898,470	74.53	66,962,969.10
SEI INVESTMENTS COMPANY	60,138	66.68	4,010,001.84
STATE STREET CORP	173,980	72.94	12,690,101.20
SYNCHRONY FINANCIAL	247,847	45.52	11,281,995.44
T ROWE PRICE GROUP INC	135,044	118.88	16,054,030.72
TOAST INC-CLASS A	214,297	25.59	5,483,860.23
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	69,891	104.40	7,296,620.40
VISA INC-CLASS A SHARES	940,343	276.30	259,816,770.90
AFLAC INC	327,985	90.43	29,659,683.55
ALLSTATE CORP	157,040	162.41	25,504,866.40
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	45,623	126.53	5,772,678.19
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	406,176	76.01	30,873,437.76
AON PLC-CLASS A	118,302	298.46	35,308,414.92
ARCH CAPITAL GROUP LTD	223,535	102.43	22,896,690.05
ARTHUR J GALLAGHER & CO	128,171	265.19	33,989,667.49
ASSURANT INC	28,492	169.24	4,821,986.08
BROWN & BROWN INC	142,201	93.34	13,273,041.34
CHUBB LTD	239,010	266.12	63,605,341.20
CINCINNATI FINANCIAL CORP	89,731	116.61	10,463,531.91
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	15,257	362.33	5,528,068.81
EVEREST GROUP LTD	26,294	382.01	10,044,570.94
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	152,029	49.78	7,568,003.62
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	176,597	104.42	18,440,258.74
LOEWS CORP	113,501	77.33	8,777,032.33
MARKEL GROUP INC	7,876	1,591.99	12,538,513.24
MARSH & MCLENNAN COS	292,084	215.75	63,017,123.00

METLIFE INC	363,442	72.12	26,211,437.04
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	142,164	80.83	11,491,116.12
PROGRESSIVE CORP	348,076	210.68	73,332,651.68
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	211,962	119.16	25,257,391.92
TRAVELERS COS INC/THE	135,279	211.09	28,556,044.11
WILLIS TOWERS WATSON PLC	61,066	266.44	16,270,425.04
WR BERKLEY CORP	123,178	80.84	9,957,709.52
ACCENTURE PLC-CL A	374,425	307.21	115,027,104.25
ADOBE INC	266,796	524.17	139,846,459.32
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	90,523	88.74	8,033,011.02
ANSYS INC	50,694	321.10	16,277,843.40
APPROVIN CORP-CLASS A	102,190	78.05	7,975,929.50
ASPEN TECHNOLOGY INC	16,366	200.03	3,273,690.98
ATLASSIAN CORP-CL A	94,500	164.75	15,568,875.00
AUTODESK INC	128,581	239.17	30,752,717.77
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	115,702	50.37	5,827,909.74
CADENCE DESIGN SYS INC	160,465	309.14	49,606,150.10
CHECK POINT SOFTWARE TECH	53,285	155.98	8,311,394.30
CLOUDFLARE INC - CLASS A	180,968	78.60	14,224,084.80
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	288,979	68.68	19,847,077.72
CONFLUENT INC-CLASS A	134,592	27.34	3,679,745.28
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	135,382	377.93	51,164,919.26
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	25,510	261.34	6,666,783.40
DATADOG INC - CLASS A	163,948	118.49	19,426,198.52
DOCUSIGN INC	117,791	51.69	6,088,616.79
DYNATRACE INC	162,872	43.85	7,141,937.20
EPAM SYSTEMS INC	36,092	183.09	6,608,084.28
FAIR ISAAC CORP	14,910	1,441.50	21,492,765.00
FORTINET INC	388,884	58.28	22,664,159.52
GARTNER INC	46,386	451.09	20,924,260.74
GEN DIGITAL INC	348,898	24.08	8,401,463.84
GODADDY INC - CLASS A	83,207	138.41	11,516,680.87
HUBSPOT INC	27,985	573.60	16,052,196.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	545,782	175.01	95,517,307.82
INTUIT INC	166,912	623.88	104,133,058.56
MANHATTAN ASSOCIATES INC	38,101	241.47	9,200,438.97
MICROSOFT CORP	4,201,504	447.67	1,880,887,295.68
MICROSTRATEGY INC-CL A	9,234	1,372.15	12,670,433.10
MONDAY.COM LTD	23,133	221.68	5,128,123.44
MONGODB INC	40,846	233.92	9,554,696.32
OKTA INC	92,998	88.35	8,216,373.30
ORACLE CORP	981,611	139.89	137,317,562.79

PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	1,112,329	24.16	26,873,868.64
PALO ALTO NETWORKS INC	192,764	316.68	61,044,503.52
PTC INC	73,716	177.60	13,091,961.60
ROPER TECHNOLOGIES INC	63,789	562.55	35,884,501.95
SALESFORCE INC	578,191	239.94	138,731,148.54
SAMSARA INC-CL A	124,341	29.42	3,658,112.22
SERVICENOW INC	122,298	739.59	90,450,377.82
SNOWFLAKE INC-CLASS A	176,268	124.80	21,998,246.40
SYNOPSYS INC	91,026	595.60	54,215,085.60
TWILIO INC - A	101,280	54.81	5,551,156.80
TYLER TECHNOLOGIES INC	24,361	491.57	11,975,136.77
UIPATH INC - CLASS A	282,330	12.03	3,396,429.90
UNITY SOFTWARE INC	132,776	16.70	2,217,359.20
VERISIGN INC	55,384	180.00	9,969,120.00
WIX.COM LTD	30,341	158.05	4,795,395.05
WORKDAY INC-CLASS A	126,499	218.70	27,665,331.30
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	140,544	57.81	8,124,848.64
ZSCALER INC	53,450	181.06	9,677,657.00
AMPHENOL CORP-CL A	710,442	67.27	47,791,433.34
APPLE INC	8,728,915	208.14	1,816,836,368.10
ARISTA NETWORKS INC	158,924	329.21	52,319,370.04
CDW CORP/DE	81,099	231.61	18,783,339.39
CISCO SYSTEMS INC	2,407,847	47.28	113,843,006.16
CORNING INC	475,112	39.90	18,956,968.80
DELL TECHNOLOGIES -C	153,369	137.56	21,097,439.64
F5 INC	35,964	168.68	6,066,407.52
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	782,384	20.47	16,015,400.48
HP INC	575,014	36.30	20,873,008.20
JABIL INC	73,665	112.98	8,322,671.70
JUNIPER NETWORKS INC	197,588	35.54	7,022,277.52
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	102,332	136.91	14,010,274.12
MOTOROLA SOLUTIONS INC	99,146	388.16	38,484,511.36
NETAPP INC	121,738	126.38	15,385,248.44
PURE STORAGE INC - CLASS A	183,656	62.82	11,537,269.92
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	116,599	103.33	12,048,174.67
SUPER MICRO COMPUTER INC	31,536	826.98	26,079,641.28
TE CONNECTIVITY LTD	184,908	151.10	27,939,598.80
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	27,598	391.23	10,797,165.54
TRIMBLE INC	149,329	56.13	8,381,836.77
WESTERN DIGITAL CORP	188,209	75.40	14,190,958.60
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	30,509	306.71	9,357,415.39
AT&T INC	4,256,103	18.65	79,376,320.95

T-MOBILE US INC	317,516	177.95	56,501,972.20
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,502,006	41.17	103,007,587.02
AES CORP	433,324	18.99	8,228,822.76
ALLIANT ENERGY CORP	149,496	51.13	7,643,730.48
AMEREN CORPORATION	162,603	71.15	11,569,203.45
AMERICAN ELECTRIC POWER	308,886	88.14	27,225,212.04
AMERICAN WATER WORKS CO INC	118,652	132.18	15,683,421.36
ATMOS ENERGY CORP	91,064	118.02	10,747,373.28
CENTERPOINT ENERGY INC	388,890	31.31	12,176,145.90
CMS ENERGY CORP	173,174	60.77	10,523,783.98
CONSOLIDATED EDISON INC	202,194	91.27	18,454,246.38
CONSTELLATION ENERGY	187,933	216.10	40,612,321.30
DOMINION ENERGY INC	493,643	49.90	24,632,785.70
DTE ENERGY COMPANY	125,990	112.80	14,211,672.00
DUKE ENERGY CORP	459,439	101.51	46,637,652.89
EDISON INTERNATIONAL	229,651	72.76	16,709,406.76
ENTERGY CORP	127,518	107.73	13,737,514.14
ESSENTIAL UTILITIES INC	146,859	37.94	5,571,830.46
EVERGY INC	138,949	53.37	7,415,708.13
EVERSOURCE ENERGY	211,633	58.00	12,274,714.00
EXELON CORP	590,677	35.33	20,868,618.41
FIRSTENERGY CORP	313,958	38.50	12,087,383.00
NEXTERA ENERGY INC	1,222,266	73.85	90,264,344.10
NISOURCE INC	260,713	28.88	7,529,391.44
NRG ENERGY INC	127,510	81.56	10,399,715.60
P G & E CORP	1,215,697	17.71	21,529,993.87
PPL CORP	421,673	28.17	11,878,528.41
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	292,361	74.75	21,853,984.75
SEMPRA	378,840	76.45	28,962,318.00
SOUTHERN CO/THE	657,671	79.34	52,179,617.14
VISTRA CORP	205,590	88.23	18,139,205.70
WEC ENERGY GROUP INC	192,004	79.35	15,235,517.40
XCEL ENERGY INC	322,605	53.98	17,414,217.90
ADVANCED MICRO DEVICES	962,927	160.25	154,309,051.75
ANALOG DEVICES INC	296,054	228.46	67,636,496.84
APPLIED MATERIALS INC	494,538	229.84	113,664,613.92
BROADCOM INC	262,023	1,592.21	417,195,640.83
ENPHASE ENERGY INC	80,001	108.02	8,641,708.02
ENTEGRIS INC	85,564	131.31	11,235,408.84
FIRST SOLAR INC	59,428	261.28	15,527,347.84
INTEL CORP	2,537,652	30.57	77,576,021.64
KLA CORP	80,558	793.98	63,961,440.84

	LAM RESEARCH CORP	78,086	1,024.42	79,992,860.12	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	84,503	56.65	4,787,094.95	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	510,365	67.77	34,587,436.05	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	323,701	89.18	28,867,655.18	
	MICRON TECHNOLOGY INC	659,734	139.01	91,709,623.34	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	28,696	798.14	22,903,425.44	
	NVIDIA CORP	14,876,050	118.11	1,757,010,265.50	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	150,918	267.27	40,335,853.86	
	ON SEMICONDUCTOR	247,439	67.79	16,773,889.81	
	QORVO INC	59,269	113.53	6,728,809.57	
	QUALCOMM INC	664,476	200.84	133,453,359.84	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	96,505	104.96	10,129,164.80	
	TERADYNE INC	92,007	145.53	13,389,778.71	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	541,742	193.91	105,049,191.22	
	CBRE GROUP INC - A	184,948	89.26	16,508,458.48	
	COSTAR GROUP INC	245,565	74.36	18,260,213.40	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	487,100	3.21	1,563,591.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	82,122	47.02	3,861,376.44	
	アメリカドル 小計	215,716,093		27,810,557,333.61 (4,437,452,528,150)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	376,000	24.85	9,343,600.00	
	CAMECO CORP	253,500	68.89	17,463,615.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,262,600	48.73	61,526,498.00	
	CENOVUS ENERGY INC	801,500	26.31	21,087,465.00	
	ENBRIDGE INC	1,270,900	47.97	60,965,073.00	
	IMPERIAL OIL LTD	106,800	93.95	10,033,860.00	
	KEYERA CORP	124,900	36.72	4,586,328.00	
	MEG ENERGY CORP	137,000	28.96	3,967,520.00	
	PARKLAND CORP	89,200	37.67	3,360,164.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	351,932	50.02	17,603,638.64	
	SUNCOR ENERGY INC	769,600	51.77	39,842,192.00	
	TC ENERGY CORP	616,300	53.39	32,904,257.00	
	TOURMALINE OIL CORP	200,400	62.88	12,601,152.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	303,140	89.69	27,188,626.60	
	BARRICK GOLD CORP	993,700	22.83	22,686,171.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	82,500	72.21	5,957,325.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	400,400	18.18	7,279,272.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	116,100	161.75	18,779,175.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	418,900	18.04	7,556,956.00	
	KINROSS GOLD CORP	677,600	10.46	7,087,696.00	
	LUNDIN MINING CORP	362,100	15.06	5,453,226.00	
	NUTRIEN LTD	298,559	71.89	21,463,406.51	

PAN AMERICAN SILVER CORP	243,300	27.70	6,739,410.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	276,400	65.82	18,192,648.00	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	26,600	105.80	2,814,280.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	278,000	72.84	20,249,520.00	
CAE INC	166,100	26.38	4,381,718.00	
STANTEC INC	65,700	113.60	7,463,520.00	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	49,100	119.25	5,855,175.00	
WSP GLOBAL INC	74,400	211.45	15,731,880.00	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	211,400	23.95	5,063,030.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	120,300	51.73	6,223,119.00	
RB GLOBAL INC	111,800	106.88	11,949,184.00	
THOMSON REUTERS CORP	93,932	225.74	21,204,209.68	
AIR CANADA	62,200	17.01	1,058,022.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	320,800	161.58	51,834,864.00	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	551,700	108.90	60,080,130.00	
TFI INTERNATIONAL INC	48,600	191.40	9,302,040.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	162,200	58.16	9,433,552.00	
BRP INC/CA- SUB VOTING	15,700	89.16	1,399,812.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	74,300	52.20	3,878,460.00	
RESTAURANT BRANDS INTERN	181,010	95.85	17,349,808.50	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	34,500	138.28	4,770,660.00	
DOLLARAMA INC	168,100	126.06	21,190,686.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	458,500	78.42	35,955,570.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	108,000	34.46	3,721,680.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	92,800	156.50	14,523,200.00	
METRO INC/CN	149,700	75.53	11,306,841.00	
WESTON (GEORGE) LTD	36,011	193.94	6,983,973.34	
SAPUTO INC	150,300	30.20	4,539,060.00	
BANK OF MONTREAL	432,200	116.40	50,308,080.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	723,800	62.84	45,483,592.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	561,500	66.15	37,143,225.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	191,700	106.72	20,458,224.00	
ROYAL BANK OF CANADA	837,900	145.10	121,579,290.00	
TORONTO-DOMINION BANK	1,052,900	75.41	79,399,189.00	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	221,588	52.30	11,589,052.40	
BROOKFIELD CORP	810,950	56.63	45,924,098.50	
IGM FINANCIAL INC	39,400	38.34	1,510,596.00	
ONEX CORPORATION	41,700	97.00	4,044,900.00	
TMX GROUP LTD	176,300	38.00	6,699,400.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	12,000	1,525.05	18,300,600.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	176,800	39.09	6,911,112.00	
IA FINANCIAL CORP INC	58,800	86.09	5,062,092.00	

	INTACT FINANCIAL CORP	104,300	227.79	23,758,497.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	1,075,300	35.79	38,484,987.00	
	POWER CORP OF CANADA	361,500	38.28	13,838,220.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	355,700	67.07	23,856,799.00	
	CGI INC	125,700	136.08	17,105,256.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	12,000	3,848.34	46,180,080.00	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	50,600	129.13	6,533,978.00	
	OPEN TEXT CORP	144,900	40.12	5,813,388.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	722,300	87.82	63,432,386.00	
	BCE INC	57,900	45.41	2,629,239.00	
	QUEBECOR INC -CL B	98,000	28.96	2,838,080.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	217,400	51.93	11,289,582.00	
	TELUS CORP	231,200	21.64	5,003,168.00	
	ALTAGAS LTD	172,600	30.48	5,260,848.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	94,950	40.29	3,825,535.50	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	58,500	29.88	1,747,980.00	
	EMERA INC	160,600	45.98	7,384,388.00	
	FORTIS INC	299,500	53.78	16,107,110.00	
	HYDRO ONE LTD	199,400	39.32	7,840,408.00	
	NORTHLAND POWER INC	148,200	23.70	3,512,340.00	
	FIRSTSERVICE CORP	24,100	208.36	5,021,476.00	
	カナダドル 小計	24,397,272		1,567,810,465.67 (183,182,974,808)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	168,058	32.21	5,413,148.18	
	SANTOS LTD	1,889,577	7.50	14,171,827.50	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	1,140,450	26.97	30,757,936.50	
	BHP GROUP LTD	3,015,593	42.43	127,951,610.99	
	BLUESCOPE STEEL LTD	246,529	19.61	4,834,433.69	
	FORTESCUE LTD	1,019,659	21.26	21,677,950.34	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	263,533	47.44	12,502,005.52	
	MINERAL RESOURCES LTD	95,706	54.76	5,240,860.56	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	728,362	13.45	9,796,468.90	
	ORICA LTD	302,423	17.82	5,389,177.86	
	PILBARA MINERALS LTD	1,540,998	3.11	4,792,503.78	
	RIO TINTO LTD	221,957	118.99	26,410,663.43	
	SOUTH32 LTD	2,760,848	3.64	10,049,486.72	
	REECE LTD	130,639	25.81	3,371,792.59	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	123,115	37.57	4,625,430.55	
	BRAMBLES LTD	859,720	14.36	12,345,579.20	
	COMPUTERSHARE LTD	288,146	26.55	7,650,276.30	
	AURIZON HOLDINGS LTD	1,366,902	3.66	5,002,861.32	
	QANTAS AIRWAYS LTD	658,092	6.06	3,988,037.52	

	TRANSURBAN GROUP	1,818,456	12.68	23,058,022.08	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	342,680	49.01	16,794,746.80	
	LOTTERY CORP LTD/THE	1,165,622	5.15	6,002,953.30	
	CAR GROUP LTD	236,772	34.04	8,059,718.88	
	REA GROUP LTD	32,440	197.29	6,400,087.60	
	SEEK LTD	199,466	21.97	4,382,268.02	
	WESFARMERS LTD	678,072	65.30	44,278,101.60	
	COLES GROUP LTD	806,840	17.10	13,796,964.00	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	801,622	5.07	4,064,223.54	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	700,223	33.43	23,408,454.89	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	476,918	12.42	5,923,321.56	
	COCHLEAR LTD	38,183	323.75	12,361,746.25	
	PRO MEDICUS LTD	38,535	141.15	5,439,215.25	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	129,562	47.83	6,196,950.46	
	SONIC HEALTHCARE LTD	252,714	26.54	6,707,029.56	
	CSL LTD	285,352	292.01	83,325,637.52	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	1,764,829	28.65	50,562,350.85	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	993,419	126.80	125,965,529.20	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,842,771	35.96	66,266,045.16	
	WESTPAC BANKING CORP	2,064,259	27.15	56,044,631.85	
	ASX LTD	113,672	58.06	6,599,796.32	
	MACQUARIE GROUP LTD	213,218	199.27	42,487,950.86	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	138,803	33.25	4,615,199.75	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,429,616	6.68	9,549,834.88	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	1,517,475	3.70	5,614,657.50	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	894,442	17.57	15,715,345.94	
	SUNCORP GROUP LTD	763,385	16.64	12,702,726.40	
	WISETECH GLOBAL LTD	104,309	94.14	9,819,649.26	
	XERO LTD	89,163	131.33	11,709,776.79	
	TELSTRA GROUP LTD	2,180,806	3.62	7,894,517.72	
	APA GROUP	737,148	8.39	6,184,671.72	
	ORIGIN ENERGY LTD	1,048,250	10.66	11,174,345.00	
	オーストラリアドル 小計	40,719,329		1,029,078,521.96 (109,257,266,676)	
イギリスポンド	BP PLC	10,042,778	4.74	47,617,831.88	
	SHELL PLC	3,813,474	27.94	106,567,530.93	
	ANGLO AMERICAN PLC	757,736	25.00	18,943,400.00	
	ANTOFAGASTA PLC	229,746	21.21	4,872,912.66	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	81,986	40.98	3,359,786.28	
	ENDEAVOUR MINING PLC	106,898	16.83	1,799,093.34	
	GLENCORE PLC	6,205,618	4.59	28,514,814.71	
	MONDI PLC	239,805	15.05	3,609,065.25	

RIO TINTO PLC	672,931	52.28	35,180,832.68
ASHTED GROUP PLC	262,395	54.94	14,415,981.30
BAE SYSTEMS PLC	1,805,714	13.52	24,422,281.85
BUNZL PLC	205,485	30.54	6,275,511.90
DCC PLC	56,482	56.40	3,185,584.80
MELROSE INDUSTRIES PLC	818,590	5.81	4,760,919.44
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	5,032,000	4.71	23,715,816.00
SMITHS GROUP PLC	180,764	17.25	3,118,179.00
SPIRAX GROUP PLC	46,237	87.30	4,036,490.10
EXPERIAN PLC	539,897	36.87	19,906,002.39
INTERTEK GROUP PLC	105,981	47.78	5,063,772.18
RELX PLC	1,109,011	36.12	40,057,477.32
RENTOKIL INITIAL PLC	1,426,851	4.57	6,532,123.87
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	519,922	4.75	2,473,788.87
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	65,065	46.32	3,013,810.80
BURBERRY GROUP PLC	223,981	10.18	2,280,126.58
PERSIMMON PLC	218,440	13.65	2,982,798.20
TAYLOR WIMPEY PLC	2,505,525	1.44	3,607,956.00
COMPASS GROUP PLC	1,021,422	22.44	22,920,709.68
ENTAIN PLC	406,322	6.70	2,722,357.40
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	102,844	146.00	15,015,224.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	99,456	83.38	8,292,641.28
PEARSON PLC	322,789	9.75	3,149,775.06
WHITBREAD PLC	109,945	29.61	3,255,471.45
AUTO TRADER GROUP PLC	520,853	8.04	4,190,783.23
INFORMA PLC	861,202	8.68	7,482,122.97
WPP PLC	695,292	7.65	5,320,374.38
JD SPORTS FASHION PLC	1,458,356	1.29	1,895,133.62
KINGFISHER PLC	1,064,697	2.47	2,632,995.68
NEXT PLC	73,640	92.92	6,842,628.80
SAINSBURY (J) PLC	864,017	2.60	2,248,172.23
TESCO PLC	4,258,271	3.08	13,132,507.76
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	178,973	25.19	4,508,329.87
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,204,346	25.35	30,530,171.10
COCA-COLA HBC AG-DI	139,727	27.30	3,814,547.10
DIAGEO PLC	1,331,181	25.78	34,317,846.18
IMPERIAL BRANDS PLC	475,337	20.64	9,810,955.68
HALEON PLC	4,003,569	3.34	13,383,931.16
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	416,618	44.44	18,514,503.92
UNILEVER PLC	1,493,327	44.37	66,258,918.99
SMITH & NEPHEW PLC	543,981	9.96	5,419,138.72
ASTRAZENECA PLC	923,057	124.78	115,179,052.46

	GSK PLC	2,469,279	16.08	39,718,352.71	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	106,917	19.79	2,115,887.43	
	BARCLAYS PLC	8,918,202	2.07	18,509,728.25	
	HSBC HOLDINGS PLC	11,248,200	6.90	77,691,317.40	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	37,636,137	0.55	20,955,801.08	
	NATWEST GROUP PLC	3,865,885	3.15	12,204,598.94	
	STANDARD CHARTERED PLC	1,327,549	7.31	9,715,003.58	
	3I GROUP PLC	579,549	31.28	18,128,292.72	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	208,222	11.39	2,372,689.69	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	266,746	96.26	25,676,969.96	
	M&G PLC	1,211,540	2.09	2,534,541.68	
	SCHRODERS PLC	465,209	3.78	1,760,350.85	
	WISE PLC - A	378,893	6.86	2,601,100.44	
	ADMIRAL GROUP PLC	145,253	25.69	3,731,549.57	
	AVIVA PLC	1,654,734	4.84	8,013,876.76	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,703,509	2.30	8,532,884.73	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	427,896	5.25	2,248,593.48	
	PRUDENTIAL PLC	1,664,062	7.59	12,630,230.58	
	SAGE GROUP PLC/THE	595,993	10.66	6,356,265.34	
	HALMA PLC	207,364	27.02	5,602,975.28	
	BT GROUP PLC	3,495,838	1.45	5,070,713.01	
	VODAFONE GROUP PLC	13,899,367	0.72	10,049,242.34	
	CENTRICA PLC	2,862,357	1.37	3,927,153.80	
	NATIONAL GRID PLC	2,885,560	8.88	25,646,857.28	
	SEVERN TRENT PLC	147,941	24.74	3,660,060.34	
	SSE PLC	627,105	18.26	11,450,937.30	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	433,205	10.14	4,394,864.72	
	イギリスポンド 小計	161,275,046		1,166,453,020.31 (236,171,743,022)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	99,007	14.00	1,386,098.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	4,820	747.00	3,600,540.00	
	GIVAUDAN-REG	5,530	4,349.00	24,049,970.00	
	HOLCIM LTD	309,438	78.78	24,377,525.64	
	SIG GROUP AG	180,750	16.64	3,007,680.00	
	SIKA AG-REG	91,127	257.20	23,437,864.40	
	ABB LTD-REG	952,476	50.12	47,738,097.12	
	GEBERIT AG-REG	20,321	547.40	11,123,715.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	15,651	230.50	3,607,555.50	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	22,674	234.00	5,305,716.00	
	VAT GROUP AG	16,784	501.40	8,415,497.60	
	ADECCO GROUP AG-REG	89,253	31.28	2,791,833.84	
	SGS SA-REG	92,854	80.30	7,456,176.20	

	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	28,395	259.00	7,354,305.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	317,275	140.50	44,577,137.50	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	19,981	192.50	3,846,342.50	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	26,795	38.10	1,020,889.50	
	AVOLTA AG	58,100	36.60	2,126,460.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	1,816	1,566.00	2,843,856.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	516	10,940.00	5,645,040.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	69	107,600.00	7,424,400.00	
	NESTLE SA-REG	1,591,107	94.68	150,646,010.76	
	ALCON INC	299,150	80.80	24,171,320.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	30,986	273.20	8,465,375.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	65,136	108.35	7,057,485.60	
	BACHEM HOLDING AG	21,842	79.30	1,732,070.60	
	LONZA GROUP AG-REG	44,644	487.10	21,746,092.40	
	NOVARTIS AG-REG	1,172,563	96.01	112,577,773.63	
	ROCHE HOLDING AG-BR	17,136	279.00	4,780,944.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	420,906	255.40	107,499,392.40	
	SANDOZ GROUP AG	237,909	32.13	7,644,016.17	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	14,828	96.75	1,434,609.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	123,773	51.42	6,364,407.66	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	13,341	1,171.00	15,622,311.00	
	UBS GROUP AG-REG	1,963,473	27.38	53,759,890.74	
	BALOISE HOLDING AG - REG	24,788	158.60	3,931,376.80	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	20,883	122.50	2,558,167.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	17,162	656.00	11,258,272.00	
	SWISS RE AG	181,194	113.10	20,493,041.40	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	87,559	487.20	42,658,744.80	
	TEMENOS AG - REG	34,525	61.75	2,131,918.75	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	89,920	87.38	7,857,209.60	
	SWISSCOM AG-REG	15,056	506.50	7,625,864.00	
	BKW AG	9,300	146.20	1,359,660.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	50,281	84.75	4,261,314.75	
	スイスフラン 小計	8,901,094		868,773,968.96 (155,371,536,608)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,515,868	36.75	55,708,149.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	787,000	92.80	73,033,600.00	
	MTR CORP	1,006,500	24.50	24,659,250.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	622,000	21.90	13,621,800.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,366,000	37.50	51,225,000.00	
	SANDS CHINA LTD	1,265,600	17.36	21,970,816.00	
	WH GROUP LTD	3,953,000	5.22	20,634,660.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,992,000	24.00	47,808,000.00	

	HANG SENG BANK LTD	496,100	103.30	51,247,130.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	726,800	257.80	187,369,040.00	
	AIA GROUP LTD	6,675,200	55.45	370,139,840.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	2,189,000	8.75	19,153,750.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	453,000	42.90	19,433,700.00	
	CLP HOLDINGS LTD	989,000	63.30	62,603,700.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	5,821,348	5.84	33,996,672.32	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	847,000	41.85	35,446,950.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	1,381,368	29.45	40,681,287.60	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	965,641	21.50	20,761,281.50	
	SINO LAND CO	2,619,400	8.05	21,086,170.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	935,500	69.40	64,923,700.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	221,500	69.50	15,394,250.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	500,800	12.40	6,209,920.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	527,000	22.20	11,699,400.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,110,000	20.55	22,810,500.00	
	香港ドル 小計	38,966,625		1,291,618,566.42 (26,400,683,497)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	801,600	6.54	5,242,464.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	754,200	4.10	3,092,220.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	860,940	6.77	5,828,563.80	
	GENTING SINGAPORE LTD	3,983,000	0.87	3,465,210.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,300,300	3.15	4,095,945.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,171,530	35.54	41,636,176.20	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,015,400	14.31	28,840,374.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	738,300	30.58	22,577,214.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	666,800	9.50	6,334,600.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	5,128,060	2.65	13,589,359.00	
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	748,700	5.00	3,743,500.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	1,432,100	2.66	3,809,386.00	
	シンガポールドル 小計	19,600,930		142,255,012.00 (16,783,246,315)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	743,217	7.63	5,670,745.71	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	362,328	29.73	10,772,011.44	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	1,073,324	3.98	4,271,829.52	
	MERCURY NZ LTD	288,052	6.62	1,906,904.24	
	MERIDIAN ENERGY LTD	765,945	6.15	4,710,561.75	
	ニュージーランドドル 小計	3,232,866		27,332,052.66 (2,668,974,942)	
スウェーデンクローネ	BOLIDEN AB	178,730	347.90	62,180,167.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	33,017	423.60	13,986,001.20	
	SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	384,247	156.35	60,077,018.45	

