

**【表紙】**

|            |                               |
|------------|-------------------------------|
| 【提出書類】     | 有価証券報告書                       |
| 【提出先】      | 関東財務局長殿                       |
| 【提出日】      | 2026年9月24日提出                  |
| 【計算期間】     | 第5期(自 2025年6月26日至 2026年6月25日) |
| 【ファンド名】    | ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）      |
| 【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 川上 豊                    |
| 【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                          |
| 【連絡場所】     | 東京都港区東新橋一丁目9番1号               |
| 【電話番号】     | 03-4223-3037                  |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。                   |

## 第一部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、値上がり益の獲得および利子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、一般社団法人資産運用業協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

商品分類表

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

属性区分表

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

※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、一般社団法人資産運用業協会のホームページ（<https://www.imaj.or.jp/>）でご覧いただけます。

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

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

### 商品分類の定義

|         |                       |                                                                                                            |
|---------|-----------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 単位型・追加型 | 単位型                   | 当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。                                                         |
|         | 追加型                   | 一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。                                                      |
| 投資対象地域  | 国内                    | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                                     |
|         | 海外                    | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                                     |
|         | 内外                    | 信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                                        |
| 投資対象資産  | 株式                    | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                                        |
|         | 債券                    | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                                        |
|         | 不動産投信（リート）            | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                               |
|         | その他資産                 | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                        |
|         | 資産複合                  | 信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                       |
| 独立区分    | MMF（マネー・マネージメント・ファンド） | 一般社団法人資産運用業協会が定める「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）    | 一般社団法人資産運用業協会が定める「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資産運用業協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

### 属性区分の定義

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

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

|          |                   |                                                                                                                          |
|----------|-------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|          | エマージング            | 信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                     |
| 投資形態     | ファミリーファンド         | 信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。                                                         |
|          | ファンド・オブ・ファンズ      | 一般社団法人資産運用業協会が定める「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資産運用業協会が定める「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および公社債等を実質的な主要投資対象とし、値上がり利益の獲得および利子収益の確保をめざします。

## ファンドの特色

特色

1

日本を含む先進国の株式および公社債等に投資を行います。

※実際の運用は各マザーファンドへの投資を通じて行います。

### <投資対象とするマザーファンドと運用目標>

| 各マザーファンド               | 主要投資対象               | 運用目標                                                 |
|------------------------|----------------------|------------------------------------------------------|
| TOPIXマザーファンド           | 日本の株式                | 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)と連動する投資成果をめざして運用を行います。            |
| 外国株式インデックスマザーファンド      | 先進国の株式<br>(日本の株式を除く) | MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。   |
| 日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ  | 日本の国債                | NOMURA-BPI国債 超長期(11-)に連動する投資成果をめざして運用を行います。          |
| 国内債券インデックスマザーファンド      | 国内債券                 | NOMURA-BPI総合に連動する投資成果をめざして運用を行います。                   |
| 日本短期債券マザーファンド          | 日本の公社債・<br>金融商品      | 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。 |
| 外国債券インデックスマザーファンド      | 先進国債券<br>(国内債券を除く)   | FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。    |
| ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド* | 先進国債券<br>(国内債券を除く)   | FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。 |
| 新マネー・マーケット・マザーファンド     | 日本の<br>短期公社債等        | 主として安定した利子収益の確保をめざして運用を行います。                         |

\*為替ヘッジを行うマザーファンドです。

1 上記の他、短期金融資産に投資することがあります。

特色

2

三菱UFJ信託銀行からの投資助言・情報提供に基づき、投資環境等に応じて、各資産の組入比率を決定し運用を行います。

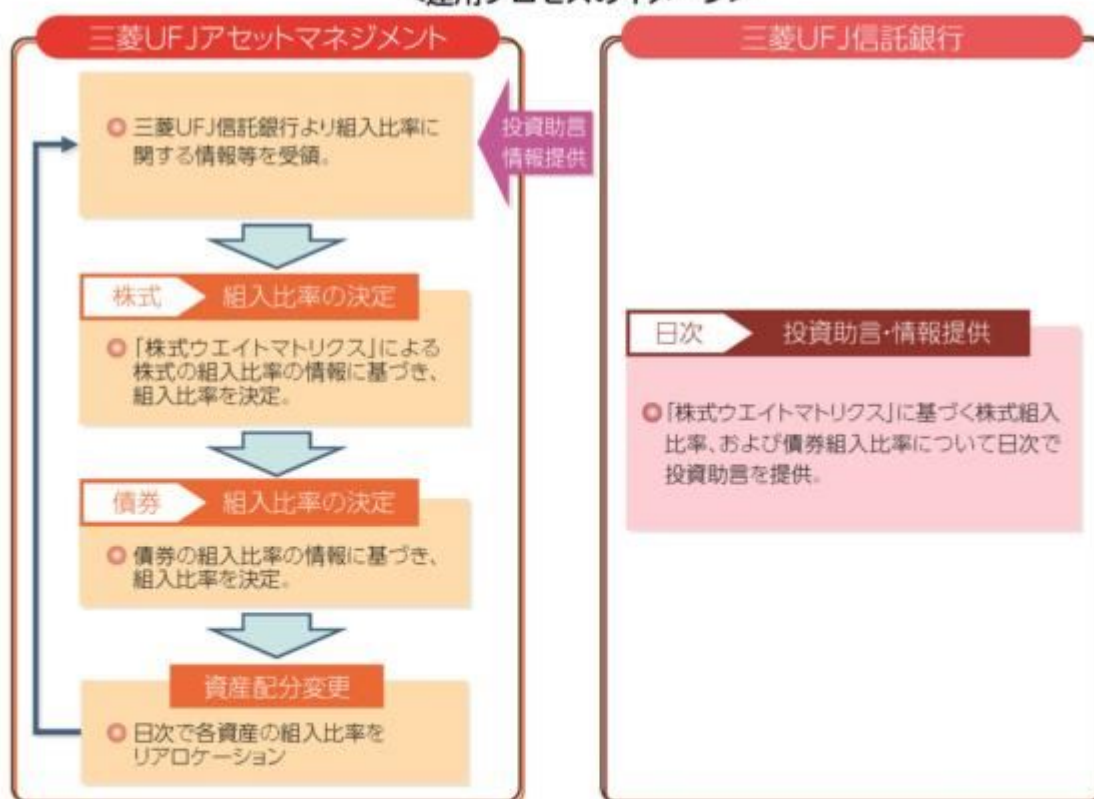
## ■運用方法・運用プロセス

## &lt;組入比率変更のイメージ&gt;



❗ 上記はファンドの組入比率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。

## &lt;運用プロセスのイメージ&gt;



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

❗ 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。

- 日本株式と先進国株式(日本株式を除く)の組入比率の決定にあたっては、投資環境と株式部分の収益寄与から比率を決定する「株式ウェイトマトリクス」を活用します。
  - ・「投資環境」は、株式市場や景気 directional、信用リスクに対する市場の反応の大きさ、株式市場の値動きの大きさ等を測る複数の指標を用いて計算される相場局面判断インデックスをもとに判断します。
  - 「投資環境」を判断する各指標については、今後変更になる場合があります。
  - ・「株式部分の収益寄与」は、過去の株式の収益率に組入比率を勘案して算出します。

#### ＜株式ウェイトマトリクスのイメージ＞



❗ 上記の株式ウェイトマトリクスはイメージであり、実際のものとは異なります。なお、日本株式と先進国株式（日本株式を除く）の組入比率の決定に用いられる株式ウェイトマトリクスの設計は異なります。

- 公社債等の組入比率については、株式部分の組入比率を決定した後、原則として相場局面判断および投資環境等に基づき決定します。

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

### 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。

- 投資対象とするマザーファンドによっては、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。
- ❗ 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。

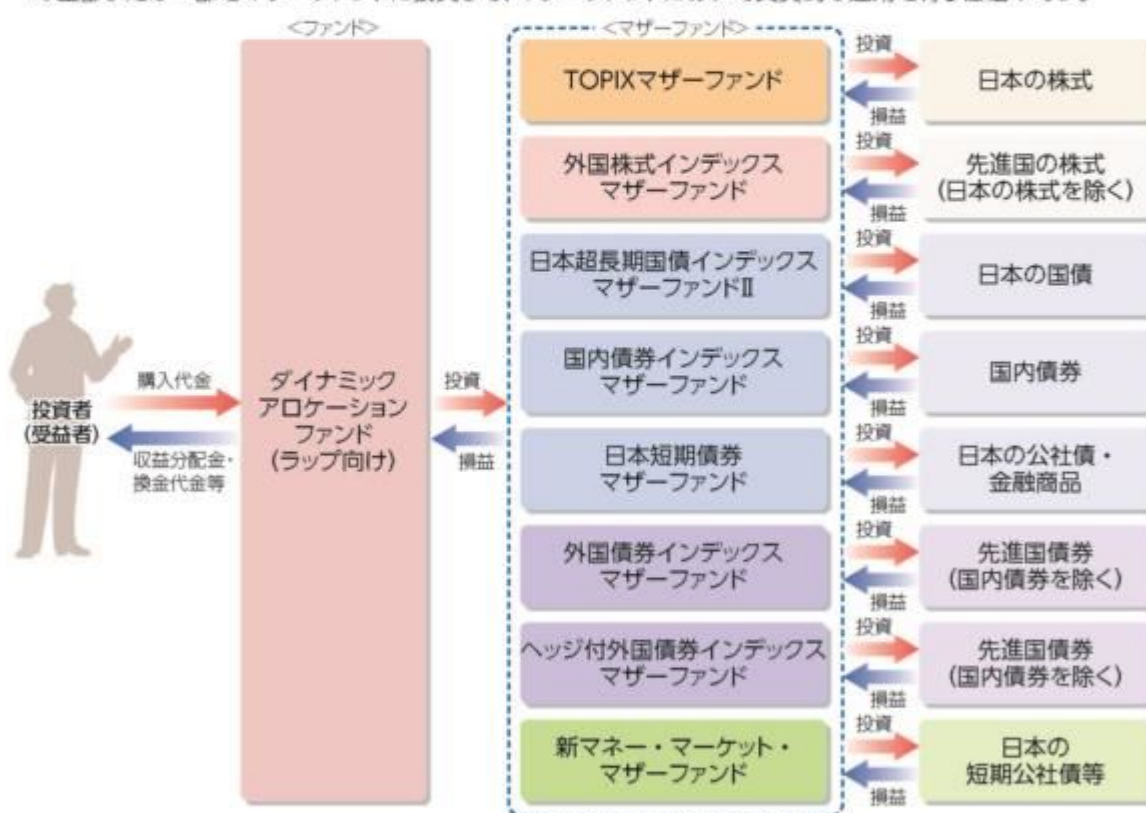
年1回の決算時(6月25日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。

- 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。

ファミリーファンド方式により、運用を行います。

ファミリーファンド方式とは、受益者から投資された資金をまとめた投資信託をベビーファンドとし、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資して、マザーファンドにおいて実質的な運用を行う仕組みです。



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



## 指数について

・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)(以下「TOPIX」といいます。 )とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。 )の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。

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

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

・NOMURA-BPI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。

・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】

|             |                                                                                                     |
|-------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2021年11月30日 | 設定日、信託契約締結、運用開始                                                                                     |
| 2022年10月6日  | 主要投資対象変更の重大な約款変更の適用<br>ファンドの投資対象に「国内債券インデックスマザーファンド」、「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」を追加 |
| 2023年10月30日 | 主要投資対象変更の重大な約款変更の適用<br>ファンドの投資対象に「日本短期債券マザーファンド」を追加                                                 |

## (3) 【ファンドの仕組み】

### ①委託会社およびファンドの関係法人の役割

|                                                            |                                        |
|------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| 投資家（受益者）                                                   |                                        |
| お申込金↓↑収益分配金、解約代金等                                          |                                        |
| 販売会社                                                       | 募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。 |
| お申込金↓↑収益分配金、解約代金等                                          |                                        |
| 受託会社（受託者）<br>三菱UFJ信託銀行株式会社<br>(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）<br>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。

投資↓↑損益

マザーファンド

投資↓↑損益

有価証券等

信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。

## ②委託会社と関係法人との契約の概要

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

## ③委託会社の概況（2026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変更

### ・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一丁目4番5号 | 211,581株 | 100.0% |

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、日本短期債券マザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券および新マネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、日本短期債券マザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券および新マネー・マーケット・マザーファンド受益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および公社債等に投資を行います。

株式の実質組入比率は、原則として相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。

公社債等の実質組入比率については、株式部分の組入比率を決定した後、原則として相場局面判断および投資環境等に基づき決定します。

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】

### ①投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ａ．有価証券先物取引等

ｂ．スワップ取引

ｃ．金利先渡取引および為替先渡取引

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

### ②有価証券の指図範囲

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

１．株券または新株引受権証書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

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

１１．コマーシャル・ペーパー

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

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

14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
  15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16. において同じ。）で16. で定めるものの以外のもの
  16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16. において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
  17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
  19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  21. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
  22. 外国の者に対する権利で21. の有価証券の性質を有するもの
  23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- なお、1. の証券または証書ならびに13. および19. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から6. までの証券ならびに16. の証券ならびに13. および19. の証券または証書のうち2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14. および15. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

### ③金融商品の指図範囲

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5. の権利の性質を有するもの
7. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、1. から6. に該当するものを除きます。）
8. 外国の者に対する権利で7. の権利の性質を有するもの
9. 合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第2条第2項第3号で定めるものをいいます。）
10. 外国法人の社員権で9. の権利の性質を有するもの
11. 投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利（金融商品取引法第2条第2項第5号で定めるものをいいます。）
12. 外国の法令に基づく権利であって、11. の権利に類するもの

### ④その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

## <マザーファンドの概要>

### TOPIXマザーファンド

#### （基本方針）

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

#### （運用方法）

##### ①投資対象

東京証券取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

##### ②投資態度

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

対象インデックスからカイ離するリスクと運用コストの極小化を目的として、定量的なリスク

管理に基づいたポートフォリオ構築と適切な売買執行を行います。

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

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

（投資制限）

- ①株式への投資割合に制限を設けません。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤外貨建資産への投資は行いません。
- ⑥有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑦スワップ取引を行うことができます。
- ⑧デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国株式インデックスマザーファンド

（基本方針）

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

（運用方法）

①投資対象

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

②投資態度

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

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

・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

（投資制限）

- ①株式への投資割合に制限を設けません。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
- ⑥有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑦スワップ取引を行うことができます。
- ⑧外国為替予約取引を行うことができます。
- ⑨デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

⑩外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

## 日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ

### （基本方針）

この投資信託は、NOMURA－BPI国債 超長期（11-）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

### （運用方法）

#### ①投資対象

わが国の国債を主要投資対象とします。

#### ②投資態度

主としてわが国の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。

### （投資制限）

①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

③投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑦外貨建資産への投資は行いません。

⑧有価証券先物取引等を行うことができます。

⑨スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

## 国内債券インデックスマザーファンド

### （基本方針）

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

### （運用方法）

#### ①投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### ②投資態度

主としてわが国の公社債に投資を行います。

公社債の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

### （投資制限）

①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

③投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑦外貨建資産への投資は行いません。

- ⑧有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑨スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

## 日本短期債券マザーファンド

### （基本方針）

この投資信託は、信託財産の安定的な成長をめざして運用を行います。

### （運用方法）

#### ①投資対象

わが国の公社債・金融商品を主要投資対象とします。

#### ②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。

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

### （投資制限）

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

## 外国債券インデックスマザーファンド

### （基本方針）

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

### （運用方法）

#### ①投資対象

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を主要投資対象とします。

#### ②投資態度

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

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

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

- ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

### （投資制限）

- ①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

- ⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
- ⑧有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑨スワップ取引を行うことができます。
- ⑩外国為替予約取引を行うことができます。
- ⑪デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- ⑫外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

#### ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

##### （基本方針）

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

##### （運用方法）

###### ①投資対象

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

###### ②投資態度

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

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

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

##### （投資制限）

- ①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
- ⑧有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑨スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑩金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑪外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑫デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを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。