ALFA LAVAL AB	159,289	471.50	75,104,763.50	
ASSA ABLOY AB-B	600,345	297.20	178,422,534.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	1,580,116	202.30	319,657,466.80	
ATLAS COPCO AB-B SHS	953,663	173.65	165,603,579.95	
BEIJER REF AB	222,900	170.25	37,948,725.00	
EPIROC AB-A	411,012	216.10	88,819,693.20	
EPIROC AB-B	210,487	197.30	41,529,085.10	
HUSQVARNA AB-B SHS	159,232	89.66	14,276,741.12	
INDUTRADE AB	150,700	279.60	42,135,720.00	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	143,545	288.60	41,427,087.00	
LIFCO AB-B SHS	130,200	291.80	37,992,360.00	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	964,700	48.16	46,459,952.00	
SAAB AB-B	197,724	245.35	48,511,583.40	
SANDVIK AB	641,798	217.30	139,462,705.40	
SKANSKA AB-B SHS	209,707	195.55	41,008,203.85	
SKF AB-B SHARES	208,393	213.00	44,387,709.00	
TRELLEBORG AB-B SHS	143,031	421.00	60,216,051.00	
VOLVO AB-A SHS	129,112	276.60	35,712,379.20	
VOLVO AB-B SHS	920,911	271.30	249,843,154.30	
SECURITAS AB-B SHS	235,929	105.85	24,973,084.65	
VOLVO CAR AB-B	442,279	33.31	14,732,313.49	
EVOLUTION AB	104,162	1,105.50	115,151,091.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	375,134	193.00	72,400,862.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	363,596	277.40	100,861,530.40	
GETINGE AB-B SHS	131,116	180.30	23,640,214.80	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	124,031	276.00	34,232,556.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	907,944	153.65	139,505,595.60	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	893,229	100.65	89,903,498.85	
SWEDBANK AB - A SHARES	487,581	218.00	106,292,658.00	
EQT AB	212,742	320.00	68,077,440.00	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	91,454	363.20	33,216,092.80	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	89,196	360.30	32,137,318.80	
INVESTOR AB-B SHS	1,013,030	288.85	292,613,715.50	
LUNDBERGS AB-B SHS	43,685	528.50	23,087,522.50	
ERICSSON LM-B SHS	1,680,039	64.94	109,101,732.66	
HEXAGON AB-B SHS	1,187,146	118.15	140,261,299.90	
TELE2 AB-B SHS	367,709	106.70	39,234,550.30	
TELIA CO AB	1,284,253	28.04	36,010,454.12	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	459,633	70.50	32,404,126.50	
SAGAX AB-B	105,140	266.40	28,009,296.00	
スウェーデンクローネ 小計	19,331,887		3,400,609,634.34 (51,757,278,634)	

ノルウェークローネ	AKER BP ASA	205,999	265.90	54,775,134.10	
	EQUINOR ASA	542,080	293.95	159,344,416.00	
	NORSK HYDRO ASA	836,698	66.38	55,540,013.24	
	YARA INTERNATIONAL ASA	83,488	305.50	25,505,584.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	46,700	876.50	40,932,550.00	
	MOWI ASA	251,136	184.90	46,435,046.40	
	ORKLA ASA	493,828	88.15	43,530,938.20	
	SALMAR ASA	40,591	601.00	24,395,191.00	
	DNB BANK ASA	533,264	211.00	112,518,704.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	114,704	194.00	22,252,576.00	
	TELENOR ASA	333,379	122.60	40,872,265.40	
ノルウェークローネ 小計		3,481,867		626,102,418.34 (9,472,929,589)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	226,084	432.50	97,781,330.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	6,061	2,766.00	16,764,726.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	591,405	178.20	105,388,371.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1,724	11,460.00	19,757,040.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	2,834	11,690.00	33,129,460.00	
	DSV A/S	100,380	1,074.00	107,808,120.00	
	PANDORA A/S	44,829	1,067.00	47,832,543.00	
	CARLSBERG AS-B	58,566	859.20	50,319,907.20	
	COLOPLAST-B	70,770	848.60	60,055,422.00	
	DEMANT A/S	60,610	313.00	18,970,930.00	
	GENMAB A/S	39,585	1,805.00	71,450,925.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	1,943,076	988.40	1,920,536,318.40	
	DANSKE BANK A/S	406,811	209.90	85,389,628.90	
	TRYG A/S	186,282	153.30	28,557,030.60	
	ORSTED A/S	116,437	395.00	45,992,615.00	
デンマーククローネ 小計		3,855,454		2,709,734,367.10 (62,215,501,068)	
イスラエルシェケル	ICL GROUP LTD	547,223	16.22	8,875,957.06	
	ELBIT SYSTEMS LTD	14,469	670.80	9,705,805.20	
	BANK HAPOLIM BM	758,702	33.47	25,393,755.94	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	900,703	30.55	27,516,476.65	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	759,946	18.55	14,096,998.30	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	107,140	127.80	13,692,492.00	
	NICE LTD	37,747	613.90	23,172,883.30	
	AZRIELI GROUP LTD	14,806	218.50	3,235,111.00	
イスラエルシェケル 小計		3,140,736		125,689,479.45 (5,378,479,066)	
ユーロ	ENI SPA	1,279,529	14.12	18,072,067.59	
	GALP ENERGIA SGPS SA	283,258	19.08	5,405,978.93	

NESTE OYJ	240,492	16.78	4,036,658.22
OMV AG	76,362	39.66	3,028,516.92
REPSOL SA	739,311	14.80	10,941,802.80
TENARIS SA	260,856	14.50	3,782,412.00
TOTALENERGIES SE	1,280,200	62.51	80,025,302.00
AIR LIQUIDE SA	344,309	164.76	56,728,350.84
AKZO NOBEL N.V.	91,917	57.88	5,320,155.96
ARCELORMITTAL	310,796	22.14	6,881,023.44
ARKEMA	35,633	85.30	3,039,494.90
BASF SE	523,118	46.16	24,147,126.88
COVESTRO AG	104,095	53.86	5,606,556.70
DSM-FIRMENICH AG	109,408	104.50	11,433,136.00
EVONIK INDUSTRIES AG	123,314	19.09	2,354,064.26
HEIDELBERG MATERIALS AG	83,092	95.96	7,973,508.32
OCI NV	80,550	23.25	1,872,787.50
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	162,088	42.86	6,947,091.68
STORA ENSO OYJ-R SHS	377,505	12.58	4,749,012.90
SYENSCO SA	46,110	88.90	4,099,179.00
SYMRIS AG	82,005	114.70	9,405,973.50
UMICORE	118,677	14.82	1,758,793.14
UPM-KYMMENE OYJ	311,739	33.05	10,302,973.95
VOESTALPINE AG	62,408	25.78	1,608,878.24
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	129,451	40.90	5,294,545.90
AIRBUS SE	354,151	148.78	52,690,585.78
ALSTOM	192,488	15.67	3,017,249.40
BOUYGUES SA	103,648	31.82	3,298,079.36
BRENTAG SE	71,852	65.64	4,716,365.28
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	271,506	73.16	19,863,378.96
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	322,444	37.25	12,011,039.00
DASSAULT AVIATION SA	9,266	179.60	1,664,173.60
EIFFAGE	46,140	90.02	4,153,522.80
FERROVIAL SE	303,733	36.56	11,104,478.48
GEA GROUP AG	88,362	39.80	3,516,807.60
IMCD NV	35,704	134.35	4,796,832.40
KINGSPAN GROUP PLC	92,479	80.20	7,416,815.80
KNORR-BREMSE AG	40,814	71.55	2,920,241.70
KONE OYJ-B	208,302	47.07	9,804,775.14
LEGRAND SA	158,999	93.88	14,926,826.12
LEONARDO SPA	240,845	22.29	5,368,435.05
METSO CORP	358,750	10.26	3,682,568.75
MTU AERO ENGINES AG	33,898	228.80	7,755,862.40
PRYSMIAN SPA	162,614	58.88	9,574,712.32

RATIONAL AG	3,372	830.00	2,798,760.00
REXEL SA	122,383	24.80	3,035,098.40
RHEINMETALL AG	26,370	500.40	13,195,548.00
SAFRAN SA	203,700	206.00	41,962,200.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	324,126	227.15	73,625,220.90
SIEMENS AG-REG	452,899	171.04	77,463,844.96
SIEMENS ENERGY AG	366,520	24.58	9,009,061.60
THALES SA	52,989	158.10	8,377,560.90
VINCI SA	298,450	102.90	30,710,505.00
WARTSILA OYJ ABP	296,181	18.66	5,526,737.46
BUREAU VERITAS SA	201,388	26.92	5,421,364.96
RANDSTAD NV	52,875	45.46	2,403,697.50
TELEPERFORMANCE	29,501	100.10	2,953,050.10
WOLTERS KLUWER	148,983	153.75	22,906,136.25
ADP	17,115	117.80	2,016,147.00
AENA SME SA	46,423	188.00	8,727,524.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	338,250	5.81	1,965,232.50
DHL GROUP	594,411	38.15	22,676,779.65
GETLINK SE	172,576	15.91	2,745,684.16
INPOST SA	141,398	16.40	2,318,927.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	187,219	89.64	16,782,311.16
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	40,076	84.00	3,366,384.00
CONTINENTAL AG	69,435	55.30	3,839,755.50
DR ING HC F PORSCHE AG	69,570	70.36	4,894,945.20
FERRARI NV	74,984	393.70	29,521,200.80
MERCEDES-BENZ GROUP AG	477,813	64.54	30,838,051.02
MICHELIN (CGDE)	413,033	37.38	15,439,173.54
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	83,301	42.94	3,576,944.94
RENAULT SA	114,124	48.71	5,558,980.04
STELLANTIS NV	1,314,822	19.38	25,489,139.29
VOLKSWAGEN AG	19,218	114.40	2,198,539.20
VOLKSWAGEN AG-PREF	117,861	106.20	12,516,838.20
ADIDAS AG	95,351	220.10	20,986,755.10
HERMES INTERNATIONAL	18,919	2,178.00	41,205,582.00
KERING	45,475	324.20	14,742,995.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	164,385	726.50	119,425,702.50
MONCLER SPA	121,056	58.26	7,052,722.56
PUMA SE	70,653	44.65	3,154,656.45
SEB SA	17,113	105.20	1,800,287.60
ACCOR SA	103,418	39.18	4,051,917.24
AMADEUS IT GROUP SA	271,149	64.02	17,358,958.98
DELIVERY HERO SE	104,269	25.92	2,702,652.48

LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	68,879	32.50	2,238,567.50
SODEXO SA	58,085	85.70	4,977,884.50
BOLLORE SE	416,392	5.77	2,402,581.84
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	42,374	78.70	3,334,833.80
PUBLICIS GROUPE	138,060	103.80	14,330,628.00
SCOUT24 SE	41,543	71.45	2,968,247.35
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	492,346	27.98	13,775,841.08
VIVENDI SE	404,329	9.88	3,998,005.15
D'ETEREN GROUP	13,308	196.80	2,619,014.40
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	651,783	47.21	30,770,675.43
PROSUS NV	841,775	34.49	29,032,819.75
ZALANDO SE	125,157	21.67	2,712,152.19
CARREFOUR SA	330,839	13.80	4,567,232.39
JERONIMO MARTINS	169,984	19.44	3,304,488.96
KESKO OYJ-B SHS	133,348	16.89	2,252,914.46
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	548,403	28.15	15,437,544.45
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	537,231	56.66	30,439,508.46
DANONE	383,632	58.86	22,580,579.52
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	367,895	9.56	3,517,811.99
HEINEKEN HOLDING NV	79,993	75.65	6,051,470.45
HEINEKEN NV	170,653	92.50	15,785,402.50
JDE PEET'S NV	53,600	19.87	1,065,032.00
KERRY GROUP PLC-A	86,856	75.95	6,596,713.20
LOTUS BAKERIES	279	10,020.00	2,795,580.00
PERNOD RICARD SA	121,189	133.20	16,142,374.80
REMY COINTREAU	9,646	79.35	765,410.10
BEIERSDORF AG	61,115	141.75	8,663,051.25
HENKEL AG & CO KGAA	57,972	73.75	4,275,435.00
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	102,673	83.24	8,546,500.52
L'OREAL	143,444	442.10	63,416,592.40
AMPLIFON SPA	68,691	34.01	2,336,180.91
BIOMERIEUX	22,555	90.45	2,040,099.75
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	22,646	66.80	1,512,752.80
DIASORIN SPA	9,103	95.96	873,523.88
ESSILORLUXOTTICA	174,801	208.90	36,515,928.90
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	127,004	36.35	4,616,595.40
FRESENIUS SE & CO KGAA	246,854	28.37	7,003,247.98
KONINKLIJKE PHILIPS NV	460,335	24.55	11,301,224.25
SIEMENS HEALTHINEERS AG	167,713	53.50	8,972,645.50
ARGENX SE	34,568	405.50	14,017,324.00
BAYER AG-REG	595,741	26.65	15,879,476.35
EUROFINS SCIENTIFIC	85,929	44.22	3,799,780.38

GRIFOLS SA	126,564	9.34	1,182,107.76
IPSEN	21,710	116.80	2,535,728.00
MERCK KGAA	78,124	167.05	13,050,614.20
ORION OYJ-CLASS B	50,154	40.01	2,006,661.54
QIAGEN N.V.	131,652	39.20	5,160,758.40
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	58,531	50.10	2,932,403.10
SANOFI	679,056	90.36	61,359,500.16
SARTORIUS AG-VORZUG	16,372	224.80	3,680,425.60
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	18,395	159.45	2,933,082.75
UCB SA	76,947	138.85	10,684,090.95
ABN AMRO BANK NV-CVA	290,262	15.58	4,522,281.96
AIB GROUP PLC	1,031,237	4.96	5,121,122.94
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,438,230	9.39	32,291,856.16
BANCO BPM SPA	723,370	6.20	4,484,894.00
BANCO DE SABADELL SA	3,266,886	1.81	5,913,063.66
BANCO SANTANDER SA	9,451,124	4.40	41,670,005.71
BANK OF IRELAND GROUP PLC	639,461	9.79	6,264,159.95
BNP PARIBAS	619,174	61.27	37,936,790.98
CAIXABANK SA	2,212,480	5.00	11,080,099.84
COMMERZBANK AG	626,119	14.23	8,909,673.37
CREDIT AGRICOLE SA	617,427	13.28	8,202,517.69
ERSTE GROUP BANK AG	202,525	43.99	8,909,074.75
FINECOBANK SPA	375,456	14.38	5,399,057.28
ING GROEP NV	1,973,764	15.80	31,201,261.31
INTESA SANPAOLO	8,759,612	3.53	30,938,949.58
KBC GROUP NV	152,074	67.12	10,207,206.88
MEDIOBANCA SPA	298,281	13.93	4,156,545.73
NORDEA BANK ABP	1,857,374	11.39	21,164,776.73
SOCIETE GENERALE SA	437,480	22.55	9,867,361.40
UNICREDIT SPA	904,299	35.36	31,980,534.13
ADYEN NV	12,973	1,140.80	14,799,598.40
AMUNDI SA	42,569	63.85	2,718,030.65
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	1,146,314	14.84	17,013,592.38
DEUTSCHE BOERSE AG	113,975	194.00	22,111,150.00
EDENRED	146,617	42.63	6,250,282.71
EURAZEO SE	30,125	76.35	2,300,043.75
EURONEXT NV	49,351	90.10	4,446,525.10
EXOR NV	61,120	99.35	6,072,272.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	58,617	67.60	3,962,509.20
NEXI SPA	338,814	5.82	1,971,897.48
SOFINA	9,693	216.80	2,101,442.40
AEGON LTD	856,692	5.97	5,119,591.39

AGEAS	85,112	43.80	3,727,905.60
ALLIANZ SE-REG	233,299	261.50	61,007,688.50
ASR NEDERLAND NV	95,241	45.00	4,285,845.00
ASSICURAZIONI GENERALI	617,515	23.66	14,610,404.90
AXA SA	1,072,568	30.90	33,142,351.20
HANNOVER RUECK SE	33,983	237.10	8,057,369.30
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	81,432	467.10	38,036,887.20
NN GROUP NV	160,370	43.18	6,924,776.60
POSTE ITALIANE SPA	269,406	12.03	3,242,301.21
SAMPO OYJ-A SHS	268,909	40.39	10,861,234.51
TALANX AG	40,850	74.75	3,053,537.50
BECHTLE AG	39,938	45.04	1,798,807.52
CAPGEMINI SE	93,378	187.05	17,466,354.90
DASSAULT SYSTEMES SE	392,835	34.82	13,678,514.70
NEMETSCHEK SE	32,589	88.65	2,889,014.85
SAP SE	621,920	179.46	111,609,763.20
NOKIA OYJ	3,149,790	3.52	11,096,710.17
CELLNEX TELECOM SA	301,308	31.47	9,482,162.76
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,930,054	23.15	44,680,750.10
ELISA OYJ	88,430	42.86	3,790,109.80
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	180,053	9.86	1,775,322.58
KONINKLIJKE KPN NV	2,412,828	3.61	8,712,721.90
ORANGE	1,094,314	9.58	10,483,528.12
TELECOM ITALIA SPA	6,768,851	0.23	1,564,281.46
TELEFONICA SA	2,783,952	4.10	11,439,258.76
ACCIONA SA	13,178	115.70	1,524,694.60
E.ON SE	1,354,815	12.60	17,077,443.07
EDP RENOVAVEIS SA	231,965	13.81	3,203,436.65
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,709,490	3.61	6,183,225.33
ELIA GROUP SA/NV	17,969	92.10	1,654,944.90
ENDESA SA	199,107	19.05	3,793,983.88
ENEL SPA	4,780,882	6.54	31,276,530.04
ENGIE	1,087,360	13.73	14,929,452.80
FORTUM OYJ	254,538	14.47	3,683,164.86
IBERDROLA SA	3,424,842	12.32	42,194,053.44
REDEIA CORP SA	220,809	17.32	3,824,411.88
RWE AG	362,247	33.47	12,124,407.09
SNAM SPA	1,319,110	4.13	5,449,243.41
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE	888,343	7.43	6,603,941.86
VEOLIA ENVIRONNEMENT	396,328	29.16	11,556,924.48
VERBUND AG	48,497	75.30	3,651,824.10
ASM INTERNATIONAL NV	28,150	690.80	19,446,020.00

ASML HOLDING NV	237,870	948.50	225,619,695.00	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	46,282	149.75	6,930,729.50	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	782,285	34.00	26,601,601.42	
STMICROELECTRONICS NV	406,101	37.76	15,334,373.76	
LEG IMMOBILIEN SE	41,849	75.64	3,165,458.36	
VONOVIA SE	431,666	26.43	11,408,932.38	
ユーロ 小計	110,037,703		3,070,945,025.51 (526,022,173,419)	
合 計	652,656,902		5,822,135,315,794 (5,822,135,315,794)	

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
アメリカ ドル	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	99,307	11,721,205.21	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	200,103	7,363,790.40	
		AMERICAN TOWER CORP	275,177	54,042,011.03	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	84,545	17,450,933.45	
		BOSTON PROPERTIES INC	93,232	5,798,098.08	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	68,399	7,599,128.90	
		CROWN CASTLE INC	259,935	25,325,467.05	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	185,074	27,207,728.74	
		EQUINIX INC	56,079	42,182,623.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	108,026	7,023,850.52	
		EQUITY RESIDENTIAL	205,240	14,200,555.60	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	37,480	10,464,041.20	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	122,615	19,536,247.95	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	175,988	7,827,946.24	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	437,815	8,603,064.75	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	453,144	8,206,437.84	
		INVITATION HOMES INC	353,860	12,685,881.00	
		IRON MOUNTAIN INC	175,922	15,672,890.98	
		KIMCO REALTY CORP	388,713	7,439,966.82	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	74,228	10,638,356.96	
		PROLOGIS INC	546,942	61,055,135.46	
		PUBLIC STORAGE	94,397	27,593,187.07	
		REALTY INCOME CORP	516,514	27,705,810.96	
		REGENCY CENTERS CORP	107,187	6,673,462.62	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	60,761	11,980,246.37	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	194,193	29,216,336.85	
		SUN COMMUNITIES INC	75,315	9,045,331.50	

		UDR INC	183,019	7,533,062.04	
		VENTAS INC	240,064	12,168,844.16	
		VICI PROPERTIES INC	628,718	17,874,452.74	
		WELLTOWER INC	338,604	34,866,053.88	
		WEYERHAEUSER CO	441,260	12,814,190.40	
		WP CAREY INC	133,886	7,485,566.26	
アメリカドル合計			7,415,742	587,001,906.83 (93,662,024,253)	
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	36,100	1,599,591.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	58,600	984,480.00	
カナダドル合計			94,700	2,584,071.00 (301,922,855)	
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS/AU	603,939	4,010,154.96	
		GOODMAN GROUP	1,017,734	35,803,882.12	
		GPT GROUP	1,535,318	6,432,982.42	
		MIRVAC GROUP	2,214,980	4,230,611.80	
		SCENTRE GROUP	3,534,724	11,311,116.80	
		STOCKLAND	1,319,965	5,807,846.00	
		VICINITY CENTRES	1,843,215	3,456,028.12	
オーストラリアドル合計			12,069,875	71,052,622.22 (7,543,656,901)	
イギリスポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	352,124	2,216,620.58	
		SEGRO PLC	726,973	6,596,553.00	
イギリスポンド合計			1,079,097	8,813,173.58 (1,784,403,254)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	1,609,200	51,011,640.00	
香港ドル合計			1,609,200	51,011,640.00 (1,042,677,921)	
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	2,228,300	5,659,882.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	2,977,171	5,805,483.45	
シンガポールドル合計			5,205,471	11,465,365.45 (1,352,683,815)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	26,523	1,226,953.98	
		GECINA SA	24,517	2,265,370.80	
		KLEPIERRE	129,417	3,377,783.70	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE	64,908	4,842,136.80	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	98,953	2,529,238.68	
ユーロ合計			344,318	14,241,483.96 (2,439,423,787)	
合計				108,126,792,786 (108,126,792,786)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数		組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式	581銘柄	97.93%	—	74.83%
	投資証券	33銘柄	—	2.07%	1.58%
カナダドル	株式	85銘柄	99.84%	—	3.09%
	投資証券	2銘柄	—	0.16%	0.01%
オーストラリアドル	株式	51銘柄	93.54%	—	1.84%
	投資証券	7銘柄	—	6.46%	0.13%
イギリスポンド	株式	77銘柄	99.25%	—	3.98%
	投資証券	2銘柄	—	0.75%	0.03%
スイスフラン	株式	45銘柄	100.00%	—	2.62%
香港ドル	株式	24銘柄	96.20%	—	0.45%
	投資証券	1銘柄	—	3.80%	0.02%
シンガポールドル	株式	12銘柄	92.54%	—	0.28%
	投資証券	2銘柄	—	7.46%	0.02%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	100.00%	—	0.05%
スウェーデンクローネ	株式	43銘柄	100.00%	—	0.87%
ノルウェークローネ	株式	11銘柄	100.00%	—	0.16%
デンマーククローネ	株式	15銘柄	100.00%	—	1.05%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.00%	—	0.09%
ユーロ	株式	218銘柄	99.54%	—	8.87%
	投資証券	5銘柄	—	0.46%	0.04%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

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)	
[2024年 6月25日現在]	
資産の部	
流動資産	
預金	4,188,611,259
コール・ローン	4,412,479,219
国債証券	654,894,548,669
派生商品評価勘定	59,524,162
未収入金	2,703,610
未収利息	4,696,244,062
前払費用	685,848,739
流動資産合計	668,939,959,720
資産合計	668,939,959,720
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	607,130

[2024年 6月25日現在]

未払金	1,116,842,855
未払解約金	657,395,965
流動負債合計	1,774,845,950
負債合計	1,774,845,950
純資産の部	
元本等	
元本	238,956,530,761
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	428,208,583,009
元本等合計	667,165,113,770
純資産合計	667,165,113,770
負債純資産合計	668,939,959,720

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 6月25日現在]
1. 期首	2023年 6月27日
期首元本額	188,907,060,645円
期中追加設定元本額	76,196,962,982円
期中一部解約元本額	26,147,492,866円
元本の内訳	
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	272,861,072円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	684,585,110円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	468,180,025円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン	803,132,037円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	2,024,699,819円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	6,180,457,517円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	5,199,409,145円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	514,026,278円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（成長型）	95,594,882円
ファンド・マネジャー（海外債券）	640,481,128円
eMAXIS 先進国債券インデックス	6,459,595,665円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	2,418,048,530円
eMAXIS バランス（波乗り型）	209,598,341円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	1,061,999,965円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	415,927,659円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	252,139,895円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	173,412,934円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	51,446,952,504円
海外債券セクション（ラップ向け）	3,238,672,711円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	12,878,846,143円
つみたて8資産均等バランス	6,450,369,007円
つみたて4資産均等バランス	2,435,532,461円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	4,928,325円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,715,493円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	683,734円

	[2024年 6月25日現在]
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３５（確定拠出年金）	238,435,014円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４５（確定拠出年金）	169,443,785円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５５（確定拠出年金）	97,910,659円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式１５）	784,517,635円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式４０）	1,300,905,235円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式６５）	2,158,606,583円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金インデックス（先進国債券）	2,654,868,240円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）	87,225,302円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式２５）	176,424,646円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６５（確定拠出年金）	42,752,136円
ラップ向けインデックスf 先進国債券	3,314,397,543円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式８０）	47,261,424円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	15,716,646円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	26,743,614円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０７０（確定拠出年金）	548,536円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン（確定拠出年金）	3,173,827,727円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン（毎月分配型）	16,044,649,207円
ワールド・インカムオープン	948,044,357円
三菱ＵＦＪ ＤＣ海外債券インデックスファンド	15,385,471,177円
三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）	390,712,134円
三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（年１回決算型）	2,385,917,710円
eMAXIS バランス（４資産均等型）	1,007,598,752円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	544,595,658円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	300,147,046円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	570,517,987円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	237,256,740円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	87,151,180円
三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドVA（適格機関投資家限定）	960,251,360円
三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドVA2（適格機関投資家限定）	9,894,082円
MUAM 世界債券オープン（適格機関投資家限定）	881,930,431円
三菱ＵＦＪ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	11,176,618円
三菱ＵＦＪ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	1,405,399,508円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	1,064,944,506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）	49,058,405,814円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	438,430,512円
三菱ＵＦＪ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	377,142円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	100,444円
三菱ＵＦＪ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	1,160,108,328円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	31,727,206円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	55,568,872円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	1,022,914,625円
世界８資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	34,644,652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）	4,334,448,194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）	531,396,236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）	25,367,800円
海外債券インデックスファンドS	5,921,611,828円
グローバルバランスオープンV（適格機関投資家限定）	4,065,032円
MUAM グローバルバランス（退職給付信託向け）（適格機関投資家限定）	12,357,414,449円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	1,551,725円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	2,520,300円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	500,931円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	852,500円
三菱ＵＦＪ 外国債券インデックスファンドVA	4,222,358円

	[2024年 6月25日現在]
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	3,469,445円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	7,451,285円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	3,338,316円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	8,817,629円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>外国債券インデックスファンド	1,752,311,981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）	182,938,334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）	525,056,310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）	439,979,520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）	187,845,435円
合計	238,956,530,761円
2. 受益権の総数	238,956,530,761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 2023年 6月27日 至 2024年 6月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク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	[2024年 6月25日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[2024年 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	5,949,526,433
合計	5,949,526,433

（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

〔2024年 6月25日現在〕

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	3,397,851,700	—	3,455,316,460	57,464,760
	カナダドル	8,169,140	—	8,177,729	8,589
	オーストラリアドル	7,430,080	—	7,429,989	91
	イギリスポンド	28,308,100	—	28,340,400	32,300
	マレーシアリンギット	21,363,300	—	21,338,226	25,074
	ポーランドズロチ	8,294,769	—	8,377,404	82,635
	オフショア元	183,679,062	—	184,769,324	1,090,262
	ユーロ	176,140,766	—	176,404,417	263,651
合計		3,831,236,917	—	3,890,153,949	58,917,032

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	〔2024年 6月25日現在〕
1口当たり純資産額	2.7920円
(1万口当たり純資産額)	(27,920円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨	種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
アメリカドル	国債証券	0.25 T-NOTE 250731	5,800,000.00	5,507,167.97	
		0.25 T-NOTE 250831	6,700,000.00	6,336,996.07	
		0.25 T-NOTE 250930	7,600,000.00	7,163,742.21	
		0.25 T-NOTE 251031	10,300,000.00	9,678,781.25	

0.375 T-NOTE 251130	10,150,000.00	9,519,986.35	
0.375 T-NOTE 251231	8,500,000.00	7,947,001.98	
0.375 T-NOTE 260131	11,700,000.00	10,902,023.49	
0.375 T-NOTE 270731	7,150,000.00	6,314,623.02	
0.375 T-NOTE 270930	7,300,000.00	6,410,882.77	
0.5 T-NOTE 260228	9,900,000.00	9,218,408.16	
0.5 T-NOTE 270430	5,280,000.00	4,723,743.76	
0.5 T-NOTE 270531	5,490,000.00	4,896,608.18	
0.5 T-NOTE 270630	5,900,000.00	5,248,580.05	
0.5 T-NOTE 270831	6,650,000.00	5,879,535.11	
0.5 T-NOTE 271031	8,590,000.00	7,551,817.92	
0.625 T-NOTE 260731	7,930,000.00	7,296,529.31	
0.625 T-NOTE 270331	3,800,000.00	3,421,484.35	
0.625 T-NOTE 271130	8,780,000.00	7,733,087.90	
0.625 T-NOTE 271231	8,630,000.00	7,579,230.09	
0.625 T-NOTE 300515	14,210,000.00	11,544,514.91	
0.625 T-NOTE 300815	17,350,000.00	13,980,982.36	
0.75 T-NOTE 260331	13,590,000.00	12,673,471.23	
0.75 T-NOTE 260430	9,200,000.00	8,556,359.35	
0.75 T-NOTE 260531	8,200,000.00	7,604,378.89	
0.75 T-NOTE 260831	10,100,000.00	9,292,000.00	
0.75 T-NOTE 280131	9,950,000.00	8,756,000.00	
0.875 T-NOTE 260630	8,300,000.00	7,699,708.97	
0.875 T-NOTE 260930	10,000,000.00	9,208,203.10	
0.875 T-NOTE 301115	22,310,000.00	18,153,019.64	
1 T-NOTE 280731	9,150,000.00	8,012,504.84	
1.125 T-BOND 400515	6,890,000.00	4,338,412.31	
1.125 T-BOND 400815	9,380,000.00	5,849,309.36	
1.125 T-NOTE 261031	10,450,000.00	9,650,125.96	
1.125 T-NOTE 270228	2,950,000.00	2,699,710.93	
1.125 T-NOTE 280229	9,760,000.00	8,688,687.54	
1.125 T-NOTE 280831	16,430,000.00	14,431,765.48	
1.125 T-NOTE 310215	17,120,000.00	14,092,234.35	
1.25 T-BOND 500515	10,720,000.00	5,493,162.55	
1.25 T-NOTE 261130	11,360,000.00	10,500,456.27	
1.25 T-NOTE 261231	8,200,000.00	7,566,101.54	
1.25 T-NOTE 280331	9,950,000.00	8,880,763.64	
1.25 T-NOTE 280430	9,740,000.00	8,674,307.05	
1.25 T-NOTE 280531	9,750,000.00	8,665,883.75	
1.25 T-NOTE 280630	9,680,000.00	8,584,950.00	
1.25 T-NOTE 280930	10,700,000.00	9,428,748.08	
1.25 T-NOTE 310815	19,990,000.00	16,334,406.90	

1.375 T-BOND 401115	9,910,000.00	6,401,434.16
1.375 T-BOND 500815	11,180,000.00	5,910,988.30
1.375 T-NOTE 260831	3,800,000.00	3,543,945.32
1.375 T-NOTE 281031	9,050,000.00	8,004,123.98
1.375 T-NOTE 281231	8,700,000.00	7,663,986.33
1.375 T-NOTE 311115	20,320,000.00	16,646,525.00
1.5 T-NOTE 260815	9,740,000.00	9,117,933.56
1.5 T-NOTE 270131	13,540,000.00	12,542,747.31
1.5 T-NOTE 281130	9,700,000.00	8,610,455.06
1.5 T-NOTE 300215	9,680,000.00	8,351,646.89
1.625 T-BOND 501115	11,410,000.00	6,447,987.13
1.625 T-NOTE 260215	9,760,000.00	9,270,856.22
1.625 T-NOTE 260515	7,670,000.00	7,242,157.81
1.625 T-NOTE 260930	5,500,000.00	5,152,382.84
1.625 T-NOTE 261031	3,350,000.00	3,130,417.95
1.625 T-NOTE 261130	3,400,000.00	3,171,562.50
1.625 T-NOTE 290815	7,050,000.00	6,203,173.81
1.625 T-NOTE 310515	17,540,000.00	14,822,327.66
1.75 T-BOND 410815	14,850,000.00	10,050,433.66
1.75 T-NOTE 261231	4,700,000.00	4,391,011.70
1.75 T-NOTE 290131	10,040,000.00	8,980,505.50
1.75 T-NOTE 291115	5,150,000.00	4,542,259.77
1.875 T-BOND 410215	10,700,000.00	7,490,835.88
1.875 T-BOND 510215	12,560,000.00	7,563,474.99
1.875 T-BOND 511115	12,630,000.00	7,565,172.71
1.875 T-NOTE 260630	5,100,000.00	4,826,472.66
1.875 T-NOTE 260731	5,500,000.00	5,195,136.70
1.875 T-NOTE 270228	9,120,000.00	8,516,690.65
1.875 T-NOTE 290228	7,800,000.00	7,006,289.08
1.875 T-NOTE 320215	16,860,000.00	14,270,738.65
2 T-BOND 411115	10,220,000.00	7,184,939.41
2 T-BOND 500215	8,590,000.00	5,374,286.50
2 T-BOND 510815	12,060,000.00	7,468,249.17
2 T-NOTE 250815	8,600,000.00	8,315,460.91
2 T-NOTE 261115	8,680,000.00	8,175,135.95
2.125 T-NOTE 260531	5,000,000.00	4,762,109.40
2.25 T-BOND 410515	9,320,000.00	6,895,525.76
2.25 T-BOND 460815	5,730,000.00	3,921,021.11
2.25 T-BOND 490815	6,950,000.00	4,625,415.01
2.25 T-BOND 520215	10,280,000.00	6,747,856.24
2.25 T-NOTE 251115	10,290,000.00	9,924,222.60
2.25 T-NOTE 260331	4,500,000.00	4,308,750.00
2.25 T-NOTE 270215	11,010,000.00	10,391,977.75

2.25 T-NOTE 270815	9,390,000.00	8,787,719.57	
2.25 T-NOTE 271115	7,500,000.00	6,991,406.25	
2.375 T-BOND 420215	8,920,000.00	6,641,218.74	
2.375 T-BOND 491115	6,600,000.00	4,511,460.95	
2.375 T-BOND 510515	12,850,000.00	8,715,914.06	
2.375 T-NOTE 260430	4,000,000.00	3,832,812.48	
2.375 T-NOTE 270515	18,570,000.00	17,513,105.90	
2.375 T-NOTE 290331	12,000,000.00	11,015,390.64	
2.375 T-NOTE 290515	8,510,000.00	7,798,284.78	
2.5 T-BOND 450215	5,050,000.00	3,687,387.68	
2.5 T-BOND 460215	5,410,000.00	3,908,090.99	
2.5 T-BOND 460515	4,210,000.00	3,033,502.36	
2.5 T-NOTE 260228	3,450,000.00	3,321,568.36	
2.5 T-NOTE 270331	7,700,000.00	7,307,029.26	
2.625 T-NOTE 251231	3,200,000.00	3,095,875.00	
2.625 T-NOTE 260131	3,900,000.00	3,767,308.58	
2.625 T-NOTE 270531	7,900,000.00	7,500,679.64	
2.625 T-NOTE 290215	9,640,000.00	8,965,011.73	
2.625 T-NOTE 290731	6,790,000.00	6,279,689.06	
2.75 T-BOND 420815	2,520,000.00	1,980,611.71	
2.75 T-BOND 421115	3,700,000.00	2,898,285.14	
2.75 T-BOND 470815	5,190,000.00	3,879,727.72	
2.75 T-BOND 471115	5,710,000.00	4,261,422.04	
2.75 T-NOTE 250831	4,050,000.00	3,944,794.93	
2.75 T-NOTE 270430	10,100,000.00	9,634,847.63	
2.75 T-NOTE 270731	7,650,000.00	7,275,568.37	
2.75 T-NOTE 280215	9,990,000.00	9,440,550.00	
2.75 T-NOTE 290531	7,160,000.00	6,674,322.66	
2.75 T-NOTE 320815	17,340,000.00	15,567,052.79	
2.875 T-BOND 430515	4,680,000.00	3,714,932.80	
2.875 T-BOND 450815	3,500,000.00	2,719,472.66	
2.875 T-BOND 461115	2,340,000.00	1,801,434.37	
2.875 T-BOND 490515	8,570,000.00	6,504,496.13	
2.875 T-BOND 520515	10,840,000.00	8,179,542.16	
2.875 T-NOTE 250731	6,100,000.00	5,960,367.21	
2.875 T-NOTE 251130	3,800,000.00	3,694,164.07	
2.875 T-NOTE 280515	11,990,000.00	11,353,499.57	
2.875 T-NOTE 280815	10,310,000.00	9,736,908.95	
2.875 T-NOTE 290430	8,000,000.00	7,508,124.96	
2.875 T-NOTE 320515	17,030,000.00	15,472,021.00	
3 T-BOND 420515	2,270,000.00	1,861,000.97	
3 T-BOND 441115	3,900,000.00	3,114,515.62	

3 T-BOND 450515	2,790,000.00	2,219,030.85
3 T-BOND 451115	2,000,000.00	1,585,195.32
3 T-BOND 470215	5,290,000.00	4,156,369.49
3 T-BOND 470515	3,990,000.00	3,129,734.17
3 T-BOND 480215	5,970,000.00	4,662,663.25
3 T-BOND 480815	7,070,000.00	5,509,352.71
3 T-BOND 490215	7,850,000.00	6,109,201.17
3 T-BOND 520815	9,700,000.00	7,512,005.81
3 T-NOTE 250715	6,700,000.00	6,559,355.61
3 T-NOTE 250930	5,400,000.00	5,270,062.50
3 T-NOTE 251031	3,300,000.00	3,217,500.00
3.125 T-BOND 411115	1,990,000.00	1,674,981.44
3.125 T-BOND 420215	2,200,000.00	1,845,851.56
3.125 T-BOND 430215	3,160,000.00	2,614,714.85
3.125 T-BOND 440815	5,680,000.00	4,640,959.35
3.125 T-BOND 480515	7,240,000.00	5,778,849.19
3.125 T-NOTE 250815	5,000,000.00	4,895,898.45
3.125 T-NOTE 270831	7,300,000.00	7,016,269.51
3.125 T-NOTE 281115	14,380,000.00	13,694,983.96
3.125 T-NOTE 290831	5,900,000.00	5,586,101.59
3.25 T-BOND 420515	8,950,000.00	7,602,605.42
3.25 T-NOTE 270630	8,090,000.00	7,818,384.55
3.25 T-NOTE 290630	6,170,000.00	5,883,914.43
3.375 T-BOND 420815	6,370,000.00	5,494,249.40
3.375 T-BOND 440515	5,380,000.00	4,577,833.60
3.375 T-BOND 481115	8,120,000.00	6,769,415.66
3.375 T-NOTE 330515	16,800,000.00	15,719,812.41
3.5 T-BOND 390215	1,490,000.00	1,365,387.11
3.5 T-NOTE 250915	7,900,000.00	7,759,281.25
3.5 T-NOTE 280131	9,030,000.00	8,764,567.38
3.5 T-NOTE 280430	6,900,000.00	6,690,843.75
3.5 T-NOTE 300131	5,800,000.00	5,579,781.24
3.5 T-NOTE 300430	5,600,000.00	5,380,156.26
3.5 T-NOTE 330215	17,690,000.00	16,734,325.34
3.625 T-BOND 430815	3,400,000.00	3,017,500.00
3.625 T-BOND 440215	3,870,000.00	3,424,723.25
3.625 T-BOND 530215	9,740,000.00	8,521,548.78
3.625 T-BOND 530515	10,160,000.00	8,892,381.30
3.625 T-NOTE 260515	7,000,000.00	6,860,820.33
3.625 T-NOTE 280331	6,000,000.00	5,845,898.46
3.625 T-NOTE 280531	6,600,000.00	6,428,296.90
3.625 T-NOTE 300331	5,500,000.00	5,321,679.66
3.75 T-BOND 410815	2,060,000.00	1,898,660.16

3.75 T-BOND 431115	4,830,000.00	4,359,829.68	
3.75 T-NOTE 260415	7,000,000.00	6,877,226.58	
3.75 T-NOTE 281231	10,260,000.00	10,028,749.22	
3.75 T-NOTE 300531	5,600,000.00	5,449,937.47	
3.75 T-NOTE 300630	6,250,000.00	6,080,566.36	
3.75 T-NOTE 301231	6,660,000.00	6,470,866.37	
3.875 T-BOND 400815	2,560,000.00	2,419,999.99	
3.875 T-BOND 430215	6,740,000.00	6,215,412.10	
3.875 T-BOND 430515	6,920,000.00	6,370,589.85	
3.875 T-NOTE 260115	6,700,000.00	6,600,808.57	
3.875 T-NOTE 271130	6,900,000.00	6,782,888.64	
3.875 T-NOTE 271231	7,000,000.00	6,881,054.67	
3.875 T-NOTE 290930	6,030,000.00	5,915,288.65	
3.875 T-NOTE 291130	6,190,000.00	6,072,244.90	
3.875 T-NOTE 291231	5,700,000.00	5,590,453.12	
3.875 T-NOTE 330815	18,320,000.00	17,798,309.41	
4 T-BOND 421115	6,840,000.00	6,429,065.65	
4 T-BOND 521115	9,790,000.00	9,167,417.18	
4 T-NOTE 251215	7,750,000.00	7,652,065.42	
4 T-NOTE 260215	8,000,000.00	7,895,156.24	
4 T-NOTE 270115	12,300,000.00	12,137,361.28	
4 T-NOTE 280229	7,640,000.00	7,541,366.37	
4 T-NOTE 280630	8,990,000.00	8,876,571.46	
4 T-NOTE 290131	10,050,000.00	9,926,534.13	
4 T-NOTE 291031	6,600,000.00	6,513,503.89	
4 T-NOTE 300228	7,330,000.00	7,232,075.73	
4 T-NOTE 300731	5,400,000.00	5,324,378.88	
4 T-NOTE 310131	6,950,000.00	6,849,822.28	
4 T-NOTE 340215	25,750,000.00	25,253,105.32	
4.125 T-BOND 530815	10,700,000.00	10,245,876.90	
4.125 T-NOTE 260615	7,000,000.00	6,923,574.21	
4.125 T-NOTE 270215	9,500,000.00	9,404,628.93	
4.125 T-NOTE 270930	7,440,000.00	7,371,412.50	
4.125 T-NOTE 271031	6,500,000.00	6,439,951.18	
4.125 T-NOTE 280731	7,700,000.00	7,638,941.38	
4.125 T-NOTE 290331	11,300,000.00	11,222,753.87	
4.125 T-NOTE 300831	7,100,000.00	7,046,472.66	
4.125 T-NOTE 310331	12,100,000.00	12,014,921.87	
4.125 T-NOTE 321115	16,070,000.00	15,936,606.46	
4.25 T-BOND 390515	2,270,000.00	2,258,295.30	
4.25 T-BOND 401115	1,980,000.00	1,954,669.91	
4.25 T-BOND 540215	13,340,000.00	13,060,693.74	

4.25 T-NOTE 251015	6,000,000.00	5,945,976.54
4.25 T-NOTE 251231	13,580,000.00	13,454,278.92
4.25 T-NOTE 260131	9,390,000.00	9,303,435.93
4.25 T-NOTE 270315	11,800,000.00	11,721,640.68
4.25 T-NOTE 290228	11,330,000.00	11,316,280.04
4.25 T-NOTE 310228	8,180,000.00	8,180,639.02
4.375 T-BOND 380215	1,280,000.00	1,298,175.00
4.375 T-BOND 391115	2,270,000.00	2,286,581.64
4.375 T-BOND 400515	2,080,000.00	2,091,050.00
4.375 T-BOND 410515	1,960,000.00	1,960,038.27
4.375 T-BOND 430815	7,570,000.00	7,453,197.23
4.375 T-NOTE 260815	7,600,000.00	7,555,320.27
4.375 T-NOTE 261215	9,640,000.00	9,596,318.75
4.375 T-NOTE 280831	7,000,000.00	7,010,937.50
4.375 T-NOTE 281130	9,310,000.00	9,337,093.58
4.375 T-NOTE 301130	6,250,000.00	6,290,527.37
4.375 T-NOTE 340515	2,430,000.00	2,455,628.90
4.5 T-BOND 360215	1,160,000.00	1,196,839.05
4.5 T-BOND 380515	1,330,000.00	1,364,860.55
4.5 T-BOND 390815	1,880,000.00	1,921,345.31
4.5 T-BOND 440215	6,130,000.00	6,135,746.87
4.5 T-NOTE 251115	7,500,000.00	7,456,201.19
4.5 T-NOTE 260331	5,980,000.00	5,950,917.58
4.5 T-NOTE 260715	6,500,000.00	6,476,259.79
4.5 T-NOTE 270415	13,000,000.00	13,000,000.00
4.5 T-NOTE 331115	19,430,000.00	19,804,938.37
4.625 T-BOND 400215	2,100,000.00	2,173,746.09
4.625 T-BOND 440515	1,700,000.00	1,732,406.24
4.625 T-BOND 540515	2,570,000.00	2,677,217.17
4.625 T-NOTE 250630	2,450,000.00	2,438,682.61
4.625 T-NOTE 260228	19,800,000.00	19,738,898.38
4.625 T-NOTE 260315	6,000,000.00	5,981,718.72
4.625 T-NOTE 260915	7,500,000.00	7,496,337.90
4.625 T-NOTE 261015	6,800,000.00	6,801,195.30
4.625 T-NOTE 261115	8,720,000.00	8,727,153.10
4.625 T-NOTE 280930	8,030,000.00	8,121,905.83
4.625 T-NOTE 290430	4,550,000.00	4,617,894.55
4.625 T-NOTE 300930	5,700,000.00	5,811,773.46
4.625 T-NOTE 310430	2,700,000.00	2,760,750.00
4.75 T-BOND 410215	2,010,000.00	2,103,433.60
4.75 T-BOND 431115	6,220,000.00	6,429,925.00
4.75 T-BOND 531115	11,120,000.00	11,818,474.99
4.75 T-NOTE 250731	7,500,000.00	7,477,001.92

		4.875 T-NOTE 251130	8,400,000.00	8,395,078.10	
		4.875 T-NOTE 281031	8,500,000.00	8,685,605.49	
		4.875 T-NOTE 301031	6,100,000.00	6,306,828.12	
		5 T-BOND 370515	1,020,000.00	1,099,249.21	
		5 T-NOTE 250831	8,500,000.00	8,496,347.63	
		5 T-NOTE 250930	7,600,000.00	7,600,593.71	
		5 T-NOTE 251031	9,500,000.00	9,505,380.89	
		5.25 T-BOND 281115	2,690,000.00	2,793,554.48	
		5.375 T-BOND 310215	1,300,000.00	1,390,847.65	
		6 T-BOND 260215	1,200,000.00	1,225,921.87	
		6.125 T-BOND 271115	1,160,000.00	1,223,732.03	
		6.25 T-BOND 300515	1,150,000.00	1,267,964.83	
アメリカドル合計			2,136,200,000.00	1,928,996,584.98 (307,790,695,099)	
カナダドル	国債証券	0.25 CAN GOVT 260301	2,200,000.00	2,069,987.48	
		0.5 CAN GOVT 250901	2,900,000.00	2,779,582.16	
		0.5 CAN GOVT 301201	4,500,000.00	3,773,551.50	
		1 CAN GOVT 260901	2,500,000.00	2,356,279.07	
		1 CAN GOVT 270601	1,930,000.00	1,795,560.61	
		1.25 CAN GOVT 270301	2,500,000.00	2,349,947.15	
		1.25 CAN GOVT 300601	5,710,000.00	5,080,487.68	
		1.5 CAN GOVT 260601	4,070,000.00	3,896,539.48	
		1.5 CAN GOVT 310601	5,900,000.00	5,237,148.39	
		1.5 CAN GOVT 311201	4,930,000.00	4,339,379.34	
		1.75 CAN GOVT 531201	5,550,000.00	3,963,974.11	
		2 CAN GOVT 280601	2,670,000.00	2,537,292.99	
		2 CAN GOVT 320601	5,350,000.00	4,855,271.64	
		2 CAN GOVT 511201	7,140,000.00	5,487,419.65	
		2.25 CAN GOVT 250601	4,360,000.00	4,278,048.21	
		2.25 CAN GOVT 290601	2,210,000.00	2,109,244.81	
		2.25 CAN GOVT 291201	1,000,000.00	951,290.52	
		2.5 CAN GOVT 321201	3,500,000.00	3,287,223.03	
		2.75 CAN GOVT 270901	2,000,000.00	1,955,130.76	
		2.75 CAN GOVT 330601	3,000,000.00	2,864,985.84	
		2.75 CAN GOVT 481201	1,680,000.00	1,528,857.52	
		2.75 CAN GOVT 551201	2,990,000.00	2,693,171.24	
		2.75 CANADA GOVER 641201	1,250,000.00	1,122,559.08	
		3 CAN GOVT 251001	3,000,000.00	2,957,290.26	
		3 CAN GOVT 340601	4,540,000.00	4,409,994.68	
		3.25 CAN GOVT 280901	2,600,000.00	2,584,742.08	
		3.25 CAN GOVT 331201	3,170,000.00	3,146,759.93	
		3.5 CAN GOVT 280301	2,000,000.00	2,003,412.68	

		3.5 CAN GOVT 340301	2,020,000.00	2,049,952.62	
		3.5 CAN GOVT 451201	1,650,000.00	1,696,748.72	
		4 CAN GOVT 260501	3,200,000.00	3,204,691.80	
		4 CAN GOVT 290301	5,060,000.00	5,197,944.84	
		4 CAN GOVT 410601	1,200,000.00	1,301,663.11	
		4.5 CAN GOVT 251101	2,540,000.00	2,551,532.89	
		4.5 CAN GOVT 260201	5,200,000.00	5,237,370.32	
		5 CAN GOVT 370601	1,330,000.00	1,557,288.70	
		5.75 CAN GOVT 290601	950,000.00	1,055,709.39	
		5.75 CAN GOVT 330601	1,430,000.00	1,693,950.25	
カナダドル合計			119,730,000.00	111,961,984.53 (13,081,638,272)	
オーストラリアドル	国債証券	0.25 AUST GOVT 251121	3,650,000.00	3,456,670.08	
		0.5 AUST GOVT 260921	4,100,000.00	3,798,137.13	
		1 AUST GOVT 301221	4,260,000.00	3,527,439.75	
		1 AUST GOVT 311121	5,310,000.00	4,265,238.86	
		1.25 AUST GOVT 320521	5,070,000.00	4,090,030.39	
		1.5 AUST GOVT 310621	3,740,000.00	3,159,154.13	
		1.75 AUST GOVT 321121	5,090,000.00	4,222,217.25	
		1.75 AUST GOVT 510621	3,490,000.00	1,950,811.79	
		2.25 AUST GOVT 280521	2,900,000.00	2,725,469.61	
		2.5 AUST GOVT 300521	3,940,000.00	3,631,474.12	
		2.75 AUST GOVT 271121	4,390,000.00	4,226,655.47	
		2.75 AUST GOVT 281121	3,040,000.00	2,896,440.89	
		2.75 AUST GOVT 291121	2,980,000.00	2,804,319.70	
		2.75 AUST GOVT 350621	2,220,000.00	1,928,736.04	
		2.75 AUST GOVT 410521	2,170,000.00	1,720,214.13	
		3 AUST GOVT 331121	4,100,000.00	3,720,242.46	
		3 AUST GOVT 470321	2,420,000.00	1,873,090.83	
		3.25 AUST GOVT 290421	3,400,000.00	3,296,640.81	
		3.25 AUST GOVT 390621	2,130,000.00	1,858,581.46	
		3.5 AUST GOVT 341221	3,090,000.00	2,898,600.36	
		3.75 AUST GOVT 340521	3,700,000.00	3,561,539.00	
		3.75 AUST GOVT 370421	3,150,000.00	2,976,279.35	
		4.25 AUST GOVT 260421	2,490,000.00	2,499,506.07	
		4.5 AUST GOVT 330421	3,900,000.00	3,990,312.30	
		4.75 AUST GOVT 270421	3,050,000.00	3,115,798.26	
		4.75 AUST GOVT 540621	1,270,000.00	1,301,567.62	
オーストラリアドル合計			89,050,000.00	79,495,167.86 (8,440,001,971)	
イギリス ポンド	国債証券	0.125 GILT 260130	2,600,000.00	2,438,904.00	
		0.125 GILT 280131	2,300,000.00	2,005,535.60	

0.25 GILT 310731	5,110,000.00	3,958,231.55	
0.375 GILT 261022	4,870,000.00	4,461,845.30	
0.375 GILT 301022	3,100,000.00	2,495,872.31	
0.5 GILT 290131	4,900,000.00	4,197,104.80	
0.5 GILT 611022	3,700,000.00	1,124,405.32	
0.625 GILT 250607	1,480,000.00	1,426,172.10	
0.625 GILT 350731	4,030,000.00	2,779,837.58	
0.625 GILT 501022	2,890,000.00	1,175,738.70	
0.875 GILT 291022	2,900,000.00	2,485,916.54	
0.875 GILT 330731	5,140,000.00	3,910,255.00	
0.875 GILT 460131	2,930,000.00	1,466,758.00	
1 GILT 320131	5,880,000.00	4,745,936.16	
1.125 GILT 390131	4,450,000.00	2,908,696.66	
1.125 GILT 731022	1,750,000.00	645,050.00	
1.25 GILT 270722	2,530,000.00	2,328,080.70	
1.25 GILT 411022	4,250,000.00	2,625,348.25	
1.25 GILT 510731	4,930,000.00	2,422,109.00	
1.5 GILT 260722	3,630,000.00	3,436,143.48	
1.5 GILT 470722	3,160,000.00	1,792,668.00	
1.5 GILT 530731	3,920,000.00	2,008,216.00	
1.625 GILT 281022	3,470,000.00	3,157,353.00	
1.625 GILT 541022	2,470,000.00	1,296,503.00	
1.625 GILT 711022	2,530,000.00	1,171,896.00	
1.75 GILT 370907	3,340,000.00	2,499,322.00	
1.75 GILT 490122	1,780,000.00	1,048,598.00	
1.75 GILT 570722	3,230,000.00	1,722,881.03	
2 GILT 250907	2,100,000.00	2,036,685.00	
2.5 GILT 650722	2,480,000.00	1,580,008.00	
3.25 GILT 330131	5,900,000.00	5,571,896.28	
3.25 GILT 440122	4,270,000.00	3,565,450.00	
3.5 GILT 251022	6,150,000.00	6,056,335.50	
3.5 GILT 450122	3,740,000.00	3,219,018.00	
3.5 GILT 680722	2,960,000.00	2,433,712.00	
3.75 GILT 270307	2,000,000.00	1,971,212.14	
3.75 GILT 380129	4,650,000.00	4,384,345.96	
3.75 GILT 520722	2,110,000.00	1,841,186.00	
3.75 GILT 531022	4,740,000.00	4,112,424.00	
4 GILT 311022	1,800,000.00	1,799,889.35	
4 GILT 600122	2,640,000.00	2,405,040.00	
4 GILT 631022	3,080,000.00	2,792,636.00	
4.125 GILT 270129	6,900,000.00	6,868,693.32	
4.125 GILT 290722	1,000,000.00	1,004,170.00	

		4.25 GILT 271207	2,450,000.00	2,466,754.57			
		4.25 GILT 320607	4,290,000.00	4,379,017.50			
		4.25 GILT 360307	2,910,000.00	2,928,344.64			
		4.25 GILT 390907	2,430,000.00	2,392,821.00			
		4.25 GILT 401207	2,420,000.00	2,367,486.00			
		4.25 GILT 461207	2,930,000.00	2,802,252.00			
		4.25 GILT 491207	2,470,000.00	2,352,922.00			
		4.25 GILT 551207	2,770,000.00	2,629,007.00			
		4.375 GILT 540731	1,780,000.00	1,720,192.00			
		4.5 GILT 280607	6,460,000.00	6,555,626.73			
		4.5 GILT 340907	2,300,000.00	2,374,907.31			
		4.5 GILT 421207	3,190,000.00	3,191,276.00			
		4.625 GILT 340131	4,220,000.00	4,401,284.44			
		4.75 GILT 301207	3,650,000.00	3,821,969.38			
		4.75 GILT 381207	2,310,000.00	2,411,409.00			
		4.75 GILT 431022	2,820,000.00	2,898,960.00			
		6 GILT 281207	1,890,000.00	2,046,454.20			
		イギリスポンド合計			205,080,000.00	171,118,763.40 (34,646,416,025)	
		シンガ ポールド ル	国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 261101	700,000.00	667,257.50	
1.625 SINGAPORGOV 310701	1,050,000.00			948,465.00			
1.875 SINGAPORGOV 500301	1,090,000.00			855,650.00			
1.875 SINGAPORGOV 511001	950,000.00			736,098.00			
2.125 SINGAPORGOV 260601	1,530,000.00			1,493,892.00			
2.25 SINGAPORGOVT 360801	1,300,000.00			1,183,650.00			
2.375 SINGAPORGOV 250601	1,560,000.00			1,543,043.50			
2.375 SINGAPORGOV 390701	780,000.00			706,145.70			
2.625 SINGAPORGOV 280501	800,000.00			783,600.00			
2.625 SINGAPORGOV 320801	700,000.00			672,980.00			
2.75 SINGAPORGOVT 420401	980,000.00			929,040.00			
2.75 SINGAPORGOVT 460301	1,480,000.00			1,394,145.20			
2.875 SINGAPORGOV 270901	1,000,000.00			989,700.00			
2.875 SINGAPORGOV 280801	1,000,000.00			988,300.00			
2.875 SINGAPORGOV 290701	1,760,000.00			1,736,592.00			
2.875SINGAPORGOVT 300901	1,340,000.00			1,317,890.00			
3 SINGAPORGOVT 720801	910,000.00			900,445.00			
3.375 SINGAPORGOV 330901	2,630,000.00			2,676,025.00			
3.5 SINGAPORGOVT 270301	2,700,000.00			2,717,010.00			
シンガポールドル合計			24,260,000.00	23,239,928.90 (2,741,846,811)			
マレーシ アリン ギット	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	6,280,000.00	5,850,707.48			
		3.502MALAYSIAGOVT 270531	3,000,000.00	2,997,617.52			
		3.519 MALAYSIAGOV 280420	3,500,000.00	3,489,961.79			