#### 新マネー・マーケット・マザーファンド

##### （基本方針）

この投資信託は、主として安定した利子収益の確保をめざして運用を行います。

##### （運用方法）

###### ①投資対象

わが国の公社債等を主要投資対象とします。

## ②投資態度

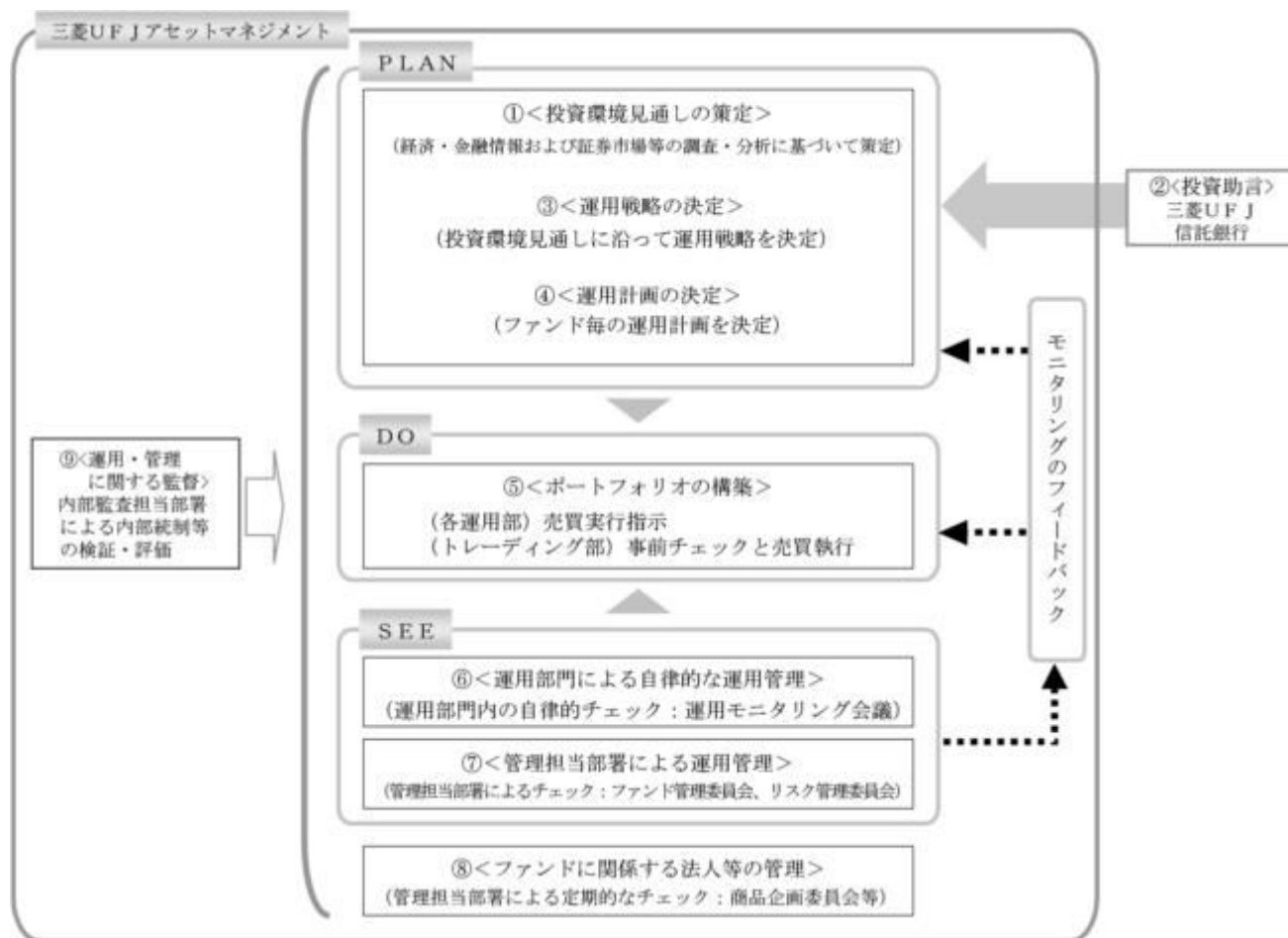
主としてわが国の短期公社債等に投資を行います。

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。

## (投資制限)

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

## (3) 【運用体制】



## ①投資環境見通しの策定

各運用部は国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

## ②投資助言

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

## ③運用戦略の決定

①で策定された投資環境見通し、および②の投資助言に沿って各運用部は運用戦略を決定します。

## ④運用計画の決定

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

## ⑤ポートフォリオの構築

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

**⑥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、運用モニタリング会議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。

**⑦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。

**⑧ファンドに関係する法人等の管理**

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

**⑨運用・管理に関する監督**

内部監査担当部署（10名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

「運用担当者に係る事項」 [https://www.am.mufig.jp/investment\\_policy/fm.html](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。

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

**（５）【投資制限】****<信託約款に定められた投資制限>****①新株引受権証券および新株予約権証券**

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

**②投資信託証券**

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

- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- ③同一銘柄の転換社債等
- a. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債（新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- ④スワップ取引
- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- ⑤信用取引
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- b. a. の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券
  4. 売出しにより取得する株券
  5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（③に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
  6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（5. に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券
- ⑥外国為替予約取引
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. a. の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- c. b. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- d. b. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

## ⑦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。

## ⑧資金の借入れ

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

## ⑨投資する株式等の範囲

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

## ⑩金利先渡取引および為替先渡取引

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

## ⑪有価証券の貸付

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

## ⑫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。

⑬デリバティブ取引等

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

⑭信用リスクの分散規制

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

＜その他法令等に定められた投資制限＞

・同一の法人の発行する株式への投資制限

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

### 3【投資リスク】

#### （1）投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

（主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。）

**価格変動  
リスク**

・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。

**為替変動  
リスク**

投資対象とするマザーファンドによっては、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、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における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。
- ・ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・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。

**（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。

①コンプライアンス担当部署

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

②リスク管理担当部署

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

③内部監査担当部署

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

＊組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

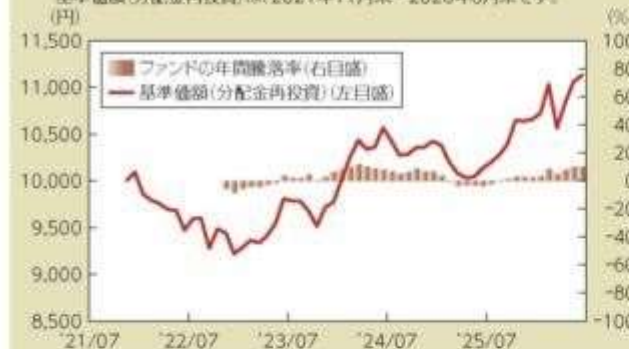
## ■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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

### ● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

ファンドの年間騰落率は、2022年11月～2026年6月です。

基準価額(分配金再投資)は、2021年11月末～2026年6月末です。



### ● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2021年7月末～2026年6月末)

ファンドの年間騰落率は、2022年11月～2026年6月です。



(注) 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

●年間騰落率は、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。

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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

## 代表的な資産クラスの指数について

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

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

ありません。

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

## （２）【換金（解約）手数料】

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0.176%（税抜0.160%）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 | 0.105% | 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 | 0.030% | 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 | 0.025% | ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等         |

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

## （４）【その他の手数料等】

・信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外国株式インデックスマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンドの解約に伴う信託財産留保額、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

・信託財産に係る監査費用（消費税等相当額を含みます。）は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。

・信託財産（投資している投資信託を含みます。）の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等（消費税等相当額を含みます。）、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

### ①個人の受益者に対する課税

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

#### １．収益分配金の課税

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

原則として、20.315%（所得税15.315%、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15.315%、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15.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

### ②法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

### ◇個別元本について

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

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

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

### ◇収益分配金について

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

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

※上記は2026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。)(2025年6月26日～2026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 |
|-----------|------------|-----------|
| 0.19%     | 0.18%      | 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】

【ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）】

(1)【投資状況】

2026年 6月30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   | 36,990,703,764 | 99.97   |
| コール・ローン、その他資産<br>(負債控除後) | —    | 12,895,970     | 0.03    |
| 純資産総額                    |      | 37,003,599,734 | 100.00  |

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

(2)【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

2026年 6月30日現在

| 国／地域 | 種類        | 銘柄名                   | 数量             | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(％) |
|------|-----------|-----------------------|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本   | 親投資信託受益証券 | ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド | 10,457,746,907 | 1.1013          | 11,517,116,669  | 1.1022          | 11,526,528,640  | 31.15           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 国内債券インデックスマザーファンド     | 12,638,639,373 | 0.8269          | 10,452,154,761  | 0.8236          | 10,409,183,387  | 28.13           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | TOPIXマザーファンド          | 1,437,842,350  | 5.1694          | 7,432,782,244   | 5.1465          | 7,399,855,654   | 20.00           |
| 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     | 613,988,598    | 10.4874         | 6,439,144,023   | 10.6315         | 6,527,619,779   | 17.64           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 日本短期債券マザーファンド         | 998,597,382    | 1.1286          | 1,127,017,005   | 1.1291          | 1,127,516,304   | 3.05            |

(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

2026年 6月30日現在

| 種類        | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 99.97   |
| 合計        | 99.97   |

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

## ②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## ③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## ①【純資産の推移】

下記計算期間末日および2026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<br>(1万口当たりの純資産価額) |        |
|------------------------|-----------------|-----------------|------------------------|--------|
|                        | (分配落)           | (分配付)           | (分配落)                  | (分配付)  |
| 第1計算期間末日 (2022年 6月27日) | 136,166,805,951 | 136,166,805,951 | 9,479                  | 9,479  |
| 第2計算期間末日 (2023年 6月26日) | 106,790,857,557 | 106,790,857,557 | 9,759                  | 9,759  |
| 第3計算期間末日 (2024年 6月25日) | 82,949,125,419  | 82,949,125,419  | 10,537                 | 10,537 |
| 第4計算期間末日 (2025年 6月25日) | 57,323,433,333  | 57,323,433,333  | 10,101                 | 10,101 |
| 第5計算期間末日 (2026年 6月25日) | 37,471,123,065  | 37,471,123,065  | 11,123                 | 11,123 |
| 2025年 6月末日             | 57,305,344,378  | —               | 10,132                 | —      |
| 7月末日                   | 55,891,853,150  | —               | 10,194                 | —      |
| 8月末日                   | 54,706,019,109  | —               | 10,273                 | —      |
| 9月末日                   | 53,564,501,235  | —               | 10,387                 | —      |
| 10月末日                  | 56,188,072,604  | —               | 10,645                 | —      |
| 11月末日                  | 54,501,416,186  | —               | 10,638                 | —      |
| 12月末日                  | 52,801,374,705  | —               | 10,656                 | —      |
| 2026年 1月末日             | 50,951,461,516  | —               | 10,720                 | —      |
| 2月末日                   | 51,017,078,256  | —               | 11,031                 | —      |
| 3月末日                   | 47,266,201,919  | —               | 10,563                 | —      |
| 4月末日                   | 43,505,247,700  | —               | 10,836                 | —      |
| 5月末日                   | 40,324,038,362  | —               | 11,056                 | —      |
| 6月末日                   | 37,003,599,734  | —               | 11,130                 | —      |

## ②【分配の推移】

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

## ③【収益率の推移】

|        | 収益率 (%) |
|--------|---------|
| 第1計算期間 | △5.21   |

|        |       |
|--------|-------|
| 第2計算期間 | 2.95  |
| 第3計算期間 | 7.97  |
| 第4計算期間 | △4.13 |
| 第5計算期間 | 10.11 |

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

（４）【設定及び解約の実績】

|        |                 |                |                 |
|--------|-----------------|----------------|-----------------|
|        | 設定口数            | 解約口数           | 発行済口数           |
| 第1計算期間 | 182,050,778,220 | 38,393,864,258 | 143,656,913,962 |
| 第2計算期間 | 59,952,533,967  | 94,184,085,425 | 109,425,362,504 |
| 第3計算期間 | 286,808,020     | 30,991,712,360 | 78,720,458,164  |
| 第4計算期間 | 1,096,494,669   | 23,065,941,249 | 56,751,011,584  |
| 第5計算期間 | 2,880,868,024   | 25,944,118,512 | 33,687,761,096  |