		3.582 MALAYSIAGOV 320715	2,370,000.00	2,328,193.03	
		3.733 MALAYSIAGO 280615	2,800,000.00	2,813,289.64	
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	3,980,000.00	3,841,294.85	
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	3,410,000.00	3,403,691.60	
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	2,400,000.00	2,397,074.28	
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	3,600,000.00	3,640,887.72	
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	4,400,000.00	4,443,174.12	
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	5,640,000.00	5,705,421.18	
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	2,900,000.00	2,931,796.47	
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	2,960,000.00	2,987,819.55	
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	1,740,000.00	1,753,650.30	
		4.054 MALAYSIAGOV 390418	660,000.00	663,960.00	
		4.065 MALAYSIAGOV 500615	5,250,000.00	5,123,914.21	
		4.232MALAYSIAGOV 310630	2,550,000.00	2,618,182.92	
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	2,600,000.00	2,672,259.46	
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	1,940,000.00	1,972,699.86	
		4.457 MALAYSIAGOV 530331	2,400,000.00	2,490,015.36	
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4,240,000.00	4,410,499.72	
		4.504 MALAYSIAGOV 290430	1,500,000.00	1,556,862.30	
		4.642 MALAYSIAGOV 331107	3,750,000.00	3,978,514.50	
		4.696 MALAYSIAGOV 421015	6,000,000.00	6,453,096.00	
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	1,650,000.00	1,778,835.30	
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4,440,000.00	4,783,120.09	
		4.893 MALAYSIAGOV 380608	3,360,000.00	3,680,016.48	
		4.921 MALAYSIAGOV 480706	2,720,000.00	3,012,508.52	
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	1,550,000.00	1,711,038.95	
マレーシアリングット合計			93,590,000.00	95,490,103.20 (3,234,584,010)	
ニュー ジーラン ドル	国債証券	0.25 NZ GOVT 280515	2,000,000.00	1,701,343.50	
		1.5 NZ GOVT 310515	1,870,000.00	1,543,229.99	
		1.75 NZ GOVT 410515	600,000.00	384,854.31	
		2 NZ GOVT 320515	2,300,000.00	1,918,090.72	
		2.75 NZ GOVT 370415	1,450,000.00	1,173,219.04	
		2.75 NZ GOVT 510515	1,180,000.00	801,747.61	
		3 NZ GOVT 290420	1,700,000.00	1,595,519.83	
		3.5 NZ GOVT 330414	1,900,000.00	1,756,880.84	
		4.25 NZ GOVT 340515	620,000.00	603,611.84	
		4.5 NZ GOVT 270415	1,800,000.00	1,796,259.45	
		4.5 NZ GOVT 300515	1,000,000.00	1,003,163.00	
		4.5 NZ GOVT 350515	1,200,000.00	1,185,108.22	
		5 NZ GOVT 540515	620,000.00	625,649.44	
					18,240,000.00

ニュージーランドドル合計				(1,571,059,386)	
スウェーデン クローネ	国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	9,450,000.00	8,221,645.53	
		0.75 SWD GOVT 280512	17,500,000.00	16,534,130.37	
		0.75 SWD GOVT 291112	12,200,000.00	11,403,531.29	
		1 SWD GOVT 261112	8,960,000.00	8,664,928.56	
		1.75 SWD GOVT 331111	11,500,000.00	11,070,587.58	
		2.25 SWD GOVT 320601	6,750,000.00	6,771,039.07	
		3.5 SWD GOVT 390330	6,470,000.00	7,413,390.70	
スウェーデンクローネ合計			72,830,000.00	70,079,253.10	(1,066,606,232)
ノルウェー クローネ	国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	4,700,000.00	4,007,862.72	
		1.375 NORWE GOVT 300819	15,770,000.00	13,857,830.25	
		1.5 NORWE GOVT 260219	6,040,000.00	5,803,129.92	
		1.75 NORWE GOVT 270217	5,120,000.00	4,869,632.00	
		1.75 NORWE GOVT 290906	4,600,000.00	4,204,392.18	
		2 NORWE GOVT 280426	6,900,000.00	6,507,997.20	
		2.125 NORWE GOVT 320518	10,500,000.00	9,457,796.25	
		3 NORWE GOVT 330815	8,700,000.00	8,309,967.42	
		3.5 NORWE GOVT 421006	4,000,000.00	4,021,700.00	
		3.625 NORWE GOVT 340413	4,100,000.00	4,120,585.28	
ノルウェークローネ合計			70,430,000.00	65,160,893.22	(985,884,314)
デンマーク クローネ	国債証券	0 DMK GOVT 311115	14,550,000.00	12,282,478.38	
		0.25 DMK GOVT 521115	9,730,000.00	5,219,147.67	
		0.5 DMK GOVT 271115	8,100,000.00	7,584,694.20	
		0.5 DMK GOVT 291115	10,550,000.00	9,569,333.92	
		1.75 DMK GOVT 251115	7,490,000.00	7,376,075.22	
		2.25 DMK GOVT 331115	6,800,000.00	6,692,240.32	
		4.5 DMK GOVT 391115	18,500,000.00	22,816,989.80	
デンマーククローネ合計			75,720,000.00	71,540,959.51	(1,642,580,430)
メキシコ ペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 361120	12,350,000.00	12,384,086.00	
		5.5 MEXICAN BONOS 270304	52,000,000.00	46,229,040.00	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	65,500,000.00	60,531,545.97	
		7 MEXICAN BONOS 260903	42,000,000.00	38,968,860.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	63,950,000.00	59,351,995.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 330526	60,200,000.00	51,470,398.00	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	68,050,000.00	60,373,279.50	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	23,400,000.00	20,083,284.00	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	57,940,000.00	46,593,609.80	
		8 MEXICAN BONOS 350524	5,000,000.00	4,359,000.00	
		8 MEXICAN BONOS 471107	47,100,000.00	38,362,008.00	

		8 MEXICAN BONOS 530731	46,270,000.00	37,207,095.10	
		8.5 MEXICAN BONOS 290301	23,420,000.00	21,942,432.20	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	48,650,000.00	45,658,511.50	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	39,700,000.00	35,051,924.00	
メキシコペソ合計			655,530,000.00	578,567,069.07 (5,145,775,512)	
イスラエル シェケル	国債証券	0.5 ISRAEL FIXED 260227	5,300,000.00	4,987,035.00	
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	6,620,000.00	5,442,302.00	
		1.3 ISRAEL FIXED 320430	4,800,000.00	3,742,080.00	
		1.5 ISRAEL FIXED 370531	4,900,000.00	3,286,675.00	
		2 ISRAEL FIXED BO 270331	7,000,000.00	6,603,100.00	
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	3,080,000.00	2,864,862.00	
		2.8 ISRAEL FIXED 521129	3,300,000.00	2,118,765.00	
		3.75 ISRAEL FIXED 290228	4,600,000.00	4,505,010.00	
		3.75 ISRAEL FIXED 470331	4,680,000.00	3,770,910.00	
		4 ISRAEL FIXED BO 350330	1,700,000.00	1,592,305.00	
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	3,130,000.00	3,320,617.00	
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	5,000,000.00	5,411,500.00	
イスラエルシェケル合計			54,110,000.00	47,645,161.00 (2,038,822,200)	
ポーランド ズロチ	国債証券	0.25 POLAND 261025	8,000,000.00	7,156,420.00	
		1.25 POLAND 301025	9,190,000.00	7,123,628.50	
		1.75 POLAND 320425	9,900,000.00	7,516,107.22	
		2.5 POLAND 260725	7,840,000.00	7,444,205.44	
		2.5 POLAND 270725	6,110,000.00	5,636,300.86	
		2.75 POLAND 280425	5,760,000.00	5,252,584.32	
		2.75 POLAND 291025	7,900,000.00	6,918,786.42	
		3.25 POLAND 250725	8,700,000.00	8,547,843.52	
		3.75 POLAND 270525	4,000,000.00	3,840,408.00	
		5.75 POLAND 290425	10,600,000.00	10,713,329.90	
		6 POLAND 331025	7,720,000.00	7,900,794.68	
		7.5 POLAND 280725	8,120,000.00	8,728,745.84	
ポーランドズロチ合計			93,840,000.00	86,779,154.70 (3,462,462,238)	
中国元	国債証券	1.99 CHINA GOVT 260315	35,000,000.00	35,165,550.00	
		2 CHINA GOVT 250615	42,000,000.00	42,143,430.00	
		2.04 CHINA GOVT 270225	62,000,000.00	62,306,435.00	
		2.05 CHINA GOVT 290415	12,000,000.00	12,018,000.00	
		2.18 CHINA GOVT 250825	34,000,000.00	34,203,000.40	
		2.18 CHINA GOVT 260815	39,000,000.00	39,321,679.80	
		2.22 CHINA GOVT 250925	50,000,000.00	50,351,750.00	
		2.28 CHINA GOVT 251125	34,000,000.00	34,279,670.40	

2.28 CHINA GOVT 310325	48,000,000.00	48,373,920.00	
2.3 CHINA GOVT 260515	54,000,000.00	54,568,193.40	
2.33 CHINA GOVT 251215	45,000,000.00	45,429,606.00	
2.35 CHINA GOVT 340225	26,000,000.00	26,206,154.00	
2.37 CHINA GOVT 270120	28,000,000.00	28,362,611.20	
2.37 CHINA GOVT 290115	58,000,000.00	58,915,437.20	
2.39 CHINA GOVT 261115	88,000,000.00	89,148,831.20	
2.4 CHINA GOVT 280715	63,000,000.00	63,963,011.70	
2.44 CHINA GOVT 271015	35,000,000.00	35,560,521.50	
2.46 CHINA GOVT 260215	86,000,000.00	87,001,263.60	
2.48 CHINA GOVT 270415	28,000,000.00	28,473,891.60	
2.48 CHINA GOVT 280925	18,000,000.00	18,341,908.20	
2.49 CHINA GOVT 440525	6,000,000.00	6,106,320.00	
2.5 CHINA GOVT 270725	61,000,000.00	62,097,926.80	
2.52 CHINA GOVT 330825	74,000,000.00	75,537,542.40	
2.54 CHINA GOVT 301225	65,000,000.00	66,569,951.50	
2.55 CHINA GOVT 281015	50,000,000.00	51,111,400.00	
2.6 CHINA GOVT 300915	52,000,000.00	53,396,777.20	
2.6 CHINA GOVT 320901	37,000,000.00	38,009,530.20	
2.62 CHINA GOVT 280415	71,000,000.00	72,641,299.90	
2.62 CHINA GOVT 290925	29,000,000.00	29,791,088.10	
2.62 CHINA GOVT 300625	60,000,000.00	61,653,246.00	
2.64 CHINA GOVT 280115	41,000,000.00	41,953,799.40	
2.67 CHINA GOVT 330525	52,000,000.00	53,613,825.20	
2.67 CHINA GOVT 331125	49,000,000.00	50,662,251.50	
2.68 CHINA GOVT 300521	55,000,000.00	56,707,458.50	
2.69 CHINA GOVT 260812	34,000,000.00	34,648,703.00	
2.69 CHINA GOVT 320815	48,000,000.00	49,621,516.80	
2.74 CHINA GOVT 260804	24,000,000.00	24,496,404.00	
2.75 CHINA GOVT 290615	30,000,000.00	31,008,762.00	
2.75 CHINA GOVT 320217	30,000,000.00	31,162,080.00	
2.76 CHINA GOVT 320515	37,000,000.00	38,435,292.90	
2.79 CHINA GOVT 291215	31,000,000.00	32,104,272.70	
2.8 CHINA GOVT 290324	62,000,000.00	64,154,066.00	
2.8 CHINA GOVT 300325	45,000,000.00	46,653,592.50	
2.8 CHINA GOVT 321115	29,000,000.00	30,234,411.10	
2.85 CHINA GOVT 270604	32,000,000.00	32,913,516.80	
2.88 CHINA GOVT 330225	36,000,000.00	37,803,412.80	
2.89 CHINA GOVT 311118	27,000,000.00	28,335,004.20	
2.9 CHINA GOVT 260505	24,000,000.00	24,531,988.80	
2.91 CHINA GOVT 281014	32,000,000.00	33,207,772.80	
2.99 CHINA GOVT 251015	39,000,000.00	39,697,936.20	

		3 CHINA GOVT 531015	25,000,000.00	27,838,280.00	
		3.01 CHINA GOVT 280513	39,000,000.00	40,598,106.90	
		3.02 CHINA GOVT 251022	36,000,000.00	36,665,982.00	
		3.02 CHINA GOVT 310527	39,000,000.00	41,213,296.80	
		3.03 CHINA GOVT 260311	28,000,000.00	28,649,037.20	
		3.12 CHINA GOVT 261205	37,000,000.00	38,249,419.70	
		3.12 CHINA GOVT 521025	21,000,000.00	23,651,924.10	
		3.13 CHINA GOVT 291121	24,000,000.00	25,355,671.20	
		3.19 CHINA GOVT 530415	19,000,000.00	21,700,000.70	
		3.22 CHINA GOVT 251206	18,000,000.00	18,426,850.20	
		3.25 CHINA GOVT 260606	28,000,000.00	28,862,666.00	
		3.25 CHINA GOVT 281122	25,000,000.00	26,416,552.50	
		3.27 CHINA GOVT 301119	35,000,000.00	37,582,846.00	
		3.28 CHINA GOVT 271203	24,000,000.00	25,190,832.00	
		3.29 CHINA GOVT 290523	29,000,000.00	30,858,227.20	
		3.32 CHINA GOVT 520415	21,000,000.00	24,453,044.70	
		3.39 CHINA GOVT 500316	43,000,000.00	50,259,862.00	
		3.52 CHINA GOVT 270504	7,000,000.00	7,371,459.90	
		3.53 CHINA GOVT 511018	31,000,000.00	37,319,489.50	
		3.54 CHINA GOVT 280816	13,000,000.00	13,918,099.00	
		3.59 CHINA GOVT 270803	7,000,000.00	7,417,640.30	
		3.6 CHINA GOVT 250906	8,000,000.00	8,213,268.00	
		3.61 CHINA GOVT 250607	10,000,000.00	10,220,935.00	
		3.69 CHINA GOVT 280517	15,000,000.00	16,113,468.00	
		3.72 CHINA GOVT 510412	23,000,000.00	28,471,495.30	
		3.81 CHINA GOVT 500914	39,000,000.00	48,802,685.10	
		3.86 CHINA GOVT 490722	33,000,000.00	41,413,960.50	
		4.08 CHINA GOVT 481022	29,000,000.00	37,404,403.00	
中国元合計			2,853,000,000.00	2,975,635,517.30 (65,386,614,857)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 281020	1,790,000.00	1,586,869.01	
		0 AUSTRIA GOVT 300220	3,100,000.00	2,645,614.40	
		0 AUSTRIA GOVT 310220	2,720,000.00	2,251,254.24	
		0 AUSTRIA GOVT 401020	1,170,000.00	700,903.12	
		0 BEL GOVT 271022	1,800,000.00	1,641,114.00	
		0 BEL GOVT 311022	2,300,000.00	1,868,379.12	
		0 BUND 260815	5,930,000.00	5,603,099.85	
		0 BUND 271115	3,100,000.00	2,851,042.87	
		0 BUND 281115	5,500,000.00	4,955,960.62	
		0 BUND 290815	4,550,000.00	4,034,842.17	
		0 BUND 300215	4,820,000.00	4,227,135.18	
		0 BUND 300815	6,660,000.00	5,782,945.66	

0 BUND 300815	1,550,000.00	1,346,772.13	
0 BUND 310215	5,140,000.00	4,413,671.74	
0 BUND 310815	5,400,000.00	4,584,920.38	
0 BUND 310815	1,900,000.00	1,614,001.55	
0 BUND 320215	4,690,000.00	3,931,644.58	
0 BUND 350515	3,630,000.00	2,782,266.13	
0 BUND 360515	4,270,000.00	3,180,607.71	
0 BUND 500815	7,470,000.00	3,842,457.20	
0 BUND 500815	1,560,000.00	805,807.86	
0 BUND 520815	5,150,000.00	2,528,199.91	
0 FINNISH GOVT 260915	1,800,000.00	1,687,164.75	
0 FINNISH GOVT 300915	750,000.00	630,301.87	
0 IRISH GOVT 311018	1,900,000.00	1,558,919.60	
0 ITALY GOVT 260401	3,300,000.00	3,112,376.85	
0 ITALY GOVT 260801	5,000,000.00	4,667,080.50	
0 NETH GOVT 260115	2,200,000.00	2,102,994.30	
0 NETH GOVT 270115	1,950,000.00	1,819,859.18	
0 NETH GOVT 290115	2,380,000.00	2,114,725.20	
0 NETH GOVT 300715	2,650,000.00	2,265,695.67	
0 NETH GOVT 310715	2,540,000.00	2,114,696.22	
0 NETH GOVT 380115	2,280,000.00	1,550,278.33	
0 NETH GOVT 520115	3,690,000.00	1,745,584.27	
0 O.A.T 260225	7,790,000.00	7,397,887.30	
0 O.A.T 270225	8,240,000.00	7,613,800.20	
0 O.A.T 291125	8,130,000.00	6,957,940.57	
0 O.A.T 301125	8,840,000.00	7,334,227.54	
0 O.A.T 311125	11,400,000.00	9,161,932.05	
0 O.A.T 320525	6,030,000.00	4,766,880.82	
0 OBL 251010	4,000,000.00	3,850,206.00	
0 OBL 251010	1,000,000.00	962,740.62	
0 OBL 260410	6,910,000.00	6,577,933.04	
0 OBL 261009	2,900,000.00	2,729,726.64	
0 OBL 270416	3,830,000.00	3,565,890.47	
0 SPAIN GOVT 250531	2,500,000.00	2,422,875.30	
0 SPAIN GOVT 260131	3,000,000.00	2,855,277.00	
0 SPAIN GOVT 270131	9,400,000.00	8,696,090.40	
0 SPAIN GOVT 280131	5,320,000.00	4,788,383.04	
0.1 BEL GOVT 300622	3,020,000.00	2,573,968.65	
0.1 SPAIN GOVT 310430	4,360,000.00	3,583,118.85	
0.125 FINNISH GOV 310915	1,070,000.00	880,294.35	
0.125 FINNISH GOV 360415	1,120,000.00	794,659.04	
0.125 FINNISH GOV 520415	750,000.00	340,984.35	

0.2 IRISH GOVT 270515	500,000.00	465,027.31
0.2 IRISH GOVT 301018	2,130,000.00	1,826,534.76
0.25 AUSTRIA GOVT 361020	1,490,000.00	1,058,668.84
0.25 BUND 280815	4,640,000.00	4,250,278.27
0.25 BUND 290215	4,850,000.00	4,402,126.75
0.25 FINNISH GOVT 400915	540,000.00	341,118.54
0.25 ITALY GOVT 280315	4,760,000.00	4,253,399.14
0.25 NETH GOVT 250715	3,290,000.00	3,192,841.12
0.25 NETH GOVT 290715	2,950,000.00	2,625,199.10
0.25 O.A.T 261125	7,360,000.00	6,888,207.44
0.35 BEL GOVT 320622	2,940,000.00	2,405,066.61
0.35 IRISH GOVT 321018	800,000.00	658,090.60
0.4 BEL GOVT 400622	1,660,000.00	1,061,934.15
0.4 IRISH GOVT 350515	1,020,000.00	783,849.60
0.45 ITALY GOVT 290215	2,300,000.00	2,013,733.95
0.5 AUSTRIA GOVT 270420	2,100,000.00	1,965,392.62
0.5 AUSTRIA GOVT 290220	2,050,000.00	1,845,579.12
0.5 BUND 260215	6,660,000.00	6,412,829.08
0.5 BUND 270815	5,120,000.00	4,812,761.60
0.5 BUND 280215	4,280,000.00	3,992,129.34
0.5 FINNISH GOVT 260415	1,670,000.00	1,596,518.53
0.5 FINNISH GOVT 270915	700,000.00	650,935.18
0.5 FINNISH GOVT 280915	1,480,000.00	1,344,091.82
0.5 FINNISH GOVT 290915	1,350,000.00	1,200,176.72
0.5 FINNISH GOVT 430415	780,000.00	486,002.86
0.5 ITALY GOVT 260201	2,450,000.00	2,341,567.77
0.5 ITALY GOVT 280715	2,400,000.00	2,145,055.20
0.5 NETH GOVT 260715	3,970,000.00	3,790,377.35
0.5 NETH GOVT 320715	2,300,000.00	1,941,764.21
0.5 NETH GOVT 400115	2,630,000.00	1,855,944.02
0.5 O.A.T 260525	10,240,000.00	9,753,738.64
0.5 O.A.T 290525	10,330,000.00	9,194,887.95
0.5 O.A.T 400525	4,680,000.00	3,024,187.82
0.5 O.A.T 440625	3,890,000.00	2,245,799.10
0.5 O.A.T 720525	2,310,000.00	844,754.24
0.5 SPAIN GOVT 300430	4,580,000.00	3,981,664.76
0.5 SPAIN GOVT 311031	4,340,000.00	3,620,731.80
0.55 IRISH GOVT 410422	600,000.00	401,277.00
0.6 ITALY GOVT 310801	3,100,000.00	2,524,868.62
0.6 SPAIN GOVT 291031	3,680,000.00	3,256,087.00
0.65 BEL GOVT 710622	1,090,000.00	450,111.29
0.7 AUSTRIA GOVT 710420	680,000.00	298,456.32
0.7 SPAIN GOVT 320430	3,800,000.00	3,174,667.25

0.75 AUSTRIA GOVT 261020	2,480,000.00	2,357,900.49	
0.75 AUSTRIA GOVT 280220	2,940,000.00	2,728,925.64	
0.75 AUSTRIA GOVT 510320	1,570,000.00	891,569.24	
0.75 FINNISH GOVT 310415	1,050,000.00	915,207.56	
0.75 NETH GOVT 270715	4,170,000.00	3,938,081.28	
0.75 NETH GOVT 280715	3,020,000.00	2,804,879.36	
0.75 O.A.T 280225	11,000,000.00	10,169,212.56	
0.75 O.A.T 280525	9,750,000.00	8,969,817.18	
0.75 O.A.T 281125	10,340,000.00	9,417,335.95	
0.75 O.A.T 520525	5,560,000.00	2,849,555.60	
0.75 O.A.T 530525	5,390,000.00	2,698,328.32	
0.8 BEL GOVT 250622	4,170,000.00	4,068,285.15	
0.8 BEL GOVT 270622	2,880,000.00	2,713,233.60	
0.8 BEL GOVT 280622	2,740,000.00	2,538,774.40	
0.8 SPAIN GOVT 270730	4,670,000.00	4,371,281.11	
0.8 SPAIN GOVT 290730	5,430,000.00	4,879,950.49	
0.85 AUSTRIA GOVT 200630	830,000.00	367,982.57	
0.85 ITALY GOVT 270115	3,060,000.00	2,879,039.25	
0.85 SPAIN GOVT 370730	2,470,000.00	1,789,471.77	
0.875 FINNISH GOV 250915	630,000.00	612,648.54	
0.9 AUSTRIA GOVT 320220	2,120,000.00	1,831,025.45	
0.9 BEL GOVT 290622	3,090,000.00	2,822,876.45	
0.9 IRISH GOVT 280515	1,640,000.00	1,533,115.72	
0.9 ITALY GOVT 310401	4,230,000.00	3,558,250.62	
0.95 ITALY GOVT 270915	4,000,000.00	3,715,900.00	
0.95 ITALY GOVT 300801	2,940,000.00	2,528,139.81	
0.95 ITALY GOVT 311201	4,330,000.00	3,585,460.70	
0.95 ITALY GOVT 320601	2,800,000.00	2,284,466.80	
0.95 ITALY GOVT 370301	3,020,000.00	2,104,747.47	
1 BEL GOVT 260622	2,760,000.00	2,654,519.70	
1 BEL GOVT 310622	3,430,000.00	3,030,712.84	
1 BUND 250815	5,580,000.00	5,450,901.12	
1 BUND 380515	3,810,000.00	3,113,214.81	
1 IRISH GOVT 260515	1,850,000.00	1,785,666.25	
1 O.A.T 251125	6,580,000.00	6,379,191.56	
1 O.A.T 270525	7,540,000.00	7,125,854.19	
1 SPAIN GOVT 420730	2,070,000.00	1,347,712.83	
1 SPAIN GOVT 501031	3,650,000.00	1,980,143.25	
1.1 IRISH GOVT 290515	1,610,000.00	1,495,264.86	
1.1 ITALY GOVT 270401	3,300,000.00	3,109,904.65	
1.125 FINNISH GOV 340415	730,000.00	615,992.52	
1.2 AUSTRIA GOVT 251020	2,710,000.00	2,641,823.17	

1.2 ITALY GOVT 250815	2,100,000.00	2,047,012.80
1.2 SPAIN GOVT 401031	3,400,000.00	2,382,794.80
1.25 BEL GOVT 330422	1,770,000.00	1,542,261.18
1.25 BUND 480815	6,260,000.00	4,746,629.34
1.25 ITALY GOVT 261201	4,080,000.00	3,888,657.09
1.25 O.A.T 340525	9,110,000.00	7,662,165.92
1.25 O.A.T 360525	7,890,000.00	6,345,066.59
1.25 O.A.T 380525	4,320,000.00	3,314,753.28
1.25 SPAIN GOVT 301031	4,930,000.00	4,435,819.26
1.3 IRISH GOVT 330515	860,000.00	760,803.51
1.3 OBL 271015	5,750,000.00	5,533,325.62
1.3 OBL 271015	800,000.00	770,050.00
1.3 SPAIN GOVT 261031	4,750,000.00	4,566,638.12
1.35 IRISH GOVT 310318	1,070,000.00	982,403.11
1.35 ITALY GOVT 300401	3,610,000.00	3,211,798.95
1.375 FINNISH GOV 270415	800,000.00	768,060.84
1.375 FINNISH GOV 470415	990,000.00	704,958.05
1.4 BEL GOVT 530622	2,040,000.00	1,265,113.14
1.4 SPAIN GOVT 280430	4,660,000.00	4,401,230.20
1.4 SPAIN GOVT 280730	4,240,000.00	3,991,189.38
1.45 BEL GOVT 370622	1,220,000.00	995,117.40
1.45 ITALY GOVT 360301	2,440,000.00	1,869,607.30
1.45 SPAIN GOVT 271031	4,330,000.00	4,123,812.80
1.45 SPAIN GOVT 290430	4,280,000.00	3,996,658.65
1.45 SPAIN GOVT 711031	1,300,000.00	634,546.25
1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1,810,000.00	1,314,600.21
1.5 AUSTRIA GOVT 861102	460,000.00	271,478.89
1.5 FINNISH GOVT 320915	750,000.00	672,911.62
1.5 IRISH GOVT 500515	1,460,000.00	1,035,586.76
1.5 ITALY GOVT 250601	3,300,000.00	3,240,785.62
1.5 ITALY GOVT 450430	2,880,000.00	1,802,620.80
1.5 O.A.T 310525	10,790,000.00	9,817,574.77
1.5 O.A.T 500525	6,180,000.00	4,065,597.97
1.5 SPAIN GOVT 270430	4,290,000.00	4,117,059.37
1.6 BEL GOVT 470622	1,800,000.00	1,276,365.60
1.6 ITALY GOVT 260601	4,120,000.00	3,987,696.50
1.65 ITALY GOVT 301201	3,870,000.00	3,449,020.70
1.65 ITALY GOVT 320301	4,450,000.00	3,867,919.53
1.7 BEL GOVT 500622	1,840,000.00	1,282,417.44
1.7 BUND 320815	5,530,000.00	5,265,569.22
1.7 IRISH GOVT 370515	1,190,000.00	1,025,798.14
1.7 ITALY GOVT 510901	2,900,000.00	1,739,304.00
1.75 O.A.T 390625	5,550,000.00	4,509,313.95

1.75 O.A.T 660525	2,970,000.00	1,885,479.25	
1.8 BUND 530815	4,780,000.00	4,000,052.18	
1.8 BUND 530815	1,000,000.00	838,017.00	
1.8 ITALY GOVT 410301	2,950,000.00	2,105,536.68	
1.85 AUSTRIA GOVT 490523	1,130,000.00	867,190.25	
1.85 ITALY GOVT 250701	4,650,000.00	4,576,225.42	
1.85 SPAIN GOVT 350730	3,200,000.00	2,760,764.80	
1.9 BEL GOVT 380622	1,360,000.00	1,153,381.32	
1.9 SPAIN GOVT 521031	3,170,000.00	2,118,782.03	
1.95 SPAIN GOVT 260430	3,520,000.00	3,447,535.94	
1.95 SPAIN GOVT 300730	3,790,000.00	3,576,357.70	
2 AUSTRIA GOVT 260715	1,000,000.00	980,512.50	
2 IRISH GOVT 450218	1,970,000.00	1,636,932.10	
2 ITALY GOVT 251201	3,530,000.00	3,464,039.93	
2 ITALY GOVT 280201	3,880,000.00	3,709,241.20	
2 NETH GOVT 540115	2,030,000.00	1,692,756.10	
2 O.A.T 321125	7,450,000.00	6,874,537.78	
2 O.A.T 480525	4,970,000.00	3,749,605.41	
2.05 ITALY GOVT 270801	2,650,000.00	2,554,292.94	
2.1 AUSTRIA GOVT 170920	950,000.00	700,911.44	
2.1 BUND 291115	4,460,000.00	4,390,660.38	
2.1 ITALY GOVT 260715	2,350,000.00	2,293,644.06	
2.1 OBL 290412	4,560,000.00	4,492,610.03	
2.15 BEL GOVT 660622	1,530,000.00	1,116,974.80	
2.15 ITALY GOVT 520901	1,550,000.00	1,012,549.12	
2.15 ITALY GOVT 720301	1,410,000.00	845,979.55	
2.15 SPAIN GOVT 251031	8,000,000.00	7,889,612.64	
2.2 BUND 340215	5,050,000.00	4,956,792.15	
2.2 ITALY GOVT 270601	3,380,000.00	3,278,878.30	
2.2 OBL 280413	4,250,000.00	4,206,363.12	
2.25 BEL GOVT 570622	1,300,000.00	983,867.30	
2.25 ITALY GOVT 360901	2,720,000.00	2,264,454.40	
2.3 BUND 330215	6,190,000.00	6,153,596.61	
2.3 BUND 330215	1,670,000.00	1,660,583.70	
2.35 SPAIN GOVT 330730	4,090,000.00	3,820,970.02	
2.4 AUSTRIA GOVT 340523	1,690,000.00	1,604,500.36	
2.4 BUND 301115	2,580,000.00	2,580,696.60	
2.4 IRISH GOVT 300515	1,490,000.00	1,465,415.00	
2.4 OBL 281019	4,820,000.00	4,808,389.81	
2.45 ITALY GOVT 330901	3,420,000.00	3,076,820.10	
2.45 ITALY GOVT 500901	2,750,000.00	1,961,190.00	
2.5 BUND 440704	5,360,000.00	5,242,937.60	

2.5 BUND 460815	5,660,000.00	5,535,451.70
2.5 BUND 540815	2,360,000.00	2,304,537.29
2.5 ITALY GOVT 251115	2,330,000.00	2,303,600.51
2.5 ITALY GOVT 321201	3,950,000.00	3,610,857.93
2.5 NETH GOVT 300115	1,900,000.00	1,886,082.50
2.5 NETH GOVT 330115	2,750,000.00	2,714,036.87
2.5 NETH GOVT 330715	1,910,000.00	1,877,821.27
2.5 NETH GOVT 340715	1,050,000.00	1,026,378.53
2.5 O.A.T 260924	8,300,000.00	8,196,714.80
2.5 O.A.T 270924	2,800,000.00	2,758,008.40
2.5 O.A.T 300525	11,270,000.00	11,005,799.08
2.5 O.A.T 430525	3,030,000.00	2,610,840.40
2.5 SCHATS 260319	2,500,000.00	2,484,181.25
2.5 SPAIN GOVT 270531	1,400,000.00	1,379,635.25
2.55 SPAIN GOVT 321031	4,360,000.00	4,173,719.00
2.6 BUND 330815	4,910,000.00	4,992,831.70
2.6 IRISH GOVT 341018	850,000.00	829,530.93
2.625 FINNISH GOV 420704	940,000.00	866,689.81
2.65 ITALY GOVT 271201	2,800,000.00	2,741,506.60
2.7 BEL GOVT 291022	800,000.00	795,620.40
2.7 ITALY GOVT 470301	3,300,000.00	2,555,380.44
2.7 SPAIN GOVT 481031	3,670,000.00	3,045,017.05
2.75 BEL GOVT 390422	950,000.00	890,215.55
2.75 FINNISH GOVT 280704	1,110,000.00	1,109,142.33
2.75 FINNISH GOVT 380415	680,000.00	646,995.52
2.75 NETH GOVT 470115	3,320,000.00	3,267,120.70
2.75 O.A.T 271025	10,320,000.00	10,241,717.63
2.75 O.A.T 290225	7,900,000.00	7,832,077.77
2.75 O.A.T 300225	1,950,000.00	1,928,425.15
2.8 ITALY GOVT 281201	3,680,000.00	3,599,224.03
2.8 ITALY GOVT 290615	3,200,000.00	3,110,592.00
2.8 ITALY GOVT 670301	1,510,000.00	1,088,009.51
2.8 SCHATS 250612	3,470,000.00	3,456,839.15
2.8 SPAIN GOVT 260531	3,500,000.00	3,479,210.00
2.85 BEL GOVT 341022	1,850,000.00	1,816,513.15
2.875 FINNISH GOV 290415	600,000.00	601,207.92
2.9 AUSTRIA GOVT 290523	700,000.00	703,172.75
2.9 AUSTRIA GOVT 330220	2,710,000.00	2,700,880.85
2.9 AUSTRIA GOVT 340220	1,470,000.00	1,459,317.14
2.9 SCHATS 260618	2,500,000.00	2,505,397.25
2.9 SPAIN GOVT 461031	3,540,000.00	3,087,588.00
2.95 FINNISH GOVT 550415	670,000.00	636,031.00
2.95 ITALY GOVT 270215	830,000.00	822,102.64

2.95 ITALY GOVT 380901	2,730,000.00	2,389,024.36	
3 BEL GOVT 330622	2,750,000.00	2,757,157.42	
3 BEL GOVT 340622	2,050,000.00	2,045,150.72	
3 FINNISH GOVT 330915	1,720,000.00	1,723,608.56	
3 FINNISH GOVT 340915	700,000.00	698,910.66	
3 IRISH GOVT 431018	690,000.00	677,762.16	
3 ITALY GOVT 290801	5,420,000.00	5,316,450.90	
3 O.A.T 330525	6,130,000.00	6,086,884.64	
3 O.A.T 490625	1,080,000.00	986,115.60	
3 O.A.T 540525	4,370,000.00	3,887,787.98	
3.1 ITALY GOVT 400301	2,310,000.00	2,020,336.39	
3.1 SCHATS 251212	4,000,000.00	4,005,856.00	
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	1,250,000.00	1,237,103.12	
3.15 AUSTRIA GOVT 531020	1,070,000.00	1,049,118.95	
3.15 SPAIN GOVT 330430	4,400,000.00	4,388,346.60	
3.2 AUSTRIA GOVT 390715	400,000.00	400,151.00	
3.2 ITALY GOVT 260128	4,450,000.00	4,434,184.70	
3.25 BUND 420704	3,640,000.00	3,956,043.00	
3.25 ITALY GOVT 380301	2,220,000.00	2,018,646.00	
3.25 ITALY GOVT 460901	2,740,000.00	2,340,480.60	
3.25 NETH GOVT 440115	1,330,000.00	1,399,532.40	
3.25 O.A.T 450525	5,600,000.00	5,396,312.32	
3.25 O.A.T 550525	2,080,000.00	1,932,460.91	
3.25 SPAIN GOVT 340430	3,710,000.00	3,702,449.40	
3.3 BEL GOVT 540622	1,690,000.00	1,609,339.68	
3.35 ITALY GOVT 290701	1,400,000.00	1,394,295.00	
3.35 ITALY GOVT 350301	3,110,000.00	2,955,274.39	
3.4 ITALY GOVT 280401	3,000,000.00	3,006,441.00	
3.45 AUSTRIA GOVT 301020	910,000.00	941,086.69	
3.45 BEL GOVT 430622	770,000.00	773,424.96	
3.45 ITALY GOVT 480301	3,470,000.00	3,038,976.82	
3.45 SPAIN GOVT 430730	2,460,000.00	2,359,688.58	
3.45 SPAIN GOVT 660730	2,800,000.00	2,535,639.61	
3.5 BEL GOVT 550622	1,180,000.00	1,160,981.09	
3.5 ITALY GOVT 260115	2,500,000.00	2,503,272.50	
3.5 ITALY GOVT 300301	4,470,000.00	4,481,583.11	
3.5 ITALY GOVT 310215	2,040,000.00	2,028,956.05	
3.5 O.A.T 260425	6,690,000.00	6,734,697.22	
3.5 O.A.T 331125	8,080,000.00	8,320,859.93	
3.5 SPAIN GOVT 290531	3,380,000.00	3,461,610.10	
3.55 SPAIN GOVT 331031	4,120,000.00	4,223,587.09	
3.6 ITALY GOVT 250929	2,000,000.00	2,003,010.00	

3.7 ITALY GOVT 300615	2,350,000.00	2,371,012.52
3.75 BEL GOVT 450622	1,620,000.00	1,694,368.53
3.75 NETH GOVT 420115	3,240,000.00	3,620,017.33
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	1,050,000.00	1,179,325.87
3.8 ITALY GOVT 260415	2,700,000.00	2,720,120.40
3.8 ITALY GOVT 280801	3,090,000.00	3,140,197.05
3.85 ITALY GOVT 260915	2,800,000.00	2,830,251.20
3.85 ITALY GOVT 291215	3,890,000.00	3,962,543.83
3.85 ITALY GOVT 340701	1,620,000.00	1,615,939.47
3.85 ITALY GOVT 490901	2,450,000.00	2,269,796.37
3.9 SPAIN GOVT 390730	2,390,000.00	2,468,164.95
4 BEL GOVT 320328	1,620,000.00	1,739,939.13
4 BUND 370104	4,830,000.00	5,580,707.58
4 FINNISH GOVT 250704	240,000.00	241,841.88
4 ITALY GOVT 301115	3,840,000.00	3,933,920.64
4 ITALY GOVT 311030	1,650,000.00	1,692,454.50
4 ITALY GOVT 350430	2,150,000.00	2,168,052.47
4 ITALY GOVT 370201	5,850,000.00	5,857,839.00
4 NETH GOVT 370115	3,160,000.00	3,539,809.24
4 O.A.T 381025	4,510,000.00	4,834,390.77
4 O.A.T 550425	3,330,000.00	3,574,028.71
4 O.A.T 600425	3,670,000.00	3,980,555.40
4 SPAIN GOVT 541031	1,000,000.00	1,013,261.60
4.05 ITALY GOVT 371030	2,200,000.00	2,193,810.85
4.1 ITALY GOVT 290201	3,530,000.00	3,634,796.87
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	2,540,000.00	2,811,470.62
4.15 ITALY GOVT 391001	1,830,000.00	1,818,379.50
4.2 ITALY GOVT 340301	3,430,000.00	3,526,424.16
4.2 SPAIN GOVT 370131	4,260,000.00	4,588,778.28
4.25 BEL GOVT 410328	2,940,000.00	3,271,315.65
4.25 BUND 390704	3,810,000.00	4,580,822.43
4.35 ITALY GOVT 331101	3,710,000.00	3,863,983.55
4.4 ITALY GOVT 330501	3,800,000.00	3,982,590.00
4.45 ITALY GOVT 430901	1,940,000.00	1,970,467.70
4.5 BEL GOVT 260328	1,610,000.00	1,648,996.61
4.5 ITALY GOVT 260301	3,740,000.00	3,808,367.20
4.5 ITALY GOVT 531001	2,470,000.00	2,502,357.00
4.5 O.A.T 410425	7,070,000.00	8,018,581.90
4.65 SPAIN GOVT 250730	2,890,000.00	2,930,221.57
4.7 SPAIN GOVT 410730	3,450,000.00	3,905,923.71
4.75 BUND 280704	2,340,000.00	2,543,818.68
4.75 BUND 340704	4,890,000.00	5,888,255.35
4.75 BUND 400704	3,610,000.00	4,611,061.65

	4.75 ITALY GOVT 280901	3,930,000.00	4,141,764.90	
	4.75 ITALY GOVT 440901	3,480,000.00	3,687,223.56	
	4.75 O.A.T 350425	5,130,000.00	5,847,148.35	
	4.85 AUSTRIA GOVT 260315	1,370,000.00	1,409,696.43	
	4.9 SPAIN GOVT 400730	4,370,000.00	5,032,273.50	
	5 BEL GOVT 350328	3,280,000.00	3,842,073.92	
	5 ITALY GOVT 340801	4,650,000.00	5,087,342.73	
	5 ITALY GOVT 390801	5,170,000.00	5,626,842.90	
	5 ITALY GOVT 400901	3,950,000.00	4,295,723.75	
	5.15 SPAIN GOVT 281031	3,250,000.00	3,539,746.27	
	5.15 SPAIN GOVT 441031	2,640,000.00	3,167,162.32	
	5.25 ITALY GOVT 291101	4,660,000.00	5,077,279.70	
	5.5 BEL GOVT 280328	4,910,000.00	5,375,922.17	
	5.5 BUND 310104	3,650,000.00	4,319,975.75	
	5.5 NETH GOVT 280115	2,180,000.00	2,388,019.52	
	5.5 O.A.T 290425	6,800,000.00	7,560,104.00	
	5.625 BUND 280104	3,460,000.00	3,820,483.56	
	5.75 ITALY GOVT 330201	4,920,000.00	5,630,635.45	
	5.75 O.A.T 321025	6,200,000.00	7,403,386.51	
	5.75 SPAIN GOVT 320730	4,990,000.00	5,924,628.99	
	5.9 SPAIN GOVT 260730	4,650,000.00	4,910,083.80	
	6 ITALY GOVT 310501	5,600,000.00	6,432,405.84	
	6 O.A.T 251025	760,000.00	786,496.64	
	6 SPAIN GOVT 290131	4,230,000.00	4,783,635.93	
	6.25 AUSTRIA GOVT 270715	1,630,000.00	1,786,007.30	
	6.25 BUND 300104	1,700,000.00	2,033,477.95	
	6.5 BUND 270704	2,680,000.00	2,981,404.31	
	6.5 ITALY GOVT 271101	4,970,000.00	5,472,665.80	
	7.25 ITALY GOVT 261101	2,300,000.00	2,503,469.50	
ユーロ合計		1,283,250,000.00	1,188,975,195.94 (203,659,561,312)	
合計			654,894,548,669 (654,894,548,669)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 271銘柄	100.00%	47.00%
カナダドル	国債証券 38銘柄	100.00%	2.00%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	100.00%	1.29%
イギリスポンド	国債証券 61銘柄	100.00%	5.29%

シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.00%	0.42%
マレーシアリンギット	国債証券	29銘柄	100.00%	0.49%
ニュージーランドドル	国債証券	13銘柄	100.00%	0.24%
スウェーデンクローネ	国債証券	7銘柄	100.00%	0.16%
ノルウェークローネ	国債証券	10銘柄	100.00%	0.15%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	100.00%	0.25%
メキシコペソ	国債証券	15銘柄	100.00%	0.79%
イスラエルシェケル	国債証券	12銘柄	100.00%	0.31%
ポーランドズロチ	国債証券	12銘柄	100.00%	0.53%
中国元	国債証券	78銘柄	100.00%	9.98%
ユーロ	国債証券	381銘柄	100.00%	31.10%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[2024年 6月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	1,841,194,905
コール・ローン	2,743,610,324
国債証券	366,128,578,086
派生商品評価勘定	88,625,971
未収入金	6,401,570
未収利息	2,674,571,607
前払費用	299,169,577
流動資産合計	373,782,152,040
資産合計	373,782,152,040
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,318,393,268
未払金	1,227,916,081
未払解約金	60,754,598
流動負債合計	7,607,063,947
負債合計	7,607,063,947
純資産の部	
元本等	
元本	330,814,836,535
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	35,360,251,558
元本等合計	366,175,088,093
純資産合計	366,175,088,093
負債純資産合計	373,782,152,040

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
--------------------	---

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 6月25日現在]
1. 期首	2023年 6月27日
期首元本額	284,113,964,774円
期中追加設定元本額	91,795,091,197円
期中一部解約元本額	45,094,219,436円
元本の内訳	
e M A X I S 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	988,017,901円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	19,996,312,959円
ラップ向けインデックスf 先進国債券（為替ヘッジあり）	6,310,132,417円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	559,578,439円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	95,700,637円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	162,264,763円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	3,818,334,657円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	2,945,733,296円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	279,345,777円
三菱ＵＦＪ D C バランス・イノベーション（K A K U S H I N）	5,476,400,401円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	1,889,160,938円
e M A X I S 債券バランス（2資産均等型）	87,631,604円
M U A M ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）	145,174,659,279円
三菱ＵＦＪ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	9,574,171,510円
M U K A M バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	12,205,326,187円
M U K A M バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	3,663,537,090円
M U K A M スマート・クオリティ・セクション（適格機関投資家転売制限付）	372,777,842円
M U K A M 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	11,833,823,581円
M U K A M バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	1,029,489,382円
M U K A M ヘッジ付外国債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	11,696,875,228円
M U K A M ヘッジ付外国債券インデックスオープン（適格機関投資家限定）	6,866,966,739円
M U K A M スマート・クオリティ・セクション2（適格機関投資家限定）	205,557,653円
M U K A M 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	68,375,243,902円
M U K A M 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）	112,178,753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）	824,280円
M U K A M バランスファンド2019-12（適格機関投資家限定）	2,514,474,113円
M U K A M 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）	275,037,850円
M U K A M バランスファンド2020-07（適格機関投資家限定）	2,497,022,952円
M U K A M 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）	271,318,100円
M U K A M バランスファンド2020-10（適格機関投資家限定）	2,484,873,283円
M U K A M 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）	271,402,571円
M U K A M 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）	269,785,676円
M U K A M バランスファンド2021-03（適格機関投資家限定）	2,199,002,103円

	[2024年 6月25日現在]
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03（適格機関投資家限定）	271,281,132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）	272,241,941円
MUKAM バランスファンド2021-06（適格機関投資家限定）	2,233,271,601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）	267,526,989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）	266,387,851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）	270,807,832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）	277,720,836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）	291,655,171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）	301,089,600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）	309,002,920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）	310,226,910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）	310,178,316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）	310,160,990円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03（適格機関投資家限定）	310,160,883円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05（適格機関投資家限定）	310,161,700円
合計	330,814,836,535円
2. 受益権の総数	330,814,836,535口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023年 6月27日 至 2024年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク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	[2024年 6月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品

区分	[2024年 6月25日現在]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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	[2024年 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	774,627,311
合計	774,627,311

（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

[2024年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカドル	168,062,139,688	—	171,720,891,709	3,658,752,021
	カナダドル	7,404,850,948	—	7,578,454,289	173,603,341
	オーストラリアドル	4,630,262,910	—	4,740,913,290	110,650,380
	イギリスポンド	18,824,427,325	—	19,163,314,800	338,887,475
	シンガポールドル	1,537,917,471	—	1,566,572,040	28,654,569
	マレーシアリングット	1,845,354,522	—	1,881,571,407	36,216,885
	ニュージーランドドル	805,817,440	—	823,153,200	17,335,760
	スウェーデンクローネ	599,566,248	—	618,714,324	19,148,076
	ノルウェークローネ	599,005,166	—	612,268,140	13,262,974
	デンマーククローネ	952,795,200	—	963,648,000	10,852,800
	メキシコペソ	3,216,632,536	—	3,128,006,565	88,625,971
	イスラエルシェケル	1,034,144,200	—	1,049,402,025	15,257,825
	ポーランドズロチ	1,941,085,116	—	1,961,780,688	20,695,572
	中国元	36,172,827,397	—	36,753,166,587	580,339,190
	ユーロ	111,743,695,950	—	113,038,432,350	1,294,736,400
合計		359,370,522,117	—	365,600,289,414	6,229,767,297

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[2024年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	1.1069円
(1万口当たり純資産額)	(11,069円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨	種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
アメリカ ドル	国債証券	0.25 T-NOTE 250630	4,000,000.00	3,811,125.76	
		0.25 T-NOTE 250731	5,000,000.00	4,747,558.60	
		0.25 T-NOTE 250831	4,290,000.00	4,057,569.12	
		0.25 T-NOTE 250930	5,050,000.00	4,760,118.18	
		0.25 T-NOTE 251031	4,000,000.00	3,758,750.00	
		0.375 T-NOTE 251130	4,000,000.00	3,751,718.76	
		0.375 T-NOTE 251231	6,000,000.00	5,609,648.46	
		0.375 T-NOTE 260131	6,600,000.00	6,149,859.40	
		0.375 T-NOTE 270731	4,000,000.00	3,532,656.24	
		0.375 T-NOTE 270930	4,200,000.00	3,688,453.10	
		0.5 T-NOTE 260228	4,700,000.00	4,376,415.99	
		0.5 T-NOTE 270430	1,700,000.00	1,520,902.34	
		0.5 T-NOTE 270531	4,000,000.00	3,567,656.24	
		0.5 T-NOTE 270630	3,500,000.00	3,113,564.44	
		0.5 T-NOTE 270831	3,850,000.00	3,403,941.38	
		0.5 T-NOTE 271031	5,200,000.00	4,571,531.22	
		0.625 T-NOTE 260731	4,680,000.00	4,306,148.44	
		0.625 T-NOTE 270331	1,500,000.00	1,350,585.93	
		0.625 T-NOTE 271130	4,500,000.00	3,963,427.74	
		0.625 T-NOTE 271231	5,480,000.00	4,812,767.20	
		0.625 T-NOTE 300515	8,200,000.00	6,661,859.41	
		0.625 T-NOTE 300815	10,200,000.00	8,219,367.16	
		0.75 T-NOTE 260331	4,300,000.00	4,010,001.93	
		0.75 T-NOTE 260430	6,500,000.00	6,045,253.89	
		0.75 T-NOTE 260531	6,000,000.00	5,564,179.68	
		0.75 T-NOTE 260831	6,000,000.00	5,520,000.00	

0.75 T-NOTE 280131	4,200,000.00	3,696,000.00	
0.875 T-NOTE 260630	5,000,000.00	4,638,378.90	
0.875 T-NOTE 260930	5,500,000.00	5,064,511.70	
0.875 T-NOTE 301115	12,020,000.00	9,780,335.99	
1 T-NOTE 280731	7,780,000.00	6,812,818.32	
1.125 T-BOND 400515	4,520,000.00	2,846,099.22	
1.125 T-BOND 400815	4,600,000.00	2,868,531.24	
1.125 T-NOTE 261031	5,100,000.00	4,709,630.85	
1.125 T-NOTE 270228	1,900,000.00	1,738,796.87	
1.125 T-NOTE 280229	6,400,000.00	5,697,500.03	
1.125 T-NOTE 280831	5,850,000.00	5,138,516.62	
1.125 T-NOTE 310215	10,300,000.00	8,478,388.65	
1.25 T-BOND 500515	6,450,000.00	3,305,121.12	
1.25 T-NOTE 261130	5,700,000.00	5,268,714.85	
1.25 T-NOTE 261231	6,150,000.00	5,674,576.15	
1.25 T-NOTE 280331	5,590,000.00	4,989,293.34	
1.25 T-NOTE 280430	6,000,000.00	5,343,515.64	
1.25 T-NOTE 280531	5,750,000.00	5,110,649.39	
1.25 T-NOTE 280630	6,900,000.00	6,119,437.50	
1.25 T-NOTE 280930	7,300,000.00	6,432,697.29	
1.25 T-NOTE 310815	11,260,000.00	9,200,871.52	
1.375 T-BOND 401115	5,200,000.00	3,358,976.55	
1.375 T-BOND 500815	6,920,000.00	3,658,679.70	
1.375 T-NOTE 260831	2,200,000.00	2,051,757.81	
1.375 T-NOTE 281031	5,340,000.00	4,722,875.37	
1.375 T-NOTE 281231	6,000,000.00	5,285,507.82	
1.375 T-NOTE 311115	11,270,000.00	9,232,595.31	
1.5 T-NOTE 260815	5,000,000.00	4,680,664.05	
1.5 T-NOTE 270131	7,200,000.00	6,669,703.15	
1.5 T-NOTE 281130	4,900,000.00	4,349,611.32	
1.5 T-NOTE 300215	3,880,000.00	3,347,560.93	
1.625 T-BOND 501115	7,060,000.00	3,989,727.36	
1.625 T-NOTE 260215	4,920,000.00	4,673,423.42	
1.625 T-NOTE 260515	5,600,000.00	5,287,625.00	
1.625 T-NOTE 260930	1,950,000.00	1,826,753.91	
1.625 T-NOTE 261031	1,600,000.00	1,495,124.99	
1.625 T-NOTE 261130	2,200,000.00	2,052,187.50	
1.625 T-NOTE 290815	4,900,000.00	4,311,425.76	
1.625 T-NOTE 310515	10,680,000.00	9,025,225.74	
1.75 T-BOND 410815	7,840,000.00	5,306,087.53	
1.75 T-NOTE 261231	3,750,000.00	3,503,466.78	
1.75 T-NOTE 290131	5,100,000.00	4,561,810.56	

1.75 T-NOTE 291115	4,000,000.00	3,527,968.76
1.875 T-BOND 410215	6,650,000.00	4,655,519.49
1.875 T-BOND 510215	7,300,000.00	4,395,968.75
1.875 T-BOND 511115	6,540,000.00	3,917,357.84
1.875 T-NOTE 260630	2,700,000.00	2,555,191.41
1.875 T-NOTE 260731	2,700,000.00	2,550,339.83
1.875 T-NOTE 270228	5,300,000.00	4,949,392.59
1.875 T-NOTE 290228	5,500,000.00	4,940,332.04
1.875 T-NOTE 320215	10,360,000.00	8,768,971.06
2 T-BOND 411115	6,230,000.00	4,379,860.32
2 T-BOND 500215	5,300,000.00	3,315,916.00
2 T-BOND 510815	8,000,000.00	4,954,062.46
2 T-NOTE 250815	5,150,000.00	4,979,607.40
2 T-NOTE 261115	5,000,000.00	4,709,179.70
2.125 T-NOTE 260531	1,400,000.00	1,333,390.63
2.25 T-BOND 410515	5,370,000.00	3,973,065.81
2.25 T-BOND 460815	3,390,000.00	2,319,766.42
2.25 T-BOND 490815	2,840,000.00	1,890,097.64
2.25 T-BOND 520215	6,290,000.00	4,128,795.31
2.25 T-NOTE 251115	6,400,000.00	6,172,499.96
2.25 T-NOTE 260331	3,250,000.00	3,111,875.00
2.25 T-NOTE 270215	4,200,000.00	3,964,242.19
2.25 T-NOTE 270815	4,800,000.00	4,492,125.02
2.25 T-NOTE 271115	4,200,000.00	3,915,187.50
2.375 T-BOND 420215	5,000,000.00	3,722,656.25
2.375 T-BOND 491115	4,130,000.00	2,823,080.86
2.375 T-BOND 510515	6,100,000.00	4,137,515.62
2.375 T-NOTE 260430	2,100,000.00	2,012,226.55
2.375 T-NOTE 270515	5,800,000.00	5,469,898.45
2.375 T-NOTE 290331	4,650,000.00	4,268,463.87
2.375 T-NOTE 290515	3,940,000.00	3,610,486.72
2.5 T-BOND 450215	3,380,000.00	2,467,994.13
2.5 T-BOND 460215	2,760,000.00	1,993,776.55
2.5 T-BOND 460515	2,570,000.00	1,851,805.48
2.5 T-NOTE 260228	3,000,000.00	2,888,320.32
2.5 T-NOTE 270331	4,500,000.00	4,270,341.78
2.625 T-NOTE 251231	2,700,000.00	2,612,144.53
2.625 T-NOTE 260131	1,600,000.00	1,545,562.49
2.625 T-NOTE 270531	4,900,000.00	4,652,320.28
2.625 T-NOTE 290215	6,190,000.00	5,756,579.10
2.625 T-NOTE 290731	3,780,000.00	3,495,909.37
2.75 T-BOND 420815	1,430,000.00	1,123,918.55
2.75 T-BOND 421115	2,200,000.00	1,723,304.68

2.75 T-BOND 470815	3,040,000.00	2,272,518.74	
2.75 T-BOND 471115	3,400,000.00	2,537,449.20	
2.75 T-NOTE 250831	3,000,000.00	2,922,070.32	
2.75 T-NOTE 270430	5,440,000.00	5,189,462.48	
2.75 T-NOTE 270731	4,510,000.00	4,289,256.64	
2.75 T-NOTE 280215	6,650,000.00	6,284,250.00	
2.75 T-NOTE 290531	5,000,000.00	4,660,839.85	
2.75 T-NOTE 320815	9,410,000.00	8,447,864.29	
2.875 T-BOND 430515	2,750,000.00	2,182,919.91	
2.875 T-BOND 450815	2,000,000.00	1,553,984.38	
2.875 T-BOND 461115	1,920,000.00	1,478,100.00	
2.875 T-BOND 490515	4,600,000.00	3,491,328.14	
2.875 T-BOND 520515	6,140,000.00	4,633,061.70	
2.875 T-NOTE 250615	4,100,000.00	4,013,624.60	
2.875 T-NOTE 250731	3,500,000.00	3,419,882.83	
2.875 T-NOTE 251130	4,500,000.00	4,374,667.98	
2.875 T-NOTE 280515	6,600,000.00	6,249,632.79	
2.875 T-NOTE 280815	6,160,000.00	5,817,590.60	
2.875 T-NOTE 290430	4,500,000.00	4,223,320.29	
2.875 T-NOTE 320515	9,900,000.00	8,994,304.63	
3 T-BOND 420515	1,310,000.00	1,073,969.72	
3 T-BOND 441115	2,100,000.00	1,677,046.87	
3 T-BOND 450515	1,800,000.00	1,431,632.80	
3 T-BOND 451115	1,040,000.00	824,301.56	
3 T-BOND 470215	2,880,000.00	2,262,824.98	
3 T-BOND 470515	2,650,000.00	2,078,645.50	
3 T-BOND 480215	2,860,000.00	2,233,704.66	
3 T-BOND 480815	4,480,000.00	3,491,074.98	
3 T-BOND 490215	4,700,000.00	3,657,738.29	
3 T-BOND 520815	5,750,000.00	4,452,993.14	
3 T-NOTE 250715	4,100,000.00	4,013,934.03	
3 T-NOTE 250930	3,500,000.00	3,415,781.25	
3 T-NOTE 251031	3,000,000.00	2,925,000.00	
3.125 T-BOND 411115	1,550,000.00	1,304,633.79	
3.125 T-BOND 420215	1,340,000.00	1,124,291.40	
3.125 T-BOND 430215	1,850,000.00	1,530,766.60	
3.125 T-BOND 440815	2,390,000.00	1,952,798.04	
3.125 T-BOND 480515	3,810,000.00	3,041,079.47	
3.125 T-NOTE 270831	5,000,000.00	4,805,664.05	
3.125 T-NOTE 281115	5,270,000.00	5,018,954.48	
3.125 T-NOTE 290831	3,250,000.00	3,077,089.86	
3.25 T-BOND 420515	4,640,000.00	3,941,462.47	