（参考）

TOPIXマザーファンド

投資状況

2026年 6月30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   | 2,911,562,086,090 | 99.52   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 14,186,281,731    | 0.48    |
| 純資産総額                    |      | 2,925,748,367,821 | 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

2026年 6月30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   | 9,407,050,000 | 0.32    |

（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

2026年 6月30日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名               | 業種    | 数量         | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|----|-------------------|-------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本   | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業   | 32,420,700 | 2,735.74        | 88,694,885,872  | 3,207.00        | 103,973,184,900 | 3.55            |
| 日本   | 株式 | 東京エレクトロン          | 電気機器  | 1,095,900  | 41,177.84       | 45,126,800,518  | 77,150.00       | 84,548,685,000  | 2.89            |
| 日本   | 株式 | トヨタ自動車            | 輸送用機器 | 27,738,900 | 3,313.35        | 91,908,755,117  | 2,725.00        | 75,588,502,500  | 2.58            |

|    |    |                 |        |             |           |                |           |                |      |
|----|----|-----------------|--------|-------------|-----------|----------------|-----------|----------------|------|
| 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業    | 11,203,000  | 5,344.18  | 59,870,852,336 | 6,346.00  | 71,094,238,000 | 2.43 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ      | 情報・通信業 | 10,031,000  | 3,947.18  | 39,594,234,336 | 5,963.00  | 59,814,853,000 | 2.04 |
| 日本 | 株式 | 日立製作所           | 電気機器   | 13,275,400  | 4,871.34  | 64,669,017,157 | 4,471.00  | 59,354,313,400 | 2.03 |
| 日本 | 株式 | ソニーグループ         | 電気機器   | 17,460,300  | 3,271.36  | 57,119,003,978 | 3,280.00  | 57,269,784,000 | 1.96 |
| 日本 | 株式 | 村田製作所           | 電気機器   | 4,979,600   | 3,898.98  | 19,415,392,117 | 11,395.00 | 56,742,542,000 | 1.94 |
| 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ  | 銀行業    | 7,150,100   | 6,460.28  | 46,191,702,947 | 7,743.00  | 55,363,224,300 | 1.89 |
| 日本 | 株式 | アドバンテスト         | 電気機器   | 1,571,200   | 23,645.59 | 37,151,962,397 | 32,340.00 | 50,812,608,000 | 1.74 |
| 日本 | 株式 | 三菱商事            | 卸売業    | 10,136,600  | 5,522.40  | 55,978,451,427 | 4,347.00  | 44,063,800,200 | 1.51 |
| 日本 | 株式 | リクルートホールディングス   | サービス業  | 3,735,300   | 6,595.17  | 24,634,949,946 | 11,330.00 | 42,320,949,000 | 1.45 |
| 日本 | 株式 | キーエンス           | 電気機器   | 522,000     | 58,957.19 | 30,775,653,535 | 81,060.00 | 42,313,320,000 | 1.45 |
| 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス    | 保険業    | 5,283,400   | 7,804.98  | 41,236,853,231 | 7,202.00  | 38,051,046,800 | 1.30 |
| 日本 | 株式 | 三菱重工業           | 機械     | 9,874,600   | 4,514.20  | 44,576,008,471 | 3,666.00  | 36,200,283,600 | 1.24 |
| 日本 | 株式 | 三井物産            | 卸売業    | 7,825,800   | 6,199.29  | 48,514,480,168 | 4,497.00  | 35,192,622,600 | 1.20 |
| 日本 | 株式 | 伊藤忠商事           | 卸売業    | 18,555,700  | 2,066.69  | 38,348,978,332 | 1,854.00  | 34,402,267,800 | 1.18 |
| 日本 | 株式 | 三菱電機            | 電気機器   | 5,772,900   | 5,559.30  | 32,093,293,760 | 5,876.00  | 33,921,560,400 | 1.16 |
| 日本 | 株式 | 信越化学工業          | 化学     | 4,648,000   | 6,340.97  | 29,472,842,349 | 7,008.00  | 32,573,184,000 | 1.11 |
| 日本 | 株式 | ファーストリテイリング     | 小売業    | 372,600     | 63,270.82 | 23,574,707,614 | 82,810.00 | 30,855,006,000 | 1.05 |
| 日本 | 株式 | キオクシアホールディングス   | 電気機器   | 320,400     | 24,800.80 | 7,946,178,870  | 89,680.00 | 28,733,472,000 | 0.98 |
| 日本 | 株式 | パナソニックホールディングス  | 電気機器   | 6,226,700   | 2,688.36  | 16,739,656,595 | 4,502.00  | 28,032,603,400 | 0.96 |
| 日本 | 株式 | フジクラ            | 非鉄金属   | 4,156,700   | 4,630.09  | 19,245,912,443 | 6,238.00  | 25,929,494,600 | 0.89 |
| 日本 | 株式 | HOYA            | 精密機器   | 980,100     | 28,305.02 | 27,741,752,134 | 25,950.00 | 25,433,595,000 | 0.87 |
| 日本 | 株式 | ルネサスエレクトロニクス    | 電気機器   | 5,110,200   | 2,509.73  | 12,825,263,159 | 4,807.00  | 24,564,731,400 | 0.84 |
| 日本 | 株式 | 武田薬品工業          | 医薬品    | 4,657,600   | 5,779.31  | 26,917,748,243 | 5,155.00  | 24,009,928,000 | 0.82 |
| 日本 | 株式 | 任天堂             | その他製品  | 3,265,400   | 8,886.84  | 29,019,090,903 | 6,815.00  | 22,253,701,000 | 0.76 |
| 日本 | 株式 | 住友電気工業          | 非鉄金属   | 7,436,300   | 2,559.89  | 19,036,151,451 | 2,927.00  | 21,766,050,100 | 0.74 |
| 日本 | 株式 | N T T           | 情報・通信業 | 143,695,200 | 156.98    | 22,558,494,749 | 145.00    | 20,835,804,000 | 0.71 |
| 日本 | 株式 | ディスコ            | 機械     | 254,000     | 68,137.59 | 17,306,949,332 | 81,260.00 | 20,640,040,000 | 0.71 |

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

## b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2026年 6月30日現在

| 種類 | 業種       | 投資比率（％） |
|----|----------|---------|
| 株式 | 水産・農林業   | 0.07    |
|    | 鉱業       | 0.32    |
|    | 建設業      | 2.15    |
|    | 食料品      | 2.68    |
|    | 繊維製品     | 0.30    |
|    | パルプ・紙    | 0.12    |
|    | 化学       | 4.74    |
|    | 医薬品      | 3.15    |
|    | 石油・石炭製品  | 0.44    |
|    | ゴム製品     | 0.52    |
|    | ガラス・土石製品 | 0.90    |

|            |       |
|------------|-------|
| 鉄鋼         | 0.62  |
| 非鉄金属       | 2.85  |
| 金属製品       | 0.50  |
| 機械         | 6.16  |
| 電気機器       | 23.00 |
| 輸送用機器      | 4.83  |
| 精密機器       | 1.83  |
| その他製品      | 1.79  |
| 電気・ガス業     | 1.17  |
| 陸運業        | 1.78  |
| 海運業        | 0.47  |
| 空運業        | 0.26  |
| 倉庫・運輸関連業   | 0.13  |
| 情報・通信業     | 6.11  |
| 卸売業        | 6.90  |
| 小売業        | 3.89  |
| 銀行業        | 11.42 |
| 証券、商品先物取引業 | 0.89  |
| 保険業        | 3.29  |
| その他金融業     | 1.20  |
| 不動産業       | 1.65  |
| サービス業      | 3.41  |
| 小計         | 99.52 |
| 合計         | 99.52 |

（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

2026年 6月30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 26年09月限 | 買建 | 235 | 円  | 9,375,736,425 | 9,407,050,000 | 0.32    |

（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

2026年 6月30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 | 11,866,714,189,480 | 74.92   |
|       | イギリス | 556,464,892,484    | 3.51    |

|                          |          |                    |        |
|--------------------------|----------|--------------------|--------|
|                          | カナダ      | 555,353,300,264    | 3.51   |
|                          | スイス      | 390,040,759,955    | 2.46   |
|                          | フランス     | 352,192,594,504    | 2.22   |
|                          | ドイツ      | 346,904,845,679    | 2.19   |
|                          | オランダ     | 288,364,450,313    | 1.82   |
|                          | オーストラリア  | 248,083,662,727    | 1.57   |
|                          | スペイン     | 154,613,597,189    | 0.98   |
|                          | スウェーデン   | 121,649,160,346    | 0.77   |
|                          | イタリア     | 119,591,262,955    | 0.76   |
|                          | デンマーク    | 67,873,964,508     | 0.43   |
|                          | 香港       | 63,928,155,367     | 0.40   |
|                          | シンガポール   | 56,164,790,855     | 0.35   |
|                          | フィンランド   | 48,381,845,097     | 0.31   |
|                          | イスラエル    | 36,056,760,882     | 0.23   |
|                          | ベルギー     | 35,658,656,211     | 0.23   |
|                          | ノルウェー    | 22,962,504,702     | 0.14   |
|                          | アイルランド   | 16,084,283,461     | 0.10   |
|                          | オーストリア   | 14,081,902,063     | 0.09   |
|                          | ルクセンブルク  | 8,814,930,430      | 0.06   |
|                          | ポルトガル    | 7,366,293,946      | 0.05   |
|                          | ニュージーランド | 7,031,977,072      | 0.04   |
|                          | バミューダ    | 1,954,783,373      | 0.01   |
|                          | ジャージー    | 482,605,062        | 0.00   |
|                          | 小計       | 15,386,816,168,925 | 97.14  |
| 投資証券                     | アメリカ     | 209,192,983,517    | 1.32   |
|                          | オーストラリア  | 13,510,918,995     | 0.09   |
|                          | フランス     | 5,109,890,471      | 0.03   |
|                          | シンガポール   | 3,796,559,063      | 0.02   |
|                          | イギリス     | 3,722,006,070      | 0.02   |
|                          | 香港       | 2,191,041,787      | 0.01   |
|                          | 小計       | 237,523,399,903    | 1.50   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —        | 214,828,276,659    | 1.36   |
| 純資産総額                    |          | 15,839,167,845,487 | 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