3.25 T-NOTE 270630	4,500,000.00	4,348,916.01
3.25 T-NOTE 290630	4,100,000.00	3,909,894.52
3.375 T-BOND 420815	4,160,000.00	3,588,081.24
3.375 T-BOND 440515	1,850,000.00	1,574,162.11
3.375 T-BOND 481115	4,570,000.00	3,809,880.49
3.375 T-NOTE 330515	10,150,000.00	9,497,386.66
3.5 T-BOND 390215	700,000.00	641,457.03
3.5 T-NOTE 250915	950,000.00	933,078.12
3.5 T-NOTE 280131	5,400,000.00	5,241,269.53
3.5 T-NOTE 280430	3,900,000.00	3,781,781.25
3.5 T-NOTE 300131	3,500,000.00	3,367,109.37
3.5 T-NOTE 300430	3,900,000.00	3,746,894.54
3.5 T-NOTE 330215	9,990,000.00	9,450,305.83
3.625 T-BOND 430815	2,230,000.00	1,979,125.00
3.625 T-BOND 440215	2,400,000.00	2,123,859.38
3.625 T-BOND 530215	5,610,000.00	4,908,202.12
3.625 T-BOND 530515	6,000,000.00	5,251,406.28
3.625 T-NOTE 260515	4,300,000.00	4,214,503.91
3.625 T-NOTE 280331	4,880,000.00	4,754,664.07
3.625 T-NOTE 280531	4,860,000.00	4,733,564.08
3.625 T-NOTE 300331	3,590,000.00	3,473,605.45
3.75 T-BOND 410815	1,200,000.00	1,106,015.62
3.75 T-BOND 431115	2,210,000.00	1,994,870.31
3.75 T-NOTE 260415	3,900,000.00	3,831,597.66
3.75 T-NOTE 281231	6,610,000.00	6,461,016.78
3.75 T-NOTE 300531	3,750,000.00	3,649,511.70
3.75 T-NOTE 300630	4,050,000.00	3,940,207.00
3.75 T-NOTE 301231	3,920,000.00	3,808,678.11
3.875 T-BOND 400815	1,610,000.00	1,521,953.12
3.875 T-BOND 430215	3,760,000.00	3,467,351.54
3.875 T-BOND 430515	3,760,000.00	3,461,476.56
3.875 T-NOTE 260115	5,100,000.00	5,024,496.08
3.875 T-NOTE 271130	4,480,000.00	4,403,962.48
3.875 T-NOTE 271231	3,500,000.00	3,440,527.33
3.875 T-NOTE 290930	3,650,000.00	3,580,564.44
3.875 T-NOTE 291130	3,060,000.00	3,001,788.27
3.875 T-NOTE 291231	3,350,000.00	3,285,617.18
3.875 T-NOTE 330815	10,940,000.00	10,628,466.42
4 T-BOND 421115	2,540,000.00	2,387,401.57
4 T-BOND 521115	3,890,000.00	3,642,620.31
4 T-NOTE 251215	6,220,000.00	6,141,399.60
4 T-NOTE 260215	3,900,000.00	3,848,888.66
4 T-NOTE 270115	5,380,000.00	5,308,862.07

4 T-NOTE 280229	3,400,000.00	3,356,105.45	
4 T-NOTE 280630	4,000,000.00	3,949,531.24	
4 T-NOTE 290131	5,400,000.00	5,333,660.13	
4 T-NOTE 291031	3,840,000.00	3,789,674.99	
4 T-NOTE 300228	3,490,000.00	3,443,375.76	
4 T-NOTE 300731	3,500,000.00	3,450,986.31	
4 T-NOTE 310131	4,690,000.00	4,622,398.05	
4 T-NOTE 340215	8,800,000.00	8,630,187.42	
4.125 T-BOND 530815	6,200,000.00	5,936,863.25	
4.125 T-NOTE 260615	5,000,000.00	4,945,410.15	
4.125 T-NOTE 270215	6,080,000.00	6,018,962.50	
4.125 T-NOTE 270930	4,200,000.00	4,161,281.25	
4.125 T-NOTE 271031	3,920,000.00	3,883,785.94	
4.125 T-NOTE 280731	5,070,000.00	5,029,796.47	
4.125 T-NOTE 300831	2,860,000.00	2,838,438.28	
4.125 T-NOTE 310331	700,000.00	695,078.12	
4.125 T-NOTE 321115	10,070,000.00	9,986,411.14	
4.25 T-BOND 390515	1,000,000.00	994,843.75	
4.25 T-BOND 401115	1,410,000.00	1,391,961.91	
4.25 T-BOND 540215	5,140,000.00	5,032,381.24	
4.25 T-NOTE 251015	3,000,000.00	2,972,988.27	
4.25 T-NOTE 251231	5,470,000.00	5,419,359.77	
4.25 T-NOTE 260131	3,570,000.00	3,537,089.06	
4.25 T-NOTE 270315	5,500,000.00	5,463,476.59	
4.25 T-NOTE 290228	6,340,000.00	6,332,322.61	
4.25 T-NOTE 310228	4,170,000.00	4,170,325.75	
4.375 T-BOND 380215	790,000.00	801,217.38	
4.375 T-BOND 391115	1,280,000.00	1,289,350.00	
4.375 T-BOND 400515	1,050,000.00	1,055,578.12	
4.375 T-BOND 410515	1,780,000.00	1,780,034.76	
4.375 T-BOND 430815	4,410,000.00	4,341,955.06	
4.375 T-NOTE 260815	7,060,000.00	7,018,494.89	
4.375 T-NOTE 261215	5,500,000.00	5,475,078.12	
4.375 T-NOTE 280831	5,940,000.00	5,949,281.25	
4.375 T-NOTE 281130	5,900,000.00	5,917,169.94	
4.375 T-NOTE 301130	4,200,000.00	4,227,234.39	
4.375 T-NOTE 340515	2,250,000.00	2,273,730.47	
4.5 T-BOND 360215	900,000.00	928,582.02	
4.5 T-BOND 380515	660,000.00	677,299.22	
4.5 T-BOND 390815	1,400,000.00	1,430,789.06	
4.5 T-BOND 440215	2,170,000.00	2,172,034.37	
4.5 T-NOTE 251115	3,000,000.00	2,982,480.48	

		4.5 T-NOTE 260715	3,600,000.00	3,586,851.57	
		4.5 T-NOTE 270415	6,500,000.00	6,500,000.00	
		4.5 T-NOTE 270515	6,700,000.00	6,701,832.04	
		4.5 T-NOTE 331115	12,080,000.00	12,313,106.31	
		4.625 T-BOND 400215	1,330,000.00	1,376,705.86	
		4.625 T-BOND 540515	1,100,000.00	1,145,890.61	
		4.625 T-NOTE 250630	1,700,000.00	1,692,147.12	
		4.625 T-NOTE 260228	6,180,000.00	6,160,928.88	
		4.625 T-NOTE 260315	5,300,000.00	5,283,851.53	
		4.625 T-NOTE 260915	5,100,000.00	5,097,509.77	
		4.625 T-NOTE 261015	5,240,000.00	5,240,921.08	
		4.625 T-NOTE 261115	5,000,000.00	5,004,101.55	
		4.625 T-NOTE 280930	4,200,000.00	4,248,070.30	
		4.625 T-NOTE 290430	1,600,000.00	1,623,875.00	
		4.625 T-NOTE 300930	4,650,000.00	4,741,183.61	
		4.75 T-BOND 410215	1,260,000.00	1,318,570.31	
		4.75 T-BOND 431115	4,740,000.00	4,899,975.00	
		4.75 T-BOND 531115	6,920,000.00	7,354,662.50	
		4.75 T-NOTE 250731	4,500,000.00	4,486,201.15	
		4.875 T-NOTE 251130	6,000,000.00	5,996,484.36	
		4.875 T-NOTE 281031	5,500,000.00	5,620,097.67	
		4.875 T-NOTE 301031	3,350,000.00	3,463,585.93	
		5 T-BOND 370515	580,000.00	625,063.27	
		5 T-NOTE 250831	1,800,000.00	1,799,226.55	
		5 T-NOTE 250930	4,030,000.00	4,030,314.82	
		5 T-NOTE 251031	5,000,000.00	5,002,832.05	
		5.25 T-BOND 281115	1,000,000.00	1,038,496.09	
		5.375 T-BOND 310215	910,000.00	973,593.35	
		6 T-BOND 260215	1,100,000.00	1,123,761.71	
		6.125 T-BOND 271115	800,000.00	843,953.12	
		6.25 T-BOND 300515	660,000.00	727,701.55	
アメリカドル合計			1,201,080,000.00	1,082,873,691.77 (172,783,326,258)	
カナダドル	国債証券	0.25 CAN GOVT 260301	1,200,000.00	1,129,084.08	
		0.5 CAN GOVT 250901	2,500,000.00	2,396,191.52	
		0.5 CAN GOVT 301201	3,320,000.00	2,784,042.44	
		1 CAN GOVT 260901	1,300,000.00	1,225,265.11	
		1 CAN GOVT 270601	600,000.00	558,205.37	
		1.25 CAN GOVT 270301	2,770,000.00	2,603,741.44	
		1.25 CAN GOVT 300601	3,270,000.00	2,909,491.19	
		1.5 CAN GOVT 260601	1,150,000.00	1,100,987.81	
		1.5 CAN GOVT 310601	3,700,000.00	3,284,313.39	

		1.5 CAN GOVT 311201	3,070,000.00	2,702,209.85	
		1.75 CAN GOVT 531201	2,790,000.00	1,992,700.49	
		2 CAN GOVT 280601	1,000,000.00	950,297.00	
		2 CAN GOVT 320601	2,250,000.00	2,041,936.67	
		2 CAN GOVT 511201	3,760,000.00	2,889,733.59	
		2.25 CAN GOVT 250601	1,600,000.00	1,569,925.95	
		2.25 CAN GOVT 290601	700,000.00	668,086.59	
		2.25 CAN GOVT 291201	400,000.00	380,516.20	
		2.5 CAN GOVT 321201	2,000,000.00	1,878,413.16	
		2.75 CAN GOVT 270901	2,300,000.00	2,248,400.37	
		2.75 CAN GOVT 330601	2,130,000.00	2,034,139.94	
		2.75 CAN GOVT 481201	1,150,000.00	1,046,539.37	
		2.75 CAN GOVT 551201	1,620,000.00	1,459,176.39	
		2.75 CANADA GOVER 641201	750,000.00	673,535.45	
		3 CAN GOVT 251001	3,900,000.00	3,844,477.33	
		3 CAN GOVT 260401	1,500,000.00	1,476,655.48	
		3 CAN GOVT 340601	1,190,000.00	1,155,923.71	
		3.25 CAN GOVT 280901	1,700,000.00	1,690,023.66	
		3.25 CAN GOVT 331201	2,270,000.00	2,253,358.06	
		3.5 CAN GOVT 280301	1,390,000.00	1,392,371.80	
		3.5 CAN GOVT 340301	350,000.00	355,189.81	
		3.5 CAN GOVT 451201	1,030,000.00	1,059,182.53	
		4 CAN GOVT 260501	1,630,000.00	1,632,389.88	
		4 CAN GOVT 290301	2,370,000.00	2,434,610.53	
		4 CAN GOVT 410601	740,000.00	802,692.25	
		4.5 CAN GOVT 251101	2,280,000.00	2,290,352.36	
		4.5 CAN GOVT 260201	2,070,000.00	2,084,876.26	
		5 CAN GOVT 370601	700,000.00	819,625.63	
		5.75 CAN GOVT 290601	600,000.00	666,763.83	
		5.75 CAN GOVT 330601	910,000.00	1,077,968.34	
カナダドル合計			69,960,000.00	65,563,394.83	
				(7,660,427,051)	
オーストラリアドル	国債証券	0.25 AUST GOVT 251121	1,450,000.00	1,373,197.70	
		0.5 AUST GOVT 260921	2,020,000.00	1,871,277.31	
		1 AUST GOVT 301221	2,340,000.00	1,937,607.75	
		1 AUST GOVT 311121	3,000,000.00	2,409,739.47	
		1.25 AUST GOVT 320521	3,700,000.00	2,984,834.80	
		1.5 AUST GOVT 310621	1,250,000.00	1,055,867.02	
		1.75 AUST GOVT 321121	2,770,000.00	2,297,748.87	
		1.75 AUST GOVT 510621	1,960,000.00	1,095,584.84	
		2.25 AUST GOVT 280521	1,400,000.00	1,315,743.95	
		2.5 AUST GOVT 300521	2,300,000.00	2,119,896.06	

		2.75 AUST GOVT 271121	1,500,000.00	1,444,187.52	
		2.75 AUST GOVT 281121	640,000.00	609,777.03	
		2.75 AUST GOVT 291121	1,280,000.00	1,204,540.00	
		2.75 AUST GOVT 350621	1,600,000.00	1,390,080.03	
		2.75 AUST GOVT 410521	1,030,000.00	816,507.17	
		3 AUST GOVT 331121	2,450,000.00	2,223,071.71	
		3 AUST GOVT 470321	1,380,000.00	1,068,126.18	
		3.25 AUST GOVT 290421	2,870,000.00	2,782,752.68	
		3.25 AUST GOVT 390621	1,350,000.00	1,177,974.17	
		3.5 AUST GOVT 341221	1,780,000.00	1,669,743.89	
		3.75 AUST GOVT 340521	1,600,000.00	1,540,124.97	
		3.75 AUST GOVT 370421	1,480,000.00	1,398,378.87	
		4.25 AUST GOVT 260421	2,950,000.00	2,961,262.21	
		4.5 AUST GOVT 330421	2,240,000.00	2,291,871.68	
		4.75 AUST GOVT 270421	2,800,000.00	2,860,404.96	
		4.75 AUST GOVT 540621	790,000.00	809,636.55	
オーストラリアドル合計			49,930,000.00	44,709,937.39	
				(4,746,854,052)	
イギリス ポンド	国債証券	0.125 GILT 260130	1,900,000.00	1,782,276.00	
		0.125 GILT 280131	1,210,000.00	1,055,086.12	
		0.25 GILT 310731	2,610,000.00	2,021,719.05	
		0.375 GILT 261022	3,270,000.00	2,995,941.30	
		0.375 GILT 301022	2,240,000.00	1,803,469.02	
		0.5 GILT 290131	2,650,000.00	2,269,862.80	
		0.5 GILT 611022	2,200,000.00	668,565.32	
		0.625 GILT 250607	2,050,000.00	1,975,441.09	
		0.625 GILT 350731	2,230,000.00	1,538,222.78	
		0.625 GILT 501022	1,730,000.00	703,815.90	
		0.875 GILT 291022	1,630,000.00	1,397,256.53	
		0.875 GILT 330731	2,900,000.00	2,206,175.00	
		0.875 GILT 460131	1,010,000.00	505,606.00	
		1 GILT 320131	3,750,000.00	3,026,745.00	
		1.125 GILT 390131	1,810,000.00	1,183,087.85	
		1.125 GILT 731022	1,080,000.00	398,088.00	
		1.25 GILT 270722	1,700,000.00	1,564,323.00	
		1.25 GILT 411022	2,380,000.00	1,470,195.02	
		1.25 GILT 510731	2,620,000.00	1,287,206.00	
		1.5 GILT 260722	1,470,000.00	1,391,496.12	
		1.5 GILT 470722	1,860,000.00	1,055,178.00	
		1.5 GILT 530731	2,120,000.00	1,086,076.00	
		1.625 GILT 281022	1,500,000.00	1,364,850.00	
		1.625 GILT 541022	1,340,000.00	703,366.00	

		1.625 GILT 711022	1,630,000.00	755,016.00	
		1.75 GILT 370907	2,100,000.00	1,571,430.00	
		1.75 GILT 490122	1,120,000.00	659,792.00	
		1.75 GILT 570722	1,970,000.00	1,050,797.40	
		2 GILT 250907	1,200,000.00	1,163,820.00	
		2.5 GILT 650722	1,590,000.00	1,012,989.00	
		3.25 GILT 330131	3,620,000.00	3,418,688.89	
		3.25 GILT 440122	2,200,000.00	1,837,000.00	
		3.5 GILT 251022	1,660,000.00	1,634,718.20	
		3.5 GILT 450122	1,980,000.00	1,704,186.00	
		3.5 GILT 680722	1,710,000.00	1,405,962.00	
		3.75 GILT 270307	1,640,000.00	1,616,393.94	
		3.75 GILT 380129	2,460,000.00	2,319,460.43	
		3.75 GILT 520722	1,250,000.00	1,090,750.00	
		3.75 GILT 531022	2,850,000.00	2,472,660.00	
		4 GILT 311022	730,000.00	729,955.12	
		4 GILT 600122	1,170,000.00	1,065,870.00	
		4 GILT 631022	1,290,000.00	1,169,643.00	
		4.125 GILT 270129	3,480,000.00	3,464,210.54	
		4.25 GILT 271207	1,860,000.00	1,872,719.79	
		4.25 GILT 320607	2,210,000.00	2,255,857.50	
		4.25 GILT 360307	1,860,000.00	1,871,725.44	
		4.25 GILT 390907	1,320,000.00	1,299,804.00	
		4.25 GILT 401207	1,460,000.00	1,428,318.00	
		4.25 GILT 461207	1,810,000.00	1,731,084.00	
		4.25 GILT 491207	1,320,000.00	1,257,432.00	
		4.25 GILT 551207	1,790,000.00	1,698,889.00	
		4.375 GILT 540731	840,000.00	811,776.00	
		4.5 GILT 280607	3,560,000.00	3,612,698.32	
		4.5 GILT 340907	1,390,000.00	1,435,270.07	
		4.5 GILT 421207	2,080,000.00	2,080,832.00	
		4.625 GILT 340131	2,410,000.00	2,513,529.72	
		4.75 GILT 301207	2,070,000.00	2,167,527.84	
		4.75 GILT 381207	1,600,000.00	1,670,240.00	
		4.75 GILT 431022	1,470,000.00	1,511,160.00	
		6 GILT 281207	780,000.00	844,568.40	
イギリスポンド合計			114,740,000.00	95,660,822.50 (19,368,446,731)	
シンガ ポール ドル	国債証券	0.5 SINGAPORGGOVT 251101	1,820,000.00	1,748,292.00	
		1.25 SINGAPORGGOVT 261101	550,000.00	524,273.75	
		1.625 SINGAPORGGOV 310701	500,000.00	451,650.00	
		1.875 SINGAPORGGOV 500301	840,000.00	659,400.00	

		1.875 SINGAPORGOV 511001	760,000.00	588,878.40	
		2.125 SINGAPORGOV 260601	1,000,000.00	976,400.00	
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	530,000.00	482,565.00	
		2.375 SINGAPORGOV 250601	800,000.00	791,304.36	
		2.375 SINGAPORGOV 390701	390,000.00	353,072.85	
		2.625 SINGAPORGOV 280501	250,000.00	244,875.00	
		2.625 SINGAPORGOV 320801	900,000.00	865,260.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	700,000.00	663,600.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	660,000.00	621,713.40	
		2.875 SINGAPORGOV 270901	1,100,000.00	1,088,670.00	
		2.875 SINGAPORGOV 290701	750,000.00	740,025.00	
		2.875SINGAPORGOVT 300901	800,000.00	786,800.00	
		3 SINGAPORGOVT 720801	510,000.00	504,645.00	
		3.375 SINGAPORGOV 330901	600,000.00	610,500.00	
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	570,000.00	573,591.00	
シンガポールドル合計			14,030,000.00	13,275,515.76 (1,566,245,349)	
マレーシ アリン ギット	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	2,120,000.00	1,975,079.59	
		3.502MALAYSIAGOVT 270531	1,000,000.00	999,205.84	
		3.519 MALAYSIAGOV 280420	1,000,000.00	997,131.94	
		3.582 MALAYSIAGOV 320715	2,300,000.00	2,259,427.83	
		3.733 MALAYSIAGO 280615	2,300,000.00	2,310,916.49	
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	2,500,000.00	2,412,873.65	
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	2,000,000.00	1,996,300.06	
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	1,950,000.00	1,947,622.85	
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	2,500,000.00	2,528,394.25	
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	4,500,000.00	4,552,197.75	
		3.9 MALAYSIAGOVT 261130	2,730,000.00	2,759,932.53	
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	1,500,000.00	1,514,097.75	
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3,000,000.00	3,023,535.00	
		4.065 MALAYSIAGOV 500615	3,100,000.00	3,025,549.34	
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	1,200,000.00	1,233,350.52	
		4.457 MALAYSIAGOV 530331	1,180,000.00	1,224,257.55	
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	2,900,000.00	3,016,615.38	
		4.504 MALAYSIAGOV 290430	1,600,000.00	1,660,653.12	
		4.642 MALAYSIAGOV 331107	2,300,000.00	2,440,155.56	
		4.696 MALAYSIAGOV 421015	2,550,000.00	2,742,565.80	
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	1,200,000.00	1,293,698.40	
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4,100,000.00	4,416,845.13	
		4.893 MALAYSIAGOV 380608	1,700,000.00	1,861,913.10	
		4.921 MALAYSIAGOV 480706	1,640,000.00	1,816,365.43	
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	700,000.00	772,727.27	

マレーシアリングット合計			53,570,000.00	54,781,412.13 (1,855,638,163)	
ニュージーランドドル	国債証券	0.25 NZ GOVT 280515	1,400,000.00	1,190,940.45	
		1.5 NZ GOVT 310515	1,000,000.00	825,256.68	
		1.75 NZ GOVT 410515	600,000.00	384,854.31	
		2 NZ GOVT 320515	1,200,000.00	1,000,742.98	
		2.75 NZ GOVT 370415	1,100,000.00	890,028.23	
		2.75 NZ GOVT 510515	700,000.00	475,612.99	
		3 NZ GOVT 290420	800,000.00	750,832.86	
		3.5 NZ GOVT 330414	1,350,000.00	1,248,310.07	
		4.5 NZ GOVT 270415	800,000.00	798,337.53	
		4.5 NZ GOVT 300515	600,000.00	601,897.80	
		5 NZ GOVT 540515	320,000.00	322,915.84	
ニュージーランドドル合計			9,870,000.00	8,489,729.74 (829,022,109)	
スウェーデンクローネ	国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	8,560,000.00	7,447,331.82	
		0.75 SWD GOVT 280512	4,000,000.00	3,779,229.80	
		0.75 SWD GOVT 291112	12,700,000.00	11,870,889.13	
		1 SWD GOVT 261112	6,150,000.00	5,947,467.70	
		1.75 SWD GOVT 331111	2,000,000.00	1,925,319.58	
		2.25 SWD GOVT 320601	5,500,000.00	5,517,142.95	
		3.5 SWD GOVT 390330	4,050,000.00	4,640,530.50	
スウェーデンクローネ合計			42,960,000.00	41,127,911.48 (625,966,812)	
ノルウェークローネ	国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	3,800,000.00	3,240,399.65	
		1.375 NORWE GOVT 300819	5,400,000.00	4,745,230.39	
		1.5 NORWE GOVT 260219	2,850,000.00	2,738,231.83	
		1.75 NORWE GOVT 270217	4,250,000.00	4,042,175.00	
		1.75 NORWE GOVT 290906	3,500,000.00	3,198,994.05	
		2 NORWE GOVT 280426	7,650,000.00	7,215,388.20	
		2.125 NORWE GOVT 320518	6,800,000.00	6,125,049.00	
		3 NORWE GOVT 330815	4,000,000.00	3,820,674.68	
		3.5 NORWE GOVT 421006	2,130,000.00	2,141,555.25	
		3.625 NORWE GOVT 340413	3,020,000.00	3,035,162.81	
ノルウェークローネ合計			43,400,000.00	40,302,860.86 (609,782,284)	
デンマーククローネ	国債証券	0 DMK GOVT 311115	8,400,000.00	7,090,915.35	
		0.25 DMK GOVT 521115	6,400,000.00	3,432,944.00	
		0.5 DMK GOVT 271115	6,900,000.00	6,461,035.80	
		0.5 DMK GOVT 291115	3,800,000.00	3,446,774.30	
		1.75 DMK GOVT 251115	5,500,000.00	5,416,343.62	
		2.25 DMK GOVT 331115	3,760,000.00	3,700,415.24	

		4.5 DMK GOVT 391115	10,260,000.00	12,654,179.20	
デンマーククローネ合計			45,020,000.00	42,202,607.51 (968,971,868)	
メキシコ ペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 361120	8,000,000.00	8,022,080.00	
		5.5 MEXICAN BONOS 270304	42,380,000.00	37,676,667.60	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	61,350,000.00	56,696,341.14	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	39,750,000.00	36,891,975.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 330526	17,000,000.00	14,534,830.00	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	52,000,000.00	46,133,880.00	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	10,800,000.00	9,269,208.00	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	32,670,000.00	26,272,233.90	
		8 MEXICAN BONOS 350524	4,000,000.00	3,487,200.00	
		8 MEXICAN BONOS 471107	26,780,000.00	21,811,774.40	
		8 MEXICAN BONOS 530731	21,880,000.00	17,594,364.40	
		8.5 MEXICAN BONOS 290301	15,710,000.00	14,718,856.10	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	34,900,000.00	32,753,999.00	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	20,410,000.00	18,020,397.20	
メキシコペソ合計			387,630,000.00	343,883,806.74 (3,058,502,577)	
イスラエル シェケル	国債証券	0.5 ISRAEL FIXED 260227	1,800,000.00	1,693,710.00	
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	3,800,000.00	3,123,980.00	
		1.3 ISRAEL FIXED 320430	2,970,000.00	2,315,412.00	
		1.5 ISRAEL FIXED 370531	3,800,000.00	2,548,850.00	
		1.75 ISRAEL FIXED 250831	1,800,000.00	1,775,610.00	
		2 ISRAEL FIXED BO 270331	2,500,000.00	2,358,250.00	
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	2,000,000.00	1,860,300.00	
		2.8 ISRAEL FIXED 521129	800,000.00	513,640.00	
		3.75 ISRAEL FIXED 290228	3,000,000.00	2,938,050.00	
		3.75 ISRAEL FIXED 470331	2,570,000.00	2,070,777.50	
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	2,410,000.00	2,556,769.00	
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	700,000.00	757,610.00	
イスラエルシェケル合計			28,150,000.00	24,512,958.50 (1,048,953,617)	
ポーランド ズロチ	国債証券	0.25 POLAND 261025	4,000,000.00	3,578,210.00	
		1.25 POLAND 301025	4,400,000.00	3,410,660.00	
		1.75 POLAND 320425	4,000,000.00	3,036,811.00	
		2.5 POLAND 260725	5,800,000.00	5,507,192.80	
		2.5 POLAND 270725	2,300,000.00	2,121,684.45	
		2.75 POLAND 280425	3,700,000.00	3,374,055.90	
		2.75 POLAND 291025	6,700,000.00	5,867,831.52	
		3.25 POLAND 250725	3,550,000.00	3,487,913.16	
		3.75 POLAND 270525	4,000,000.00	3,840,408.00	

		5.75 POLAND 290425	4,960,000.00	5,013,029.84	
		6 POLAND 331025	4,200,000.00	4,298,359.80	
		7.5 POLAND 280725	4,200,000.00	4,514,868.54	
ポーランドズロチ合計			51,810,000.00	48,051,025.01 (1,917,221,482)	
中国元	国債証券	1.85 CHINA GOVT 270515	10,000,000.00	9,996,400.00	
		1.99 CHINA GOVT 260315	8,000,000.00	8,037,840.00	
		2 CHINA GOVT 250615	20,000,000.00	20,068,300.00	
		2.04 CHINA GOVT 270225	29,000,000.00	29,143,332.50	
		2.05 CHINA GOVT 290415	18,000,000.00	18,027,000.00	
		2.18 CHINA GOVT 250825	16,000,000.00	16,095,529.60	
		2.18 CHINA GOVT 260815	37,000,000.00	37,305,183.40	
		2.22 CHINA GOVT 250925	39,000,000.00	39,274,365.00	
		2.28 CHINA GOVT 251125	26,000,000.00	26,213,865.60	
		2.28 CHINA GOVT 310325	27,000,000.00	27,210,330.00	
		2.3 CHINA GOVT 260515	22,000,000.00	22,231,486.20	
		2.33 CHINA GOVT 251215	26,000,000.00	26,248,216.80	
		2.35 CHINA GOVT 340225	31,000,000.00	31,245,799.00	
		2.37 CHINA GOVT 270120	21,000,000.00	21,271,958.40	
		2.37 CHINA GOVT 290115	33,000,000.00	33,520,852.20	
		2.39 CHINA GOVT 261115	30,000,000.00	30,391,647.00	
		2.4 CHINA GOVT 280715	25,000,000.00	25,382,147.50	
		2.44 CHINA GOVT 271015	24,000,000.00	24,384,357.60	
		2.46 CHINA GOVT 260215	32,000,000.00	32,372,563.20	
		2.48 CHINA GOVT 270415	29,000,000.00	29,490,816.30	
		2.48 CHINA GOVT 280925	18,000,000.00	18,341,908.20	
		2.49 CHINA GOVT 440525	3,000,000.00	3,053,160.00	
		2.5 CHINA GOVT 270725	23,000,000.00	23,413,972.40	
		2.52 CHINA GOVT 330825	28,000,000.00	28,581,772.80	
		2.54 CHINA GOVT 301225	32,000,000.00	32,772,899.20	
		2.55 CHINA GOVT 281015	31,000,000.00	31,689,068.00	
		2.6 CHINA GOVT 300915	26,000,000.00	26,698,388.60	
		2.6 CHINA GOVT 320901	18,000,000.00	18,491,122.80	
		2.62 CHINA GOVT 280415	25,000,000.00	25,577,922.50	
		2.62 CHINA GOVT 290925	18,000,000.00	18,491,020.20	
		2.62 CHINA GOVT 300625	26,000,000.00	26,716,406.60	
		2.64 CHINA GOVT 280115	18,000,000.00	18,418,741.20	
		2.67 CHINA GOVT 330525	24,000,000.00	24,744,842.40	
		2.67 CHINA GOVT 331125	31,000,000.00	32,051,628.50	
		2.68 CHINA GOVT 300521	32,000,000.00	32,993,430.40	
		2.69 CHINA GOVT 260812	21,000,000.00	21,400,669.50	
		2.69 CHINA GOVT 320815	18,000,000.00	18,608,068.80	

2.74 CHINA GOVT 260804	12,000,000.00	12,248,202.00	
2.75 CHINA GOVT 290615	18,000,000.00	18,605,257.20	
2.75 CHINA GOVT 320217	19,000,000.00	19,735,984.00	
2.76 CHINA GOVT 320515	17,000,000.00	17,659,458.90	
2.79 CHINA GOVT 291215	23,000,000.00	23,819,299.10	
2.8 CHINA GOVT 290324	16,000,000.00	16,555,888.00	
2.8 CHINA GOVT 300325	23,000,000.00	23,845,169.50	
2.8 CHINA GOVT 321115	23,000,000.00	23,979,015.70	
2.85 CHINA GOVT 270604	25,000,000.00	25,713,685.00	
2.88 CHINA GOVT 330225	22,000,000.00	23,102,085.60	
2.89 CHINA GOVT 311118	14,000,000.00	14,692,224.40	
2.9 CHINA GOVT 260505	11,000,000.00	11,243,828.20	
2.91 CHINA GOVT 281014	20,000,000.00	20,754,858.00	
2.99 CHINA GOVT 251015	3,000,000.00	3,053,687.40	
3 CHINA GOVT 531015	13,000,000.00	14,475,905.60	
3.01 CHINA GOVT 280513	21,000,000.00	21,860,519.10	
3.02 CHINA GOVT 251022	22,000,000.00	22,406,989.00	
3.02 CHINA GOVT 310527	23,000,000.00	24,305,277.60	
3.03 CHINA GOVT 260311	19,000,000.00	19,440,418.10	
3.12 CHINA GOVT 261205	18,000,000.00	18,607,825.80	
3.12 CHINA GOVT 521025	11,000,000.00	12,389,103.10	
3.13 CHINA GOVT 291121	19,000,000.00	20,073,239.70	
3.19 CHINA GOVT 530415	13,000,000.00	14,847,368.90	
3.22 CHINA GOVT 251206	13,000,000.00	13,308,280.70	
3.25 CHINA GOVT 260606	21,000,000.00	21,646,999.50	
3.25 CHINA GOVT 281122	12,000,000.00	12,679,945.20	
3.27 CHINA GOVT 301119	25,000,000.00	26,844,890.00	
3.28 CHINA GOVT 271203	26,000,000.00	27,290,068.00	
3.29 CHINA GOVT 290523	23,000,000.00	24,473,766.40	
3.32 CHINA GOVT 520415	13,000,000.00	15,137,599.10	
3.39 CHINA GOVT 500316	22,000,000.00	25,714,348.00	
3.52 CHINA GOVT 270504	8,000,000.00	8,424,525.60	
3.53 CHINA GOVT 511018	12,000,000.00	14,446,254.00	
3.54 CHINA GOVT 280816	7,000,000.00	7,494,361.00	
3.59 CHINA GOVT 270803	7,000,000.00	7,417,640.30	
3.6 CHINA GOVT 250906	9,000,000.00	9,239,926.50	
3.61 CHINA GOVT 250607	7,000,000.00	7,154,654.50	
3.69 CHINA GOVT 280517	10,000,000.00	10,742,312.00	
3.72 CHINA GOVT 510412	15,000,000.00	18,568,366.50	
3.81 CHINA GOVT 500914	23,000,000.00	28,781,070.70	
3.86 CHINA GOVT 490722	19,000,000.00	23,844,401.50	
4.08 CHINA GOVT 481022	17,000,000.00	21,926,719.00	

中国元合計			1,589,000,000.00	1,658,508,430.80 (36,444,064,258)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 281020	1,230,000.00	1,090,418.37	
		0 AUSTRIA GOVT 300220	1,250,000.00	1,066,780.00	
		0 AUSTRIA GOVT 310220	1,510,000.00	1,249,777.17	
		0 AUSTRIA GOVT 401020	780,000.00	467,268.74	
		0 BEL GOVT 271022	800,000.00	729,384.00	
		0 BEL GOVT 311022	1,350,000.00	1,096,657.31	
		0 BUND 260815	3,700,000.00	3,496,031.95	
		0 BUND 271115	2,150,000.00	1,977,336.18	
		0 BUND 281115	2,880,000.00	2,595,121.20	
		0 BUND 290815	3,200,000.00	2,837,691.20	
		0 BUND 300215	2,620,000.00	2,297,737.38	
		0 BUND 300815	3,250,000.00	2,822,007.99	
		0 BUND 300815	1,200,000.00	1,042,662.30	
		0 BUND 310215	2,810,000.00	2,412,921.71	
		0 BUND 310815	2,820,000.00	2,394,347.30	
		0 BUND 310815	850,000.00	722,053.32	
		0 BUND 320215	3,200,000.00	2,682,571.99	
		0 BUND 350515	2,310,000.00	1,770,532.99	
		0 BUND 360515	2,560,000.00	1,906,874.88	
		0 BUND 500815	3,960,000.00	2,036,965.26	
		0 BUND 500815	1,020,000.00	526,874.35	
		0 BUND 520815	2,850,000.00	1,399,100.92	
		0 FINNISH GOVT 260915	420,000.00	393,671.77	
		0 FINNISH GOVT 300915	400,000.00	336,161.00	
		0 IRISH GOVT 311018	750,000.00	615,363.00	
		0 ITALY GOVT 260401	3,200,000.00	3,018,062.40	
		0 ITALY GOVT 260801	1,800,000.00	1,680,148.98	
		0 NETH GOVT 260115	1,010,000.00	965,465.56	
		0 NETH GOVT 270115	1,450,000.00	1,353,228.62	
		0 NETH GOVT 290115	1,880,000.00	1,670,455.20	
		0 NETH GOVT 300715	1,500,000.00	1,282,469.25	
		0 NETH GOVT 310715	1,550,000.00	1,290,464.23	
		0 NETH GOVT 380115	1,200,000.00	815,935.96	
		0 NETH GOVT 520115	1,850,000.00	875,157.41	
		0 O.A.T 260225	4,200,000.00	3,988,591.36	
		0 O.A.T 270225	4,300,000.00	3,973,220.98	
		0 O.A.T 291125	5,190,000.00	4,441,784.94	
		0 O.A.T 301125	5,530,000.00	4,588,040.51	
		0 O.A.T 311125	5,060,000.00	4,066,611.94	
		0 O.A.T 320525	3,870,000.00	3,059,341.42	

0 OBL 251010	1,400,000.00	1,347,572.10	
0 OBL 251010	900,000.00	866,466.55	
0 OBL 260410	3,200,000.00	3,046,220.80	
0 OBL 261009	2,710,000.00	2,550,882.47	
0 OBL 270416	3,100,000.00	2,886,229.89	
0 SPAIN GOVT 250531	600,000.00	581,490.07	
0 SPAIN GOVT 260131	1,500,000.00	1,427,638.50	
0 SPAIN GOVT 270131	2,520,000.00	2,331,292.32	
0 SPAIN GOVT 280131	1,750,000.00	1,575,126.00	
0.1 BEL GOVT 300622	1,370,000.00	1,167,661.27	
0.1 SPAIN GOVT 310430	2,750,000.00	2,259,994.68	
0.125 FINNISH GOV 310915	500,000.00	411,352.50	
0.125 FINNISH GOV 360415	500,000.00	354,758.50	
0.125 FINNISH GOV 520415	580,000.00	263,694.56	
0.2 IRISH GOVT 270515	830,000.00	771,945.33	
0.2 IRISH GOVT 301018	700,000.00	600,269.64	
0.25 AUSTRIA GOVT 361020	550,000.00	390,783.80	
0.25 BUND 270215	3,800,000.00	3,577,563.20	
0.25 BUND 280815	3,020,000.00	2,766,344.91	
0.25 BUND 290215	2,800,000.00	2,541,434.00	
0.25 FINNISH GOVT 400915	390,000.00	246,363.39	
0.25 ITALY GOVT 280315	1,900,000.00	1,697,785.37	
0.25 NETH GOVT 250715	1,920,000.00	1,863,299.37	
0.25 NETH GOVT 290715	960,000.00	854,302.08	
0.25 O.A.T 261125	4,250,000.00	3,977,565.43	
0.35 BEL GOVT 320622	1,500,000.00	1,227,074.80	
0.35 IRISH GOVT 321018	700,000.00	575,829.27	
0.4 BEL GOVT 400622	850,000.00	543,761.46	
0.4 IRISH GOVT 350515	550,000.00	422,664.00	
0.45 ITALY GOVT 290215	1,500,000.00	1,313,304.75	
0.5 AUSTRIA GOVT 270420	1,440,000.00	1,347,697.80	
0.5 AUSTRIA GOVT 290220	1,700,000.00	1,530,480.25	
0.5 BUND 260215	3,450,000.00	3,321,961.01	
0.5 BUND 270815	3,260,000.00	3,064,375.55	
0.5 BUND 280215	3,760,000.00	3,507,104.28	
0.5 FINNISH GOVT 260415	1,050,000.00	1,003,799.07	
0.5 FINNISH GOVT 270915	550,000.00	511,449.07	
0.5 FINNISH GOVT 280915	660,000.00	599,392.29	
0.5 FINNISH GOVT 290915	480,000.00	426,729.50	
0.5 FINNISH GOVT 430415	610,000.00	380,079.16	
0.5 ITALY GOVT 260201	2,000,000.00	1,911,483.90	
0.5 ITALY GOVT 280715	1,400,000.00	1,251,282.20	

0.5 NETH GOVT 260715	2,390,000.00	2,281,864.45
0.5 NETH GOVT 320715	1,320,000.00	1,114,403.80
0.5 NETH GOVT 400115	1,610,000.00	1,136,148.24
0.5 O.A.T 260525	5,100,000.00	4,857,819.05
0.5 O.A.T 290525	5,580,000.00	4,966,841.70
0.5 O.A.T 400525	3,090,000.00	1,996,739.39
0.5 O.A.T 440625	2,200,000.00	1,270,117.73
0.5 O.A.T 720525	1,270,000.00	464,431.98
0.5 SPAIN GOVT 300430	2,490,000.00	2,164,704.20
0.5 SPAIN GOVT 311031	1,800,000.00	1,501,686.00
0.55 IRISH GOVT 410422	430,000.00	287,581.85
0.6 ITALY GOVT 310801	2,290,000.00	1,865,144.88
0.6 SPAIN GOVT 291031	1,580,000.00	1,397,993.87
0.65 BEL GOVT 710622	720,000.00	297,321.22
0.7 AUSTRIA GOVT 710420	420,000.00	184,340.67
0.7 SPAIN GOVT 320430	2,470,000.00	2,063,533.71
0.75 AUSTRIA GOVT 261020	1,500,000.00	1,426,149.49
0.75 AUSTRIA GOVT 280220	1,150,000.00	1,067,436.90
0.75 AUSTRIA GOVT 510320	1,240,000.00	704,169.34
0.75 FINNISH GOVT 310415	600,000.00	522,975.75
0.75 NETH GOVT 270715	1,750,000.00	1,652,672.00
0.75 NETH GOVT 280715	1,700,000.00	1,578,905.60
0.75 O.A.T 280225	4,400,000.00	4,067,685.02
0.75 O.A.T 280525	6,070,000.00	5,584,286.18
0.75 O.A.T 281125	6,200,000.00	5,646,758.49
0.75 O.A.T 520525	3,370,000.00	1,727,158.70
0.75 O.A.T 530525	3,190,000.00	1,596,969.82
0.8 BEL GOVT 250622	1,130,000.00	1,102,436.98
0.8 BEL GOVT 270622	1,940,000.00	1,827,664.30
0.8 BEL GOVT 280622	1,500,000.00	1,389,840.00
0.8 SPAIN GOVT 270730	2,600,000.00	2,433,689.70
0.8 SPAIN GOVT 290730	2,700,000.00	2,426,494.72
0.85 AUSTRIA GOVT 200630	450,000.00	199,508.62
0.85 ITALY GOVT 270115	2,030,000.00	1,909,950.87
0.85 SPAIN GOVT 370730	1,320,000.00	956,316.90
0.875 FINNISH GOV 250915	500,000.00	486,229.00
0.9 AUSTRIA GOVT 320220	1,300,000.00	1,122,798.62
0.9 BEL GOVT 290622	2,300,000.00	2,101,170.17
0.9 IRISH GOVT 280515	950,000.00	888,085.32
0.9 ITALY GOVT 310401	2,570,000.00	2,161,868.58
0.95 ITALY GOVT 270915	2,250,000.00	2,090,193.75
0.95 ITALY GOVT 300801	1,980,000.00	1,702,624.77
0.95 ITALY GOVT 311201	2,100,000.00	1,738,907.03

0.95 ITALY GOVT 320601	1,870,000.00	1,525,697.47	
0.95 ITALY GOVT 370301	1,440,000.00	1,003,588.19	
1 BEL GOVT 260622	1,900,000.00	1,827,386.75	
1 BEL GOVT 310622	1,900,000.00	1,678,820.52	
1 BUND 250815	500,000.00	488,432.00	
1 BUND 380515	2,420,000.00	1,977,422.53	
1 IRISH GOVT 260515	700,000.00	675,657.50	
1 O.A.T 251125	4,200,000.00	4,071,824.40	
1 O.A.T 270525	3,780,000.00	3,572,377.83	
1 SPAIN GOVT 420730	1,310,000.00	852,900.39	
1 SPAIN GOVT 501031	1,960,000.00	1,063,309.80	
1.1 IRISH GOVT 290515	820,000.00	761,563.47	
1.1 ITALY GOVT 270401	1,440,000.00	1,357,049.30	
1.125 FINNISH GOV 340415	440,000.00	371,283.16	
1.2 AUSTRIA GOVT 251020	400,000.00	389,937.00	
1.2 ITALY GOVT 250815	900,000.00	877,291.20	
1.2 SPAIN GOVT 401031	1,850,000.00	1,296,520.70	
1.25 BEL GOVT 330422	970,000.00	845,193.98	
1.25 BUND 480815	3,250,000.00	2,464,304.36	
1.25 ITALY GOVT 261201	2,200,000.00	2,096,824.90	
1.25 O.A.T 340525	5,350,000.00	4,499,735.20	
1.25 O.A.T 360525	4,780,000.00	3,844,032.74	
1.25 O.A.T 380525	2,610,000.00	2,002,663.44	
1.25 SPAIN GOVT 301031	2,630,000.00	2,366,370.11	
1.3 IRISH GOVT 330515	630,000.00	557,332.80	
1.3 OBL 271015	2,970,000.00	2,858,082.97	
1.3 OBL 271015	500,000.00	481,281.25	
1.3 SPAIN GOVT 261031	1,530,000.00	1,470,938.17	
1.35 IRISH GOVT 310318	830,000.00	762,051.00	
1.35 ITALY GOVT 300401	2,200,000.00	1,957,329.00	
1.375 FINNISH GOV 270415	600,000.00	576,045.63	
1.375 FINNISH GOV 470415	450,000.00	320,435.47	
1.4 BEL GOVT 530622	1,130,000.00	700,773.45	
1.4 SPAIN GOVT 280430	2,750,000.00	2,597,292.50	
1.4 SPAIN GOVT 280730	2,870,000.00	2,701,583.37	
1.45 BEL GOVT 370622	610,000.00	497,558.70	
1.45 ITALY GOVT 360301	1,950,000.00	1,494,153.37	
1.45 SPAIN GOVT 271031	3,050,000.00	2,904,764.21	
1.45 SPAIN GOVT 290430	2,020,000.00	1,886,273.47	
1.45 SPAIN GOVT 711031	900,000.00	439,301.24	
1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1,060,000.00	769,876.36	
1.5 AUSTRIA GOVT 861102	310,000.00	182,953.16	

1.5 FINNISH GOVT 320915	700,000.00	628,050.85
1.5 IRISH GOVT 500515	990,000.00	702,212.94
1.5 ITALY GOVT 250601	440,000.00	432,104.75
1.5 ITALY GOVT 450430	1,150,000.00	719,796.50
1.5 O.A.T 310525	6,220,000.00	5,659,436.05
1.5 O.A.T 500525	2,760,000.00	1,815,703.94
1.5 SPAIN GOVT 270430	2,550,000.00	2,447,203.12
1.6 BEL GOVT 470622	780,000.00	553,091.76
1.6 ITALY GOVT 260601	2,550,000.00	2,468,113.12
1.65 ITALY GOVT 301201	2,130,000.00	1,898,298.21
1.65 ITALY GOVT 320301	1,870,000.00	1,625,395.39
1.7 BEL GOVT 500622	1,110,000.00	773,632.26
1.7 BUND 320815	2,650,000.00	2,523,283.62
1.7 IRISH GOVT 370515	700,000.00	603,410.67
1.7 ITALY GOVT 510901	1,900,000.00	1,139,544.00
1.75 O.A.T 390625	3,250,000.00	2,640,589.25
1.75 O.A.T 660525	1,660,000.00	1,053,836.89
1.8 BUND 530815	2,910,000.00	2,435,178.21
1.8 BUND 530815	750,000.00	628,512.75
1.8 ITALY GOVT 410301	1,830,000.00	1,306,146.48
1.85 AUSTRIA GOVT 490523	550,000.00	422,083.75
1.85 ITALY GOVT 250701	1,600,000.00	1,574,615.20
1.85 SPAIN GOVT 350730	2,560,000.00	2,208,611.84
1.9 BEL GOVT 380622	1,080,000.00	915,920.46
1.9 SPAIN GOVT 521031	2,110,000.00	1,410,293.40
1.95 SPAIN GOVT 260430	2,500,000.00	2,448,534.05
1.95 SPAIN GOVT 300730	2,500,000.00	2,359,075.00
2 AUSTRIA GOVT 260715	500,000.00	490,256.25
2 IRISH GOVT 450218	1,010,000.00	839,239.30
2 ITALY GOVT 251201	1,400,000.00	1,373,840.20
2 ITALY GOVT 280201	1,750,000.00	1,672,982.50
2 NETH GOVT 540115	950,000.00	792,176.50
2 O.A.T 321125	4,650,000.00	4,290,818.88
2 O.A.T 480525	3,060,000.00	2,308,610.17
2.05 ITALY GOVT 270801	1,820,000.00	1,754,269.11
2.1 AUSTRIA GOVT 170920	630,000.00	464,814.95
2.1 BUND 291115	1,720,000.00	1,693,259.16
2.1 ITALY GOVT 260715	2,600,000.00	2,537,648.75
2.1 OBL 290412	550,000.00	541,871.82
2.15 BEL GOVT 660622	830,000.00	605,940.57
2.15 ITALY GOVT 520901	850,000.00	555,268.87
2.15 ITALY GOVT 720301	770,000.00	461,988.83
2.15 SPAIN GOVT 251031	2,700,000.00	2,662,744.26

2.2 BUND 340215	2,620,000.00	2,571,642.66	
2.2 ITALY GOVT 270601	2,150,000.00	2,085,677.03	
2.2 OBL 280413	2,610,000.00	2,583,201.82	
2.25 BEL GOVT 570622	740,000.00	560,047.54	
2.25 ITALY GOVT 360901	1,620,000.00	1,348,682.40	
2.3 BUND 330215	3,850,000.00	3,827,358.15	
2.3 BUND 330215	700,000.00	696,053.05	
2.35 SPAIN GOVT 330730	1,940,000.00	1,812,391.64	
2.4 AUSTRIA GOVT 340523	950,000.00	901,938.07	
2.4 BUND 301115	1,170,000.00	1,170,315.90	
2.4 IRISH GOVT 300515	1,130,000.00	1,111,355.00	
2.4 OBL 281019	2,710,000.00	2,703,472.28	
2.45 ITALY GOVT 330901	1,900,000.00	1,709,344.50	
2.45 ITALY GOVT 500901	1,180,000.00	841,528.80	
2.5 BUND 440704	3,130,000.00	3,061,640.80	
2.5 BUND 460815	3,080,000.00	3,012,224.60	
2.5 BUND 540815	1,320,000.00	1,288,978.47	
2.5 ITALY GOVT 251115	2,500,000.00	2,471,674.37	
2.5 ITALY GOVT 321201	2,050,000.00	1,873,989.56	
2.5 NETH GOVT 300115	1,490,000.00	1,479,085.75	
2.5 NETH GOVT 330115	1,070,000.00	1,056,007.07	
2.5 NETH GOVT 330715	1,290,000.00	1,268,266.72	
2.5 NETH GOVT 340715	690,000.00	674,477.32	
2.5 O.A.T 260924	4,900,000.00	4,839,024.40	
2.5 O.A.T 270924	1,910,000.00	1,881,355.73	
2.5 O.A.T 300525	6,720,000.00	6,562,464.04	
2.5 O.A.T 430525	1,580,000.00	1,361,428.33	
2.5 SCHATS 260319	1,000,000.00	993,672.50	
2.5 SPAIN GOVT 270531	660,000.00	650,399.47	
2.55 SPAIN GOVT 321031	2,500,000.00	2,393,187.50	
2.6 BUND 330815	3,020,000.00	3,070,947.40	
2.6 IRISH GOVT 341018	340,000.00	331,812.37	
2.625 FINNISH GOV 420704	480,000.00	442,565.01	
2.65 ITALY GOVT 271201	2,090,000.00	2,046,338.85	
2.7 ITALY GOVT 470301	1,950,000.00	1,509,997.53	
2.7 SPAIN GOVT 481031	1,800,000.00	1,493,468.85	
2.75 BEL GOVT 390422	500,000.00	468,534.50	
2.75 FINNISH GOVT 280704	590,000.00	589,544.12	
2.75 FINNISH GOVT 380415	430,000.00	409,129.52	
2.75 NETH GOVT 470115	2,090,000.00	2,056,711.52	
2.75 O.A.T 271025	5,630,000.00	5,587,293.63	
2.75 O.A.T 290225	4,930,000.00	4,887,613.08	

2.8 ITALY GOVT 281201	2,410,000.00	2,357,100.52
2.8 ITALY GOVT 290615	1,710,000.00	1,662,222.60
2.8 ITALY GOVT 670301	950,000.00	684,509.29
2.8 SPAIN GOVT 260531	3,000,000.00	2,982,180.00
2.85 BEL GOVT 341022	750,000.00	736,424.25
2.875 FINNISH GOV 290415	800,000.00	801,610.56
2.9 AUSTRIA GOVT 290523	500,000.00	502,266.25
2.9 AUSTRIA GOVT 330220	1,630,000.00	1,624,515.05
2.9 AUSTRIA GOVT 340220	690,000.00	684,985.59
2.9 SPAIN GOVT 461031	1,760,000.00	1,535,072.00
2.95 FINNISH GOVT 550415	300,000.00	284,790.00
2.95 ITALY GOVT 270215	1,700,000.00	1,683,824.70
2.95 ITALY GOVT 380901	1,490,000.00	1,303,899.74
3 BEL GOVT 330622	1,870,000.00	1,874,867.04
3 BEL GOVT 340622	1,040,000.00	1,037,539.88
3 FINNISH GOVT 330915	810,000.00	811,699.38
3 IRISH GOVT 431018	210,000.00	206,275.44
3 ITALY GOVT 290801	2,250,000.00	2,207,013.75
3 O.A.T 330525	4,200,000.00	4,170,459.30
3 O.A.T 490625	870,000.00	794,370.90
3 O.A.T 540525	2,600,000.00	2,313,100.40
3.1 ITALY GOVT 400301	1,530,000.00	1,338,144.88
3.1 SCHATS 250918	1,750,000.00	1,750,261.10
3.1 SCHATS 251212	1,720,000.00	1,722,518.08
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	580,000.00	574,015.85
3.15 AUSTRIA GOVT 531020	350,000.00	343,169.75
3.15 SPAIN GOVT 330430	2,420,000.00	2,413,590.63
3.25 BUND 420704	2,060,000.00	2,238,859.50
3.25 ITALY GOVT 380301	1,250,000.00	1,136,625.00
3.25 ITALY GOVT 460901	1,670,000.00	1,426,497.30
3.25 NETH GOVT 440115	790,000.00	831,301.20
3.25 O.A.T 450525	2,600,000.00	2,505,430.72
3.25 O.A.T 550525	760,000.00	706,091.49
3.25 SPAIN GOVT 340430	2,210,000.00	2,205,502.20
3.3 BEL GOVT 540622	1,010,000.00	961,794.72
3.35 ITALY GOVT 290701	940,000.00	936,169.50
3.35 ITALY GOVT 350301	1,720,000.00	1,634,428.28
3.4 ITALY GOVT 280401	2,320,000.00	2,324,981.04
3.45 AUSTRIA GOVT 301020	680,000.00	703,229.61
3.45 BEL GOVT 430622	310,000.00	311,378.88
3.45 ITALY GOVT 480301	1,500,000.00	1,313,678.74
3.45 SPAIN GOVT 430730	1,300,000.00	1,246,989.90
3.45 SPAIN GOVT 660730	1,560,000.00	1,412,713.49

3.5 BEL GOVT 550622	620,000.00	610,007.01	
3.5 ITALY GOVT 260115	1,400,000.00	1,401,832.60	
3.5 ITALY GOVT 300301	2,430,000.00	2,436,296.85	
3.5 ITALY GOVT 310215	1,750,000.00	1,740,526.02	
3.5 O.A.T 260425	4,550,000.00	4,580,399.46	
3.5 O.A.T 331125	3,230,000.00	3,326,284.35	
3.5 SPAIN GOVT 290531	1,950,000.00	1,997,082.75	
3.55 SPAIN GOVT 331031	2,470,000.00	2,532,101.96	
3.7 ITALY GOVT 300615	1,150,000.00	1,160,282.72	
3.75 BEL GOVT 450622	1,090,000.00	1,140,038.08	
3.75 NETH GOVT 420115	1,840,000.00	2,055,812.30	
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	470,000.00	527,888.72	
3.8 ITALY GOVT 260415	950,000.00	957,079.40	
3.8 ITALY GOVT 280801	1,820,000.00	1,849,565.90	
3.85 ITALY GOVT 260915	1,880,000.00	1,900,311.52	
3.85 ITALY GOVT 291215	2,100,000.00	2,139,162.48	
3.85 ITALY GOVT 340701	500,000.00	498,746.75	
3.85 ITALY GOVT 490901	1,720,000.00	1,593,489.70	
3.9 SPAIN GOVT 390730	1,420,000.00	1,466,441.10	
4 BEL GOVT 320328	880,000.00	945,152.12	
4 BUND 370104	2,480,000.00	2,865,456.48	
4 FINNISH GOVT 250704	450,000.00	453,453.52	
4 ITALY GOVT 301115	1,700,000.00	1,741,579.45	
4 ITALY GOVT 311030	650,000.00	666,724.50	
4 ITALY GOVT 350430	1,270,000.00	1,280,663.55	
4 ITALY GOVT 370201	3,260,000.00	3,264,368.40	
4 NETH GOVT 370115	1,730,000.00	1,937,933.54	
4 O.A.T 381025	2,640,000.00	2,829,887.28	
4 O.A.T 550425	1,960,000.00	2,103,632.52	
4 O.A.T 600425	2,260,000.00	2,451,241.20	
4 SPAIN GOVT 541031	500,000.00	506,630.80	
4.05 ITALY GOVT 371030	750,000.00	747,890.06	
4.1 ITALY GOVT 290201	1,200,000.00	1,235,625.00	
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	1,550,000.00	1,715,661.21	
4.15 ITALY GOVT 391001	1,070,000.00	1,063,205.50	
4.2 ITALY GOVT 340301	2,530,000.00	2,601,123.36	
4.2 SPAIN GOVT 370131	2,170,000.00	2,337,476.26	
4.25 BEL GOVT 410328	1,720,000.00	1,913,830.92	
4.25 BUND 390704	1,840,000.00	2,212,260.69	
4.35 ITALY GOVT 331101	2,000,000.00	2,083,010.00	
4.4 ITALY GOVT 330501	2,150,000.00	2,253,307.50	
4.45 ITALY GOVT 430901	1,130,000.00	1,147,746.65	

	4.5 BEL GOVT 260328	1,200,000.00	1,229,065.80	
	4.5 ITALY GOVT 260301	2,800,000.00	2,851,184.00	
	4.5 ITALY GOVT 531001	1,410,000.00	1,428,471.00	
	4.5 O.A.T 410425	3,570,000.00	4,048,986.90	
	4.65 SPAIN GOVT 250730	3,000,000.00	3,041,752.50	
	4.7 SPAIN GOVT 410730	2,180,000.00	2,468,090.92	
	4.75 BUND 280704	1,300,000.00	1,413,232.60	
	4.75 BUND 340704	2,220,000.00	2,673,195.68	
	4.75 BUND 400704	2,110,000.00	2,695,108.05	
	4.75 ITALY GOVT 280901	2,530,000.00	2,666,327.02	
	4.75 ITALY GOVT 440901	2,000,000.00	2,119,094.00	
	4.75 O.A.T 350425	2,140,000.00	2,439,161.30	
	4.85 AUSTRIA GOVT 260315	1,600,000.00	1,646,360.80	
	4.9 SPAIN GOVT 400730	2,040,000.00	2,349,162.00	
	5 BEL GOVT 350328	1,870,000.00	2,190,450.68	
	5 ITALY GOVT 340801	3,100,000.00	3,391,561.82	
	5 ITALY GOVT 390801	2,550,000.00	2,775,328.71	
	5 ITALY GOVT 400901	2,020,000.00	2,196,800.50	
	5.15 SPAIN GOVT 281031	2,000,000.00	2,178,305.40	
	5.15 SPAIN GOVT 441031	1,560,000.00	1,871,505.01	
	5.25 ITALY GOVT 291101	2,980,000.00	3,246,844.10	
	5.5 BEL GOVT 280328	2,310,000.00	2,529,201.67	
	5.5 BUND 310104	2,290,000.00	2,710,340.95	
	5.5 NETH GOVT 280115	810,000.00	887,291.65	
	5.5 O.A.T 290425	3,940,000.00	4,380,413.20	
	5.625 BUND 280104	1,850,000.00	2,042,744.10	
	5.75 ITALY GOVT 330201	2,720,000.00	3,112,871.63	
	5.75 O.A.T 321025	3,690,000.00	4,406,209.07	
	5.75 SPAIN GOVT 320730	2,750,000.00	3,265,076.10	
	5.9 SPAIN GOVT 260730	2,450,000.00	2,587,033.40	
	6 ITALY GOVT 310501	3,060,000.00	3,514,850.33	
	6 O.A.T 251025	400,000.00	413,945.60	
	6 SPAIN GOVT 290131	2,600,000.00	2,940,296.32	
	6.25 AUSTRIA GOVT 270715	900,000.00	986,139.00	
	6.25 BUND 300104	1,300,000.00	1,555,012.55	
	6.5 BUND 270704	1,850,000.00	2,058,058.95	
	6.5 ITALY GOVT 271101	1,660,000.00	1,827,892.40	
	7.25 ITALY GOVT 261101	1,320,000.00	1,436,773.80	
ユーロ合計		711,430,000.00	657,628,323.17 (112,645,155,475)	
合計			366,128,578,086 (366,128,578,086)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 269銘柄	100.00%	47.19%
カナダドル	国債証券 39銘柄	100.00%	2.09%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	100.00%	1.30%
イギリスポンド	国債証券 60銘柄	100.00%	5.29%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.00%	0.43%
マレーシアリンギット	国債証券 25銘柄	100.00%	0.51%
ニュージーランドドル	国債証券 11銘柄	100.00%	0.23%
スウェーデンクローネ	国債証券 7銘柄	100.00%	0.17%
ノルウェークローネ	国債証券 10銘柄	100.00%	0.17%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.00%	0.26%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.00%	0.84%
イスラエルシェケル	国債証券 12銘柄	100.00%	0.29%
ポーランドズロチ	国債証券 12銘柄	100.00%	0.52%
中国元	国債証券 79銘柄	100.00%	9.95%
ユーロ	国債証券 375銘柄	100.00%	30.77%