2026年 6月30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 | 184,339,093,181 | 1.16    |
|          | 買建 | カナダ  | 8,627,018,664   | 0.05    |
|          | 買建 | ドイツ  | 26,169,670,296  | 0.17    |

|  |    |         |               |      |
|--|----|---------|---------------|------|
|  | 買建 | オーストラリア | 5,929,698,478 | 0.04 |
|  | 買建 | イギリス    | 8,630,523,156 | 0.05 |
|  | 買建 | スイス     | 5,798,703,627 | 0.04 |

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

2026年 6月30日現在

| 国／<br>地域 | 種類 | 銘柄名                         | 業種                                         | 数量         | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|----|-----------------------------|--------------------------------------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| アメリカ     | 株式 | NVIDIA CORP                 | 半導体・<br>半導体製<br>造装置                        | 26,638,420 | 35,588.76       | 948,028,601,832 | 31,661.17       | 843,403,765,250 | 5.32            |
| アメリカ     | 株式 | APPLE INC                   | テクノロ<br>ジー・<br>ハード<br>ウェアお<br>よび機器         | 16,940,148 | 47,611.76       | 806,550,276,966 | 45,751.75       | 775,041,561,944 | 4.89            |
| アメリカ     | 株式 | MICROSOFT CORP              | ソフト<br>ウェア・<br>サービス                        | 8,139,973  | 67,032.86       | 545,645,734,688 | 59,852.08       | 487,194,333,916 | 3.08            |
| アメリカ     | 株式 | AMAZON.COM INC              | 一般消費<br>財・サー<br>ビス流<br>通・小売<br>り           | 11,169,165 | 43,544.64       | 486,357,297,162 | 38,996.33       | 435,556,495,543 | 2.75            |
| アメリカ     | 株式 | ALPHABET INC-CL A           | メディ<br>ア・娯楽                                | 6,718,096  | 62,675.24       | 421,058,304,702 | 57,429.22       | 385,815,036,678 | 2.44            |
| アメリカ     | 株式 | BROADCOM INC                | 半導体・<br>半導体製<br>造装置                        | 5,190,712  | 69,537.44       | 360,948,860,659 | 60,482.15       | 313,945,450,340 | 1.98            |
| アメリカ     | 株式 | ALPHABET INC-CL C           | メディ<br>ア・娯楽                                | 5,334,069  | 62,661.42       | 334,240,387,525 | 57,044.35       | 304,278,548,034 | 1.92            |
| アメリカ     | 株式 | MICRON TECHNOLOGY INC       | 半導体・<br>半導体製<br>造装置                        | 1,301,705  | 130,954.15      | 170,463,681,209 | 185,982.01      | 242,093,724,303 | 1.53            |
| アメリカ     | 株式 | META PLATFORMS INC-CLASS A  | メディ<br>ア・娯楽                                | 2,534,481  | 97,316.79       | 246,647,577,524 | 91,360.61       | 231,551,740,331 | 1.46            |
| アメリカ     | 株式 | TESLA INC                   | 自動車・<br>自動車部<br>品                          | 3,248,291  | 72,037.46       | 233,998,645,164 | 66,878.69       | 217,241,471,506 | 1.37            |
| アメリカ     | 株式 | ELI LILLY & CO              | 医薬品・<br>バイオテ<br>クノロ<br>ジー・ラ<br>イフサイ<br>エンス | 926,909    | 158,135.04      | 146,576,799,926 | 199,728.33      | 185,129,989,135 | 1.17            |
| アメリカ     | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO         | 銀行                                         | 3,094,961  | 48,800.81       | 151,036,615,661 | 53,489.64       | 165,548,356,203 | 1.05            |
| アメリカ     | 株式 | ADVANCED MICRO DEVICES      | 半導体・<br>半導体製<br>造装置                        | 1,882,108  | 74,979.96       | 141,120,387,009 | 87,607.78       | 164,887,305,671 | 1.04            |
| オランダ     | 株式 | ASML HOLDING NV             | 半導体・<br>半導体製<br>造装置                        | 448,223    | 243,786.45      | 109,270,696,898 | 298,784.20      | 133,921,950,477 | 0.85            |
| アメリカ     | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 金融サー<br>ビス                                 | 1,604,219  | 77,880.47       | 124,937,338,100 | 80,545.43       | 129,212,525,211 | 0.82            |
| アメリカ     | 株式 | JOHNSON & JOHNSON           | 医薬品・<br>バイオテ<br>クノロ<br>ジー・ラ<br>イフサイ<br>エンス | 2,778,986  | 36,028.85       | 100,123,678,225 | 41,979.43       | 116,660,272,991 | 0.74            |

|      |    |                         |                        |           |            |                 |            |                 |      |
|------|----|-------------------------|------------------------|-----------|------------|-----------------|------------|-----------------|------|
| アメリカ | 株式 | INTEL CORP              | 半導体・半導体製造装置            | 5,072,297 | 20,973.30  | 106,382,856,555 | 21,390.01  | 108,496,487,611 | 0.68 |
| アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES | 金融サービス                 | 1,939,533 | 52,591.91  | 102,003,747,089 | 55,480.54  | 107,606,344,976 | 0.68 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP        | エネルギー                  | 4,797,882 | 24,297.83  | 116,578,148,125 | 22,094.78  | 106,008,163,569 | 0.67 |
| アメリカ | 株式 | APPLIED MATERIALS INC   | 半導体・半導体製造装置            | 916,581   | 72,606.52  | 66,549,765,211  | 112,802.58 | 103,392,710,378 | 0.65 |
| アメリカ | 株式 | LAM RESEARCH CORP       | 半導体・半導体製造装置            | 1,442,201 | 48,455.31  | 69,882,302,025  | 66,727.67  | 96,234,719,468  | 0.61 |
| アメリカ | 株式 | WALMART INC             | 生活必需品流通・小売り            | 5,061,087 | 20,644.81  | 104,485,221,382 | 18,609.89  | 94,186,292,595  | 0.59 |
| アメリカ | 株式 | CATERPILLAR INC         | 資本財                    | 537,423   | 150,467.37 | 80,864,626,173  | 167,779.72 | 90,168,682,665  | 0.57 |
| アメリカ | 株式 | CISCO SYSTEMS INC       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 4,561,484 | 16,222.51  | 73,998,734,632  | 19,113.30  | 87,185,025,822  | 0.55 |
| 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 | 2,041,634 | 33,089.23  | 67,556,114,279  | 41,297.40  | 84,314,177,789  | 0.53 |
| アメリカ | 株式 | COSTCO WHOLESALE CORP   | 生活必需品流通・小売り            | 512,077   | 162,093.19 | 83,004,194,457  | 153,731.36 | 78,722,296,298  | 0.50 |
| アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC - A      | 金融サービス                 | 944,184   | 80,776.28  | 76,267,680,054  | 82,760.43  | 78,141,082,903  | 0.49 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP    | 銀行                     | 7,834,717 | 8,232.82   | 64,501,823,271  | 9,399.13   | 73,639,548,667  | 0.46 |
| アメリカ | 株式 | GE AEROSPACE            | 資本財                    | 1,206,862 | 49,029.45  | 59,171,787,659  | 60,686.76  | 73,240,552,874  | 0.46 |
| アメリカ | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP INC  | ヘルスケア機器・サービス           | 1,049,213 | 62,496.73  | 65,572,382,877  | 68,174.56  | 71,529,644,904  | 0.45 |

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

## b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2026年 6月30日現在

| 種類 | 業種               | 投資比率（％） |
|----|------------------|---------|
| 株式 | エネルギー            | 3.75    |
|    | 素材               | 3.21    |
|    | 資本財              | 8.28    |
|    | 商業・専門サービス        | 0.92    |
|    | 運輸               | 1.42    |
|    | 自動車・自動車部品        | 1.78    |
|    | 耐久消費財・アパレル       | 0.79    |
|    | 消費者サービス          | 1.48    |
|    | メディア・娯楽          | 6.95    |
|    | 一般消費財・サービス流通・小売り | 4.47    |
|    | 生活必需品流通・小売り      | 1.66    |
|    | 食品・飲料・タバコ        | 2.45    |
|    | 家庭用品・パーソナル用品     | 1.03    |
|    | ヘルスケア機器・サービス     | 2.62    |

|                        |       |
|------------------------|-------|
| 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 6.72  |
| 銀行                     | 6.95  |
| 金融サービス                 | 6.02  |
| 保険                     | 2.66  |
| ソフトウェア・サービス            | 6.90  |
| テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 7.98  |
| 電気通信サービス               | 1.17  |
| 公益事業                   | 2.70  |
| 半導体・半導体製造装置            | 15.04 |
| 不動産管理・開発               | 0.18  |
| 小計                     | 97.14 |
| 投資証券                   | —     |
| 合計                     | 98.64 |