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。

新マネー・マーケット・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
[2024年 6月25日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	26,608,836
現先取引勘定	49,999,500
未収利息	46
流動資産合計	76,608,382
資産合計	76,608,382
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	77,435,942
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	827,560
元本等合計	76,608,382
純資産合計	76,608,382
負債純資産合計	76,608,382

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

該当事項はありません。

（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）

	[2024年 6月25日現在]
1. 期首	2023年 6月27日
期首元本額	27,137,884円
期中追加設定元本額	10,275,526,450円
期中一部解約元本額	10,225,228,392円
元本の内訳	
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	22,314,383円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	43,472,744円
M U K A M 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	11,143,866円
M U K A M 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	504,949円
合計	77,435,942円
2. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	827,560円
3. 受益権の総数	77,435,942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 2023年 6月27日 至 2024年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク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	[2024年 6月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、該当事項はありません。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（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）

	[2024年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	0.9893円
(1万口当たり純資産額)	(9,893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

該当事項はありません。

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

２【ファンドの現況】

【ラップ向けアクティブアロケーションファンド】

【純資産額計算書】

2024年 6月28日現在

（単位：円）

資産総額	400,372,745
負債総額	7,317
純資産総額（ - ）	400,365,428
発行済口数	376,022,607口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.0647
（10,000口当たり）	（10,647）

（参考）

ＴＯＰＩＸマザーファンド

純資産額計算書

2024年 6月28日現在

（単位：円）

資産総額	1,573,580,135,112
負債総額	16,629,848,900
純資産総額（ - ）	1,556,950,286,212
発行済口数	451,252,172,326口
1口当たり純資産価額（ / ）	3.4503
（10,000口当たり）	（34,503）

日本短期債券マザーファンド

純資産額計算書

2024年 6月28日現在

（単位：円）

資産総額	13,594,255,207
負債総額	298,498,470
純資産総額（ - ）	13,295,756,737
発行済口数	11,857,986,858口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.1212
（10,000口当たり）	（11,212）

東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド

純資産額計算書

2024年 6月28日現在

（単位：円）

資産総額	120,215,339,708
------	-----------------

負債総額	2,787,053,804
純資産総額（ - ）	117,428,285,904
発行済口数	34,165,047,717口
1口当たり純資産価額（ / ）	3.4371
（10,000口当たり）	（34,371）

外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年 6月28日現在

（単位：円）

資産総額	6,145,520,015,574
負債総額	448,774,492
純資産総額（ - ）	6,145,071,241,082
発行済口数	814,172,629,847口
1口当たり純資産価額（ / ）	7.5476
（10,000口当たり）	（75,476）

外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年 6月28日現在

（単位：円）

資産総額	673,851,425,910
負債総額	2,036,367,942
純資産総額（ - ）	671,815,057,968
発行済口数	239,466,536,172口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.8055
（10,000口当たり）	（28,055）

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年 6月28日現在

（単位：円）

資産総額	374,539,362,333
負債総額	9,405,351,493
純資産総額（ - ）	365,134,010,840
発行済口数	330,853,851,824口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.1036
（10,000口当たり）	（11,036）

新マネー・マーケット・マザーファンド

純資産額計算書

2024年 6月28日現在

（単位：円）

資産総額	41,608,800
負債総額	—
純資産総額（ - ）	41,608,800
発行済口数	42,057,390口
1口当たり純資産価額（ / ）	0.9893
（10,000口当たり）	（9,893）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換等

該当事項はありません。

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

（2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

該当事項はありません。

（4）受益権の譲渡

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

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

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認め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。

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額等

2024年6月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近５年間における資本金の額の増減はありません。

（２）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

・投資運用の意思決定機構

投資環境見通しの策定

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

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。

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。

ファンドに関係する法人等の管理

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

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。

2024年 6月28日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本 数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	825	36,626,583
追加型公社債投資信託	16	1,559,147
単位型株式投資信託	95	421,610
単位型公社債投資信託	47	98,304
合 計	983	38,705,644

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）財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社（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。

なお、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39期事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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。

（１）【貸借対照表】

(単位：千円)

	第38期 (2023年3月31日現在)		第39期 (2024年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	51,733,041	2	58,206,340
有価証券		1,579,691		15,283
前払費用		770,747		679,199
未収入金		81,854		138,388
未収委託者報酬		16,753,855		21,064,747
未収収益	2	688,142	2	1,485,701
金銭の信託		10,400,000		10,500,500

その他		745,576		371,400
流動資産合計		82,752,908		92,461,561
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	181,551	1	2,936,036
器具備品	1	730,357	1	1,531,857
土地		628,433		628,433
建設仮勘定		1,111,177		45,140
有形固定資産合計		2,651,520		5,141,467
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		4,183,644		5,008,987
ソフトウェア仮勘定		1,907,739		1,587,548
無形固定資産合計		6,107,206		6,612,357
投資その他の資産				
投資有価証券		12,022,365		13,788,071
関係会社株式		159,536		159,536
投資不動産	1	807,066	1	1,788,120
長期差入保証金		689,492		689,867
前払年金費用		118,832		47,573
繰延税金資産		1,675,132		1,088,836
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		15,494,056		17,583,636
固定資産合計		24,252,782		29,337,461
資産合計		107,005,691		121,799,022

(単位：千円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	507,559	807,451
未払金		
未払収益分配金	114,094	105,550
未払償還金	7,418	43,553
未払手数料	2 6,139,595	2 7,523,485
その他未払金	2 955,697	2 885,002
未払費用	2 5,778,896	2 8,611,140
未払消費税等	439,657	623,219
未払法人税等	2,375,281	2,235,007
賞与引当金	849,840	1,182,242
役員賞与引当金	154,872	175,992
その他	5,517	12,303
流動負債合計	17,328,431	22,204,949
固定負債		
退職給付引当金	1,333,882	1,608,101
役員退職慰労引当金	75,667	30,105
時効後支払損引当金	254,296	250,350

資産除去債務	-	1,428,586
その他	-	29,109
固定負債合計	1,663,846	3,346,253
負債合計	18,992,277	25,551,202

(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	33,267,700	40,236,787
利益剰余金合計	40,608,289	47,577,377
株主資本合計	87,341,133	94,310,221

(単位：千円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024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	672,279	1,937,598
評価・換算差額等合計	672,279	1,937,598
純資産合計	88,013,413	96,247,820
負債純資産合計	107,005,691	121,799,022

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	84,121,445	98,635,342
投資顧問料	2,750,601	3,117,320
その他営業収益	10,412	148,442
営業収益合計	86,882,459	101,901,104
営業費用		
支払手数料	4 31,461,274	4 34,494,219
広告宣伝費	798,894	593,586
公告費	375	1,017
調査費		
調査費	2,849,042	3,537,103
委託調査費	19,236,505	27,296,058
事務委託費	1,751,807	1,861,577
営業雑経費		

通信費	113,480	137,737
印刷費	367,379	390,143
協会費	58,128	68,869
諸会費	18,447	20,108
事務機器関連費	2,238,382	2,531,009
その他営業雑経費	-	139,012
営業費用合計	58,893,717	71,070,444
一般管理費		
給料		
役員報酬	416,461	400,592
給料・手当	6,565,766	7,202,711
賞与引当金繰入	849,840	1,182,242
役員賞与引当金繰入	154,872	175,992
福利厚生費	1,279,885	1,424,215
交際費	8,942	10,054
旅費交通費	75,274	108,782
租税公課	403,955	397,138
不動産賃借料	719,707	728,550
退職給付費用	388,176	381,449
固定資産減価償却費	2,418,341	2,469,755
諸経費	444,313	490,104
一般管理費合計	13,725,534	14,971,590
営業利益	14,263,207	15,859,070

(単位：千円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	47,353	54,618
受取利息	4 10,279	4 12,836
投資有価証券償還益	609,102	204,527
収益分配金等時効完成分	94,351	17,722
受取賃貸料	4 65,808	4 162,111
その他	36,894	44,734
営業外収益合計	863,788	496,550
営業外費用		
投資有価証券償還損	32,995	234,700
時効後支払損引当金繰入	31,951	-
事務過誤費	2,680	10,822
賃貸関連費用	14,262	108,773
その他	32,394	25,903
営業外費用合計	114,284	380,199
経常利益	15,012,711	15,975,421
特別利益		
投資有価証券売却益	387,113	464,927
固定資産売却益	-	1 16,229
資産除去債務履行差額	-	87,050
特別利益合計	387,113	568,207

特別損失

投資有価証券売却損		15,828		57,011
投資有価証券評価損		104,554		31,651
固定資産除却損	3	32,791	3	20,246
固定資産売却損		-	2	65,427
減損損失	5	315,350		-
企業結合関連費用		-	6	1,187,136
特別損失合計		468,524		1,361,473
税引前当期純利益		14,931,300		15,182,154
法人税、住民税及び事業税	4	4,860,444	4	4,542,085
法人税等調整額		271,471		102,468
法人税等合計		4,588,973		4,644,553
当期純利益		10,342,327		10,537,601

(3) 【株主資本等変動計算書】

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)				
当期変動額合計	—	—	—	—
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712

	利益剰余金					株主資本合計
	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計		
		別途 積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	342,589	6,998,000	29,000,498	36,341,088	83,073,932	
当期変動額						
剰余金の配当			6,075,125	6,075,125	6,075,125	
当期純利益			10,342,327	10,342,327	10,342,327	
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)						
当期変動額合計	—	—	4,267,201	4,267,201	4,267,201	
当期末残高	342,589	6,998,000	33,267,700	40,608,289	87,341,133	

評価・換算差額等

	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
当期首残高	1,626,775	1,626,775	84,700,707
当期変動額			
剰余金の配当			6,075,125
当期純利益			10,342,327
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	954,495	954,495	954,495
当期変動額合計	954,495	954,495	3,312,705
当期末残高	672,279	672,279	88,013,413

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
当期変動額				
企業結合による増加				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）				
当期変動額合計	—	—	—	—
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712

	利益剰余金				株主資本合計
	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
別途 積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	342,589	6,998,000	33,267,700	40,608,289	87,341,133
当期変動額					
企業結合による増加			1,602,526	1,602,526	1,602,526
剰余金の配当			5,171,039	5,171,039	5,171,039
当期純利益			10,537,601	10,537,601	10,537,601
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)					
当期変動額合計	—	—	6,969,087	6,969,087	6,969,087
当期末残高	342,589	6,998,000	40,236,787	47,577,377	94,310,221

	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	672,279	672,279	88,013,413

当期変動額			
企業結合による増加			1,602,526
剰余金の配当			5,171,039
当期純利益			10,537,601
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	1,265,319	1,265,319	1,265,319
当期変動額合計	1,265,319	1,265,319	8,234,406
当期末残高	1,937,598	1,937,598	96,247,820

[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、1998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2016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～50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。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5) 役員退職慰労引当金

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

(6) 時効後支払損引当金

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

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

グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
建物	1,006,606千円	498,805千円
器具備品	1,985,072千円	1,643,689千円
投資不動産	163,978千円	211,090千円

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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
預金	40,165,058千円	39,776,992千円
未収収益	15,046千円	12,312千円
未払手数料	790,279千円	886,173千円
その他未払金	77,007千円	105,407千円
未払費用	277,358千円	599,493千円

(損益計算書関係)

1. 固定資産売却益の内訳

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
器具備品	-	16,229千円
計	-	16,229千円

2. 固定資産売却損の内訳

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
器具備品	-	65,427千円
計	-	65,427千円

3. 固定資産除却損の内訳

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
建物	1,047千円	15,825千円
器具備品	29,762千円	3,986千円
ソフトウェア	1,981千円	434千円
計	32,791千円	20,246千円

4. 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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
支払手数料	4,893,312千円	5,006,309千円
受取利息	10,236千円	12,747千円
受取賃貸料	68,168千円	152,876千円
法人税、住民税及び事業税	3,947,200千円	132,303千円

5. 減損損失

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

当社は、以下のとおり減損損失を計上しました。

場所	用途	種類	金額
東京都千代田区（本社）	ホームページ	ソフトウェア	315,350千円

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグループिंगとしております。

ホームページのリニューアルに伴い、現行のホームページについて将来の利用終了が見込まれるため帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、回収可能価額として使用価値を用いておりますが、割引率については使用見込期間が短いため考慮していません。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

当事業年度については、該当事項はありません。

6. 企業結合関連費用

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

前事業年度については、該当事項はありません。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

企業結合に伴うものであり、主にシステム統合費用などであります。

（株主資本等変動計算書関係）

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				

普通株式	211,581	-	-	211,581
合計	211,581	-	-	211,581

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

2022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。

配当金の総額	6,075,125千円
1株当たり配当額	28,713円
基準日	2022年3月31日
効力発生日	2022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

2023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。

配当金の総額	5,171,039千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	24,440円
基準日	2023年3月31日
効力発生日	2023年6月29日

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

2023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。

配当金の総額	5,171,039千円
1株当たり配当額	24,440円
基準日	2023年3月31日
効力発生日	2023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

2024年6月26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。

配当金の総額	45,747,620千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	216,218円
基準日	2024年3月31日
効力発生日	2024年6月27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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
1年内	962,809千円	681,212千円
1年超	1,532,728千円	851,515千円
合計	2,495,537千円	1,532,728千円

（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38期(2023年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 有価証券	1,579,691	1,579,691	-
(2) 金銭の信託	10,400,000	10,400,000	-
(3) 投資有価証券	12,022,365	12,022,365	-
資産計	24,002,056	24,002,056	-

(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

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

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。

(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38期(2023年3月31日現在)

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	51,733,041	-	-	-
金銭の信託	10,400,000	-	-	-
未収委託者報酬	16,753,855	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	1,579,691	4,859,714	1,433,213	-
合計	80,466,587	4,859,714	1,433,213	-

第39期(2024年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 有価証券	15,283	15,283	-
(2) 金銭の信託	10,500,500	10,500,500	-
(3) 投資有価証券	13,788,071	13,788,071	-
資産計	24,303,855	24,303,855	-

(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

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

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。

（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39期(2024年3月31日現在)

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	58,206,340	-	-	-
金銭の信託	10,500,500	-	-	-
未収委託者報酬	21,064,747	-	-	-
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	15,283	5,351,373	347,505	11,696
合計	89,786,871	5,351,373	347,505	11,696

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。

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

第38期(2023年3月31日現在)

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券	-	1,579,691	-	1,579,691
金銭の信託	-	10,400,000	-	10,400,000
投資有価証券	1,794,704	10,227,661	-	12,022,365
資産計	1,794,704	22,207,352	-	24,002,056

（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。

第39期(2024年3月31日現在)

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券	-	15,283	-	15,283
金銭の信託	-	10,500,500	-	10,500,500
投資有価証券	2,014,968	11,773,103	-	13,788,071

資産計	2,014,968	22,288,887	-	24,303,855
-----	-----------	------------	---	------------

（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）

1. 子会社株式及び関連会社株式

第38期（2023年3月31日現在）及び第39期（2024年3月31日現在）

関連会社株式（貸借対照表計上額は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38期(2023年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	8,983,713	7,558,314	1,425,399
	小計	8,983,713	7,558,314	1,425,399
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	15,018,343	15,474,760	456,417
	小計	15,018,343	15,474,760	456,417
合計		24,002,056	23,033,074	968,982

（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10,400,000千円、取得原価は10,400,000千円）を含めております。

第39期(2024年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	17,364,277	14,269,984	3,094,293
	小計	17,364,277	14,269,984	3,094,293
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	6,939,577	7,241,136	301,559
	小計	6,939,577	7,241,136	301,559
合計		24,303,855	21,511,121	2,792,733

（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10,500,500千円、取得原価は10,500,000千円）を含めております。

3. 売却したその他有価証券

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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	17,240	-	14,120

債券	-	-	-
その他	1,551,405	387,113	1,708
合計	1,568,645	387,113	15,828

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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	3,750,272	464,927	57,011
合計	3,750,272	464,927	57,011

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。

当事業年度において、有価証券について31,651千円（その他有価証券のその他31,651千円）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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,723,521 千円	3,582,778 千円
勤務費用	196,190	182,947
利息費用	25,925	39,626
数理計算上の差異の発生額	186,130	79,379
退職給付の支払額	176,727	300,286
過去勤務費用の発生額	-	-
企業結合による影響額	-	226,499
退職給付債務の期末残高	3,582,778	3,652,185

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
年金資産の期首残高	2,583,927 千円	2,425,752 千円
期待運用収益	46,453	43,626
数理計算上の差異の発生額	103,934	227,699
事業主からの拠出額	-	-
退職給付の支払額	100,694	204,536
年金資産の期末残高	2,425,752	2,492,542

(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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
積立型制度の 退職給付債務	2,468,195 千円	2,250,427 千円
年金資産	2,425,752	2,492,542
	42,442	242,114
非積立型制度の退職給付債務	1,114,583	1,401,758
未積立退職給付債務	1,157,025	1,159,643
未認識数理計算上の差異	281,343	558,841
未認識過去勤務費用	223,319	157,957
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,215,049	1,560,527
退職給付引当金	1,333,882	1,608,101
前払年金費用	118,832	47,573
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,215,049	1,560,527

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	196,190 千円	182,947 千円
利息費用	25,925	39,626
期待運用収益	46,453	43,626
数理計算上の差異の 費用処理額	6,532	29,581
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
退職給付制度の統合に係る 調整額	-	34,505
その他	1,600	2,196
確定給付制度に係る 退職給付費用	236,091	251,429

(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及び退職金です。「退職給付制度の統合に係る調整額」は企業結合関連費用の一部として特別損失に計上しております。

(5)年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
債券	63.6 %	62.0 %
株式	34.2	35.9
その他	2.2	2.1
合計	100	100

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
--	------------------------	------------------------

割引率	0.066～1.13%	1.39～1.41%
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152,084千円、当事業年度164,524千円であります。

（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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	499,742千円	389,750千円
投資有価証券評価損	47,876	30,021
未払事業税	169,997	126,161
賞与引当金	260,221	362,002
役員賞与引当金	29,828	33,564
役員退職慰労引当金	23,169	9,218
退職給付引当金	408,434	492,400
減価償却超過額	227,100	199,986
差入保証金	52,869	-
資産除去債務	-	16,900
時効後支払損引当金	77,865	76,657
その他	212,315	227,182
繰延税金資産 小計	2,009,420	1,963,847
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	2,009,420	1,963,847
繰延税金負債		
前払年金費用	36,386	14,567
その他有価証券評価差額金	296,702	855,135
その他	1,199	5,308
繰延税金負債 合計	334,288	875,010
繰延税金資産の純額	1,675,132	1,088,836

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38期（2023年3月31日現在）及び第39期（2024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。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、グループ通算制度を適用しております。また、「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2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（企業結合等関係）

当社は、2023年7月31日開催の取締役会において、三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社(旧商号：MU投資顧問株式会社)と吸収分割契約を締結することを決議し、同日、吸収分割の効力発生日を2023年10月1日とする吸収分割契約を締結いたしました。本吸収分割契約に基づき、当社と三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社は、2023年10月1日付で吸収分割を実施いたしました。

なお、2023年10月1日付で当社は「三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社」へ商号変更しました。

1. 取引の概要

(1) 被取得企業の名称及びその事業の内容

被取得企業の名称 三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社

事業の内容 投資顧問業、私募投資信託の設定・運用等

(2) 企業結合日

2023年10月1日

(3) 企業結合の法的形式

当社と兄弟会社である三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする無対価吸収分割

(4) 結合後企業の名称

分割会社：三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社

承継会社：三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

(5) 企業結合を行った主な理由

法人投資家の運用ニーズが拡大しており、両社で取り組みを強化している法人投資家ビジネスにかかる運用・営業等の関連機能を三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社に統合することで、リソースやノウハウの集約を通じた運用機能等の強化を図ってまいります。

2. 会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準（企業会計基準第21号2019年1月16日）」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針（企業会計基準適用指針第10号2019年1月16日）」に基づき、共通支配下の取引として処理いたしました。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

建物の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を取得から15年と見積り、割引率は1.1%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3. 当該資産除去債務の総額の増減

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
期首残高	-	-
有形固定資産の取得に伴う増加	-	1,420,750千円
時の経過による調整額	-	7,835千円
期末残高	-	1,428,586千円

（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38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）及び第39期（自 2023年4月1日 至 2024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38期（自2022年4月1日 至 2023年3月31日）及び第39期（自 2023年4月1日 至 2024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38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (注5)	科目	期末残高 (注5)
親会社	㈱三菱UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税等	連結納税等に 伴う支払 (注1)	3,947,200 千円	その他未払金	77,007 千円
親会社	三菱UFJ 信託銀行㈱	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	4,893,312 千円	未払手数料	790,279 千円
						投資の助言	投資助言料 (注3)	463,416 千円	未払費用	253,093 千円
						役員の兼任				

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (注5)	科目	期末残高 (注5)
親会社	㈱三菱UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	グループ通算制 度	グループ通算 制度に伴う通 算税効果額 (注4)	132,303 千円	その他未払金	105,407 千円
親	三菱UFJ 信託銀行㈱	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,006,309 千円	未払手数料	886,173 千円

会社						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 （注3）	463,831 千円	未払費用 260,800 千円
----	--	--	--	--	--	----------------	---------------	---------------	-----------------------

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注）１．連結納税制度及びグループ通算制度に基づく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．グループ通算制度に基づく通算税効果額であります。

５．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38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (注2)	科目	期末残高 (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 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 (注1)	4,052,979 千円	未払手数料	868,785 千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券(株)	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 (注1)	6,661,991 千円	未払手数料	1,218,051 千円

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (注2)	科目	期末残高 (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 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 (注1)	4,354,007 千円	未払手数料	1,028,586 千円

同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・ スタンレー 証券㈱	東京都 千代田 区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料 の支払 (注1)	7,493,449 千円	未払手数料	1,449,414 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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	415,979.76円	454,898.22円
1株当たり当期純利益金額	48,881.17円	49,804.10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. 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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益金額（千円）	10,342,327	10,537,601
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）	10,342,327	10,537,601
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581	211,581

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

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

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

5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（2024年3月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (2023年9月末現在)	事業の内容
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
農林中央金庫	4,040,198 百万円	金融業務を営んでいます。
東京都信用農業協同組合連合会	133,489 百万円	金融業務を営んでいます。
石川県信用農業協同組合連合会	33,047 百万円	金融業務を営んでいます。
福井県信用農業協同組合連合会	23,373 百万円	金融業務を営んでいます。
兵庫県信用農業協同組合連合会	263,320 百万円	金融業務を営んでいます。
徳島県信用農業協同組合連合会	32,545 百万円	金融業務を営んでいます。
仙台農業協同組合	3,439 百万円	金融業務を営んでいます。
新みやぎ農業協同組合	10,165 百万円	金融業務を営んでいます。
みやぎ仙南農業協同組合	3,696 百万円	金融業務を営んでいます。
秋田しんせい農業協同組合	5,102 百万円	金融業務を営んでいます。
秋田ふるさと農業協同組合	6,552 百万円	金融業務を営んでいます。
福島さくら農業協同組合	8,888 百万円	金融業務を営んでいます。
宇都宮農業協同組合	4,585 百万円	金融業務を営んでいます。
はが野農業協同組合	3,956 百万円	金融業務を営んでいます。
下野農業協同組合	1,982 百万円	金融業務を営んでいます。
塩野谷農業協同組合	3,032 百万円	金融業務を営んでいます。
那須野農業協同組合	3,866 百万円	金融業務を営んでいます。
那須南農業協同組合	1,178 百万円	金融業務を営んでいます。
足利市農業協同組合	2,131 百万円	金融業務を営んでいます。
佐波伊勢崎農業協同組合	2,499 百万円	金融業務を営んでいます。
あさか野農業協同組合	852 百万円	金融業務を営んでいます。
いるま野農業協同組合	5,516 百万円	金融業務を営んでいます。
くまがや農業協同組合	2,700 百万円	金融業務を営んでいます。
南彩農業協同組合	2,894 百万円	金融業務を営んでいます。
さいかつ農業協同組合	1,819 百万円	金融業務を営んでいます。
東京南農業協同組合	673 百万円	金融業務を営んでいます。

町田市農業協同組合	995	百万円	金融業務を営んでいます。
東京中央農業協同組合	1,135	百万円	金融業務を営んでいます。
横浜農業協同組合	11,625	百万円	金融業務を営んでいます。
セレサ川崎農業協同組合	2,484	百万円	金融業務を営んでいます。
よこすか葉山農業協同組合	1,336	百万円	金融業務を営んでいます。
さがみ農業協同組合	5,008	百万円	金融業務を営んでいます。
湘南農業協同組合	3,138	百万円	金融業務を営んでいます。
秦野市農業協同組合	1,622	百万円	金融業務を営んでいます。
かながわ西湘農業協同組合	2,353	百万円	金融業務を営んでいます。
厚木市農業協同組合	2,394	百万円	金融業務を営んでいます。
県央愛川農業協同組合	434	百万円	金融業務を営んでいます。
相模原市農業協同組合	832	百万円	金融業務を営んでいます。
神奈川つくい農業協同組合	746	百万円	金融業務を営んでいます。
信州うえだ農業協同組合	3,960	百万円	金融業務を営んでいます。
信州諏訪農業協同組合	6,169	百万円	金融業務を営んでいます。
上伊那農業協同組合	8,017	百万円	金融業務を営んでいます。
みなみ信州農業協同組合	4,332	百万円	金融業務を営んでいます。
中野市農業協同組合	2,513	百万円	金融業務を営んでいます。
ながの農業協同組合	13,160	百万円	金融業務を営んでいます。
黒部市農業協同組合	1,344	百万円	金融業務を営んでいます。
あおば農業協同組合	3,230	百万円	金融業務を営んでいます。
高岡市農業協同組合	2,757	百万円	金融業務を営んでいます。
小松市農業協同組合	2,100	百万円	金融業務を営んでいます。
金沢中央農業協同組合	1,063	百万円	金融業務を営んでいます。
金沢市農業協同組合	3,081	百万円	金融業務を営んでいます。
ぎふ農業協同組合	7,078	百万円	金融業務を営んでいます。
ハイナン農業協同組合	808	百万円	金融業務を営んでいます。
あいち尾東農業協同組合	1,177	百万円	金融業務を営んでいます。
愛知北農業協同組合	741	百万円	金融業務を営んでいます。
あいち中央農業協同組合	3,605	百万円	金融業務を営んでいます。
鈴鹿農業協同組合	1,587	百万円	金融業務を営んでいます。
伊賀ふるさと農業協同組合	3,989	百万円	金融業務を営んでいます。
越前たけふ農業協同組合	3,106	百万円	金融業務を営んでいます。
兵庫六甲農業協同組合	5,615	百万円	金融業務を営んでいます。
あかし農業協同組合	423	百万円	金融業務を営んでいます。
兵庫南農業協同組合	3,701	百万円	金融業務を営んでいます。
みのり農業協同組合	4,213	百万円	金融業務を営んでいます。
兵庫みらい農業協同組合	3,403	百万円	金融業務を営んでいます。
加古川市南農業協同組合	509	百万円	金融業務を営んでいます。
兵庫西農業協同組合	12,787	百万円	金融業務を営んでいます。
相生市農業協同組合	103	百万円	金融業務を営んでいます。
丹波ひかみ農業協同組合	2,128	百万円	金融業務を営んでいます。
丹波ささやま農業協同組合	2,019	百万円	金融業務を営んでいます。
淡路日の出農業協同組合	1,807	百万円	金融業務を営んでいます。
あわじ島農業協同組合	3,878	百万円	金融業務を営んでいます。
奈良県農業協同組合	9,248	百万円	金融業務を営んでいます。
晴れの国岡山農業協同組合	25,416	百万円	金融業務を営んでいます。
山口県農業協同組合	16,206	百万円	金融業務を営んでいます。
徳島市農業協同組合	4,128	百万円	金融業務を営んでいます。
長崎西彼農業協同組合	3,214	百万円	金融業務を営んでいます。
長崎県央農業協同組合	5,726	百万円	金融業務を営んでいます。

農業協同組合連合会および農業協同組合の資本金の額は「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】

該当ありません。（2024年6月末現在）

（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株

比率が３％以上のものを記載しています。

第３【その他】

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

独立監査人の監査報告書

2024年6月7日

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

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 山田 信之

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 田嶋 大士

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アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39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アセットマネジメント株式会社の2024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するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用し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

2024年8月28日

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan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 久保 直毅
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」に掲げられているラップ向けアクティブアロケーションファンドの2023年6月27日から2024年6月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ラップ向けアクティブアロケーションファンドの2024年6月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱ＵＦＪアセットマネジメント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アセットマネジメント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。