（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

2026年 6月30日現在

| 資産の種類    | 地域      | 取引所名              | 資産の名称        | 建別 | 数量    | 通貨        | 簿価金額            | 簿価金額（円）         | 評価金額            | 評価金額（円）         | 投資比率（％） |
|----------|---------|-------------------|--------------|----|-------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|---------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ    | シカゴ商業取引所          | SP EMINI2609 | 買建 | 3,027 | アメリカドル    | 1,146,685,306.7 | 186,210,226,954 | 1,135,162,837.5 | 184,339,093,181 | 1.16    |
|          | カナダ     | モントリオール取引所        | SP/TSE602609 | 買建 | 184   | カナダドル     | 76,046,425.2    | 8,680,699,437   | 75,576,160      | 8,627,018,664   | 0.05    |
|          | ドイツ     | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO ST 2609 | 買建 | 2,254 | ユーロ       | 142,001,370.68  | 26,319,954,056  | 141,190,560     | 26,169,670,296  | 0.17    |
|          | オーストラリア | シドニー先物取引所         | SPI 200 2609 | 買建 | 241   | オーストラリアドル | 53,411,630.2    | 5,958,601,465   | 53,152,550      | 5,929,698,478   | 0.04    |
|          | イギリス    | インターコンチネンタル取引所    | FTSE100 2609 | 買建 | 381   | イギリスポンド   | 40,111,495.3    | 8,625,977,064   | 40,132,635      | 8,630,523,156   | 0.05    |
|          | スイス     | ユーレックス・チューリッヒ取引所  | SWISS IX2609 | 買建 | 203   | スイスフラン    | 28,203,574.8    | 5,667,508,356   | 28,856,450      | 5,798,703,627   | 0.04    |

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

## 国内債券インデックスマザーファンド

## 投資状況

2026年 6月30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   | 130,786,277,700 | 83.75   |
| 地方債証券 | 日本   | 9,470,714,100   | 6.06    |

|                          |    |                 |        |
|--------------------------|----|-----------------|--------|
| 特殊債券                     | 日本 | 5,595,627,452   | 3.58   |
| 社債券                      | 日本 | 8,682,997,000   | 5.56   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —  | 1,634,708,346   | 1.05   |
| 純資産総額                    |    | 156,170,324,598 | 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

2026年 6月30日現在

| 国／<br>地域 | 種類   | 銘柄名            | 数量            | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|------|----------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|-----------------|-----------------|
| 日本       | 国債証券 | 第180回利付国債（5年）  | 4,380,000,000 | 97.27           | 4,260,450,000   | 97.51           | 4,271,113,200   | 1.100000  | 2030/6/20       | 2.73            |
| 日本       | 国債証券 | 第478回利付国債（2年）  | 3,330,000,000 | 99.63           | 3,317,796,000   | 99.67           | 3,319,044,300   | 1.000000  | 2027/11/1       | 2.13            |
| 日本       | 国債証券 | 第172回利付国債（5年）  | 3,410,000,000 | 96.71           | 3,298,041,500   | 97.03           | 3,308,791,200   | 0.500000  | 2029/6/20       | 2.12            |
| 日本       | 国債証券 | 第177回利付国債（5年）  | 3,230,000,000 | 97.90           | 3,162,188,800   | 98.21           | 3,172,183,000   | 1.100000  | 2029/12/20      | 2.03            |
| 日本       | 国債証券 | 第183回利付国債（5年）  | 3,170,000,000 | 98.80           | 3,132,026,600   | 98.92           | 3,135,954,200   | 1.600000  | 2030/12/20      | 2.01            |
| 日本       | 国債証券 | 第166回利付国債（5年）  | 2,900,000,000 | 97.21           | 2,819,351,300   | 97.46           | 2,826,340,000   | 0.400000  | 2028/12/20      | 1.81            |
| 日本       | 国債証券 | 第163回利付国債（5年）  | 2,630,000,000 | 97.58           | 2,566,361,200   | 97.79           | 2,571,929,600   | 0.400000  | 2028/9/20       | 1.65            |
| 日本       | 国債証券 | 第161回利付国債（5年）  | 2,490,000,000 | 97.71           | 2,433,116,400   | 97.91           | 2,438,183,100   | 0.300000  | 2028/6/20       | 1.56            |
| 日本       | 国債証券 | 第373回利付国債（10年） | 2,690,000,000 | 88.38           | 2,377,510,300   | 88.28           | 2,374,947,200   | 0.600000  | 2033/12/20      | 1.52            |
| 日本       | 国債証券 | 第378回利付国債（10年） | 2,475,000,000 | 91.80           | 2,272,237,000   | 91.34           | 2,260,689,750   | 1.400000  | 2035/3/20       | 1.45            |
| 日本       | 国債証券 | 第381回利付国債（10年） | 2,322,000,000 | 96.49           | 2,240,574,000   | 95.69           | 2,221,945,020   | 2.100000  | 2035/12/20      | 1.42            |
| 日本       | 国債証券 | 第371回利付国債（10年） | 2,510,000,000 | 88.29           | 2,216,190,300   | 88.26           | 2,215,526,800   | 0.400000  | 2033/6/20       | 1.42            |
| 日本       | 国債証券 | 第178回利付国債（5年）  | 2,240,000,000 | 97.26           | 2,178,653,200   | 97.51           | 2,184,403,200   | 1.000000  | 2030/3/20       | 1.40            |
| 日本       | 国債証券 | 第375回利付国債（10年） | 2,270,000,000 | 91.01           | 2,065,952,100   | 90.66           | 2,058,095,500   | 1.100000  | 2034/6/20       | 1.32            |
| 日本       | 国債証券 | 第182回利付国債（5年）  | 2,090,000,000 | 98.20           | 2,052,541,200   | 98.37           | 2,055,974,800   | 1.400000  | 2030/9/20       | 1.32            |
| 日本       | 国債証券 | 第369回利付国債（10年） | 2,270,000,000 | 90.00           | 2,043,034,800   | 90.14           | 2,046,178,000   | 0.500000  | 2032/12/20      | 1.31            |
| 日本       | 国債証券 | 第376回利付国債（10年） | 2,260,000,000 | 88.93           | 2,009,918,500   | 88.63           | 2,003,128,400   | 0.900000  | 2034/9/20       | 1.28            |
| 日本       | 国債証券 | 第366回利付国債（10年） | 2,050,000,000 | 89.95           | 1,844,050,500   | 90.16           | 1,848,321,000   | 0.200000  | 2032/3/20       | 1.18            |
| 日本       | 国債証券 | 第377回利付国債（10年） | 2,032,000,000 | 90.80           | 1,845,235,500   | 90.31           | 1,835,139,840   | 1.200000  | 2034/12/20      | 1.18            |
| 日本       | 国債証券 | 第363回利付国債（10年） | 2,000,000,000 | 91.14           | 1,822,905,100   | 91.43           | 1,828,620,000   | 0.100000  | 2031/6/20       | 1.17            |
| 日本       | 国債証券 | 第480回利付国債（2年）  | 1,800,000,000 | 99.67           | 1,794,138,000   | 99.71           | 1,794,816,000   | 1.100000  | 2028/1/1        | 1.15            |
| 日本       | 国債証券 | 第370回利付国債（10年） | 1,980,000,000 | 89.49           | 1,771,919,400   | 89.57           | 1,773,644,400   | 0.500000  | 2033/3/20       | 1.14            |

|    |      |                |               |       |               |       |               |          |           |      |
|----|------|----------------|---------------|-------|---------------|-------|---------------|----------|-----------|------|
| 日本 | 国債証券 | 第３７２回利付国債（１０年） | 1,900,000,000 | 90.39 | 1,717,433,700 | 90.23 | 1,714,465,000 | 0.800000 | 2033/9/20 | 1.10 |
| 日本 | 国債証券 | 第３６８回利付国債（１０年） | 1,920,000,000 | 88.77 | 1,704,491,200 | 88.93 | 1,707,494,400 | 0.200000 | 2032/9/20 | 1.09 |
| 日本 | 国債証券 | 第３７９回利付国債（１０年） | 1,760,000,000 | 92.23 | 1,623,406,900 | 91.63 | 1,612,723,200 | 1.500000 | 2035/6/20 | 1.03 |
| 日本 | 国債証券 | 第３６４回利付国債（１０年） | 1,740,000,000 | 90.56 | 1,575,788,700 | 90.82 | 1,580,320,200 | 0.100000 | 2031/9/20 | 1.01 |
| 日本 | 国債証券 | 第３６７回利付国債（１０年） | 1,740,000,000 | 89.39 | 1,555,556,400 | 89.54 | 1,557,996,000 | 0.200000 | 2032/6/20 | 1.00 |
| 日本 | 国債証券 | 第１７３回利付国債（５年）  | 1,570,000,000 | 96.60 | 1,516,739,600 | 96.93 | 1,521,895,200 | 0.600000 | 2029/9/20 | 0.97 |
| 日本 | 国債証券 | 第３７４回利付国債（１０年） | 1,610,000,000 | 89.33 | 1,438,277,300 | 89.08 | 1,434,316,800 | 0.800000 | 2034/3/20 | 0.92 |
| 日本 | 国債証券 | 第３８２回利付国債（１０年） | 1,460,000,000 | 98.04 | 1,431,515,900 | 97.84 | 1,428,478,600 | 2.400000 | 2036/3/20 | 0.91 |

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

## b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2026年 6月30日現在

| 種類    | 投資比率（％） |
|-------|---------|
| 国債証券  | 83.75   |
| 地方債証券 | 6.06    |
| 特殊債券  | 3.58    |
| 社債券   | 5.56    |
| 合計    | 98.95   |

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 日本短期債券マザーファンド

## 投資状況

2026年 6月30日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計           | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|----------------|---------|
| 社債券                      | 日本   | 15,008,004,000 | 98.55   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 220,430,298    | 1.45    |
| 純資産総額                    |      | 15,228,434,298 | 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

2026年 6月30日現在

| 国／<br>地域 | 種類  | 銘柄名                           | 数量          | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|-----|-------------------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|-----------------|-----------------|
| 日本       | 社債券 | 第１３回資生堂（サステナビリティ）             | 400,000,000 | 98.35           | 393,421,000     | 98.24           | 392,988,000     | 0.450000  | 2027/12/8       | 2.58            |
| 日本       | 社債券 | 第９０回アコム                       | 300,000,000 | 100.00          | 300,000,000     | 100.15          | 300,462,000     | 1.839000  | 2028/5/26       | 1.97            |
| 日本       | 社債券 | 第１７回イオンフィナンシャルサービス            | 300,000,000 | 99.19           | 297,579,000     | 99.91           | 299,748,000     | 0.340000  | 2026/7/31       | 1.97            |
| 日本       | 社債券 | 第２５回ソフトバンク                    | 300,000,000 | 99.32           | 297,969,000     | 99.27           | 297,825,000     | 0.828000  | 2027/5/27       | 1.96            |
| 日本       | 社債券 | 第３０回商船三井                      | 300,000,000 | 99.73           | 299,197,000     | 99.09           | 297,285,000     | 1.454000  | 2028/9/4        | 1.95            |
| 日本       | 社債券 | 第２１回クレディ・アグリコル・エス・エー（２０２５）    | 300,000,000 | 99.85           | 299,568,000     | 98.95           | 296,874,000     | 1.552000  | 2029/6/5        | 1.95            |
| 日本       | 社債券 | 第５２回三菱ＵＦＪリース                  | 300,000,000 | 98.62           | 295,887,000     | 98.83           | 296,490,000     | 0.375000  | 2027/7/13       | 1.95            |
| 日本       | 社債券 | 第６５回クレディセゾン                   | 300,000,000 | 98.48           | 295,440,000     | 98.73           | 296,193,000     | 0.380000  | 2027/7/30       | 1.94            |
| 日本       | 社債券 | 第３１回大和証券グループ本社                | 300,000,000 | 98.40           | 295,212,000     | 98.59           | 295,779,000     | 0.410000  | 2027/8/27       | 1.94            |
| 日本       | 社債券 | 第６回新日鐵住金                      | 300,000,000 | 97.98           | 293,948,000     | 98.12           | 294,363,000     | 0.350000  | 2027/12/20      | 1.93            |
| 日本       | 社債券 | 第３５回イオンモール                    | 300,000,000 | 98.39           | 295,176,000     | 97.90           | 293,724,000     | 0.760000  | 2028/4/28       | 1.93            |
| 日本       | 社債券 | 第２４回パナソニックホールディングス            | 300,000,000 | 98.32           | 294,969,000     | 97.53           | 292,608,000     | 0.709000  | 2028/9/14       | 1.92            |
| 日本       | 社債券 | 第３３回東京センチュリー                  | 300,000,000 | 97.67           | 293,022,000     | 97.44           | 292,329,000     | 0.280000  | 2028/4/27       | 1.92            |
| 日本       | 社債券 | 第３７回サッポロホールディングス              | 300,000,000 | 97.29           | 291,892,000     | 97.37           | 292,128,000     | 0.450000  | 2028/6/6        | 1.92            |
| 日本       | 社債券 | 第２５回商船三井                      | 300,000,000 | 97.13           | 291,414,000     | 97.22           | 291,672,000     | 0.425000  | 2028/7/10       | 1.92            |
| 日本       | 社債券 | 第１３回日本製鉄                      | 200,000,000 | 100.00          | 200,000,000     | 100.13          | 200,278,000     | 2.014000  | 2029/6/15       | 1.32            |
| 日本       | 社債券 | 第４６回エス・ティ・ティ・ファイナンス           | 200,000,000 | 100.00          | 200,000,000     | 100.09          | 200,184,000     | 1.829000  | 2029/3/19       | 1.31            |
| 日本       | 社債券 | 第３０回イオンフィナンシャルサービス            | 200,000,000 | 100.00          | 200,000,000     | 100.00          | 200,008,000     | 2.006000  | 2029/7/2        | 1.31            |
| 日本       | 社債券 | 第１４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     | 99.99           | 199,996,000     | 2.212000  | 2030/6/21       | 1.31            |
| 日本       | 社債券 | 第３２回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー         | 200,000,000 | 99.59           | 199,182,000     | 99.97           | 199,946,000     | 0.713000  | 2026/7/13       | 1.31            |
| 日本       | 社債券 | 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 | 100.09          | 200,188,000     | 99.91           | 199,824,000     | 1.377000  | 2027/12/1       | 1.31            |
| 日本       | 社債券 | 第２５回クレディ・アグリコル・エス・エー（２０２６）    | 200,000,000 | 100.00          | 200,000,000     | 99.78           | 199,576,000     | 2.232000  | 2030/6/5        | 1.31            |
| 日本       | 社債券 | 第４２回エス・ティ・ティ・ファイナンス           | 200,000,000 | 99.66           | 199,320,000     | 99.71           | 199,420,000     | 1.640000  | 2028/12/20      | 1.31            |
| 日本       | 社債券 | 第１５回クレディ・アグリコル・エス・エー（２０２４）    | 200,000,000 | 99.54           | 199,088,000     | 99.67           | 199,352,000     | 1.114000  | 2028/1/26       | 1.31            |
| 日本       | 社債券 | 第２８回ソフトバンク                    | 200,000,000 | 100.04          | 200,096,000     | 99.60           | 199,214,000     | 1.186000  | 2027/5/28       | 1.31            |
| 日本       | 社債券 | 第４回香港上海銀行                     | 200,000,000 | 99.38           | 198,762,000     | 99.33           | 198,662,000     | 0.808000  | 2027/6/25       | 1.30            |
| 日本       | 社債券 | 第４４回フランス相互信用連合銀行              | 200,000,000 | 99.22           | 198,442,000     | 98.99           | 197,988,000     | 0.933000  | 2027/10/15      | 1.30            |
| 日本       | 社債券 | 第１０回フランス電力                    | 200,000,000 | 99.28           | 198,576,000     | 98.94           | 197,894,000     | 1.172000  | 2027/10/25      | 1.30            |
| 日本       | 社債券 | 第２７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付 | 200,000,000 | 99.77           | 199,542,000     | 98.69           | 197,390,000     | 1.558000  | 2029/7/4        | 1.30            |

|    |     |                 |             |       |             |       |             |          |          |      |
|----|-----|-----------------|-------------|-------|-------------|-------|-------------|----------|----------|------|
| 日本 | 社債券 | 第３５回芙蓉総合<br>リース | 200,000,000 | 98.37 | 196,751,000 | 98.36 | 196,734,000 | 0.709000 | 2028/3/7 | 1.29 |
|----|-----|-----------------|-------------|-------|-------------|-------|-------------|----------|----------|------|

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

## b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2026年 6月30日現在

| 種類  | 投資比率（％） |
|-----|---------|
| 社債券 | 98.55   |
| 合計  | 98.55   |

（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

2026年 6月30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     | 160,784,579,803 | 44.21   |
|       | 中国       | 45,393,670,643  | 12.48   |
|       | フランス     | 24,679,721,851  | 6.79    |
|       | イタリア     | 22,956,956,161  | 6.31    |
|       | イギリス     | 20,350,460,806  | 5.60    |
|       | ドイツ      | 20,295,232,142  | 5.58    |
|       | スペイン     | 15,068,171,554  | 4.14    |
|       | カナダ      | 7,662,911,088   | 2.11    |
|       | ベルギー     | 5,286,479,950   | 1.45    |
|       | オーストラリア  | 4,694,030,332   | 1.29    |
|       | オランダ     | 4,382,376,573   | 1.20    |
|       | オーストリア   | 3,745,687,879   | 1.03    |
|       | メキシコ     | 3,320,453,580   | 0.91    |
|       | ポーランド    | 2,659,051,210   | 0.73    |
|       | 韓国       | 2,501,046,905   | 0.69    |
|       | ポルトガル    | 2,030,648,252   | 0.56    |
|       | フィンランド   | 1,882,387,616   | 0.52    |
|       | マレーシア    | 1,831,741,082   | 0.50    |
|       | イスラエル    | 1,631,273,325   | 0.45    |
|       | アイルランド   | 1,514,834,817   | 0.42    |
|       | シンガポール   | 1,273,701,325   | 0.35    |
|       | ニュージーランド | 1,077,807,472   | 0.30    |
|       | スロバキア    | 795,477,880     | 0.22    |

|                          |        |                 |        |
|--------------------------|--------|-----------------|--------|
|                          | デンマーク  | 765,932,006     | 0.21   |
|                          | スウェーデン | 675,977,101     | 0.19   |
|                          | ノルウェー  | 583,388,683     | 0.16   |
|                          | 小計     | 357,844,000,036 | 98.38  |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —      | 5,875,773,586   | 1.62   |
| 純資産総額                    |        | 363,719,773,622 | 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

| 2026年 6月30日現在 |      |                           |            |                 |                 |                 |                 |           |                 |                 |
|---------------|------|---------------------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|-----------------|-----------------|
| 国／<br>地域      | 種類   | 銘柄名                       | 数量         | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(%) |
| アメリカ          | 国債証券 | 4.125 T-NOTE<br>360215    | 11,060,000 | 15,820.88       | 1,749,789,986   | 15,939.59       | 1,762,919,032   | 4.125000  | 2036/2/15       | 0.48            |
| アメリカ          | 国債証券 | 3.5 T-NOTE 271031         | 9,650,000  | 16,109.41       | 1,554,558,333   | 16,110.22       | 1,554,637,172   | 3.500000  | 2027/10/31      | 0.43            |
| アメリカ          | 国債証券 | 4 T-NOTE 351115           | 9,510,000  | 16,067.71       | 1,528,039,535   | 15,800.03       | 1,502,583,759   | 4.000000  | 2035/11/15      | 0.41            |
| 中国            | 国債証券 | 2.4 CHINA GOVT<br>280715  | 60,000,000 | 2,446.56        | 1,467,936,171   | 2,444.85        | 1,466,912,436   | 2.400000  | 2028/7/15       | 0.40            |
| アメリカ          | 国債証券 | 4.625 T-NOTE<br>350215    | 8,760,000  | 16,773.47       | 1,469,356,560   | 16,589.47       | 1,453,237,621   | 4.625000  | 2035/2/15       | 0.40            |
| アメリカ          | 国債証券 | 4.25 T-NOTE<br>341115     | 8,560,000  | 16,338.59       | 1,398,583,364   | 16,165.73       | 1,383,786,845   | 4.250000  | 2034/11/15      | 0.38            |
| 中国            | 国債証券 | 1.43 CHINA GOVT<br>300125 | 57,000,000 | 2,377.89        | 1,355,398,495   | 2,394.08        | 1,364,629,179   | 1.430000  | 2030/1/25       | 0.38            |
| アメリカ          | 国債証券 | 4 T-NOTE 340215           | 8,400,000  | 16,093.37       | 1,351,843,178   | 15,945.30       | 1,339,405,403   | 4.000000  | 2034/2/15       | 0.37            |
| アメリカ          | 国債証券 | 3.875 T-NOTE<br>330815    | 8,260,000  | 15,939.25       | 1,316,582,674   | 15,866.64       | 1,310,584,856   | 3.875000  | 2033/8/15       | 0.36            |
| アメリカ          | 国債証券 | 4.125 T-NOTE<br>271115    | 8,000,000  | 16,385.53       | 1,310,842,531   | 16,241.85       | 1,299,348,359   | 4.125000  | 2027/11/15      | 0.36            |
| アメリカ          | 国債証券 | 4.375 T-NOTE<br>340515    | 7,950,000  | 16,518.31       | 1,313,205,708   | 16,331.61       | 1,298,363,230   | 4.375000  | 2034/5/15       | 0.36            |
| アメリカ          | 国債証券 | 1.875 T-NOTE<br>320215    | 8,900,000  | 14,429.97       | 1,284,267,810   | 14,380.07       | 1,279,826,983   | 1.875000  | 2032/2/15       | 0.35            |
| アメリカ          | 国債証券 | 3.875 T-NOTE<br>340815    | 8,110,000  | 15,922.33       | 1,291,301,734   | 15,768.32       | 1,278,810,966   | 3.875000  | 2034/8/15       | 0.35            |
| アメリカ          | 国債証券 | 4.5 T-NOTE 331115         | 7,740,000  | 16,682.32       | 1,291,211,932   | 16,480.04       | 1,275,555,688   | 4.500000  | 2033/11/15      | 0.35            |
| アメリカ          | 国債証券 | 3.375 T-NOTE<br>330515    | 8,200,000  | 15,526.30       | 1,273,157,391   | 15,408.97       | 1,263,535,656   | 3.375000  | 2033/5/15       | 0.35            |
| アメリカ          | 国債証券 | 4.25 T-NOTE<br>350815     | 7,800,000  | 16,284.46       | 1,270,188,598   | 16,124.18       | 1,257,686,448   | 4.250000  | 2035/8/15       | 0.35            |
| アメリカ          | 国債証券 | 3.5 T-NOTE 330215         | 7,990,000  | 15,704.88       | 1,254,820,648   | 15,562.79       | 1,243,467,557   | 3.500000  | 2033/2/15       | 0.34            |
| アメリカ          | 国債証券 | 1.25 T-NOTE<br>310815     | 8,640,000  | 14,056.33       | 1,214,467,633   | 14,084.79       | 1,216,926,301   | 1.250000  | 2031/8/15       | 0.33            |
| アメリカ          | 国債証券 | 3.375 T-NOTE<br>271130    | 7,500,000  | 16,091.84       | 1,206,888,445   | 16,075.97       | 1,205,698,178   | 3.375000  | 2027/11/30      | 0.33            |
| 中国            | 国債証券 | 2.55 CHINA GOVT<br>281015 | 49,000,000 | 2,462.27        | 1,206,513,568   | 2,459.06        | 1,204,942,557   | 2.550000  | 2028/10/15      | 0.33            |
| アメリカ          | 国債証券 | 3.75 T-NOTE<br>270815     | 7,360,000  | 16,277.97       | 1,198,058,857   | 16,178.10       | 1,190,708,436   | 3.750000  | 2027/8/15       | 0.33            |
| アメリカ          | 国債証券 | 4.25 T-NOTE<br>350515     | 7,190,000  | 16,299.61       | 1,171,942,518   | 16,137.18       | 1,160,263,895   | 4.250000  | 2035/5/15       | 0.32            |

|      |      |                           |            |           |               |           |               |          |            |      |
|------|------|---------------------------|------------|-----------|---------------|-----------|---------------|----------|------------|------|
| アメリカ | 国債証券 | 4.875 T-NOTE<br>281031    | 7,000,000  | 16,532.27 | 1,157,259,344 | 16,510.49 | 1,155,734,705 | 4.875000 | 2028/10/31 | 0.32 |
| アメリカ | 国債証券 | 3.125 T-NOTE<br>270831    | 7,170,000  | 16,112.44 | 1,155,262,116 | 16,060.75 | 1,151,555,892 | 3.125000 | 2027/8/31  | 0.32 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.25 T-NOTE<br>280930     | 7,500,000  | 15,252.92 | 1,143,969,355 | 15,250.70 | 1,143,802,840 | 1.250000 | 2028/9/30  | 0.31 |
| アメリカ | 国債証券 | 0.875 T-NOTE<br>301115    | 8,000,000  | 14,155.52 | 1,132,441,890 | 14,144.10 | 1,131,528,440 | 0.875000 | 2030/11/15 | 0.31 |
| アメリカ | 国債証券 | 4.125 T-NOTE<br>321115    | 6,940,000  | 16,341.30 | 1,134,086,616 | 16,163.83 | 1,121,769,880 | 4.125000 | 2032/11/15 | 0.31 |
| 中国   | 国債証券 | 1.62 CHINA GOVT<br>270815 | 46,000,000 | 2,397.01  | 1,102,627,606 | 2,399.44  | 1,103,742,893 | 1.620000 | 2027/8/15  | 0.30 |
| アメリカ | 国債証券 | 3.5 T-NOTE 310228         | 6,950,000  | 15,778.32 | 1,096,593,315 | 15,810.18 | 1,098,808,127 | 3.500000 | 2031/2/28  | 0.30 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.125 T-NOTE<br>280229    | 7,000,000  | 15,433.07 | 1,080,315,329 | 15,465.11 | 1,082,557,711 | 1.125000 | 2028/2/29  | 0.30 |

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

**b 全銘柄の種類／業種別投資比率**

2026年 6月30日現在

| 種類   | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.38   |
| 合計   | 98.38   |

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

**投資不動産物件**

該当事項はありません。

**その他投資資産の主要なもの**

該当事項はありません。

**《参考情報》**

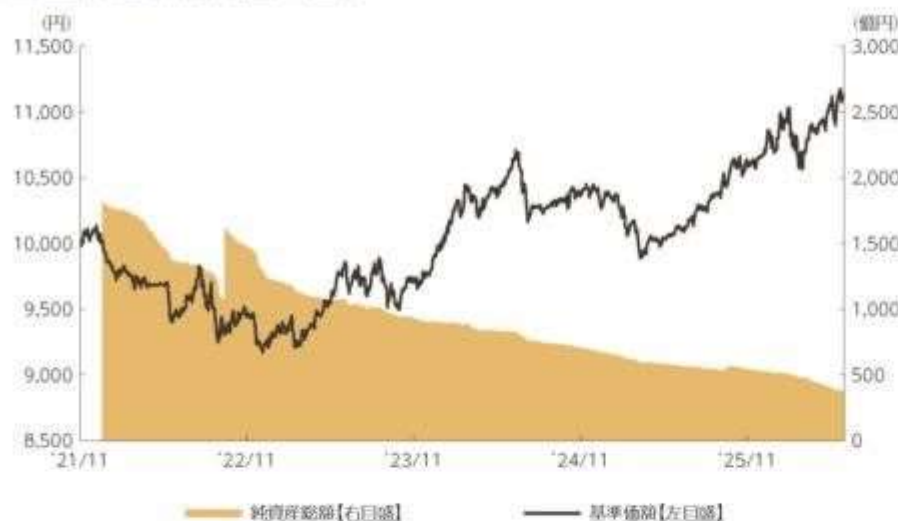


## 運用実績

2026年6月30日現在

### ■基準価額・純資産の推移

2021年11月30日(設定日)～2026年6月30日



### ■基準価額・純資産

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 11,130円 |
| 純資産総額 | 370.0億円 |

●純資産総額は表示桁未満切捨て

### ■分配の推移

|          |    |
|----------|----|
| 2026年 6月 | 0円 |
| 2025年 6月 | 0円 |
| 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

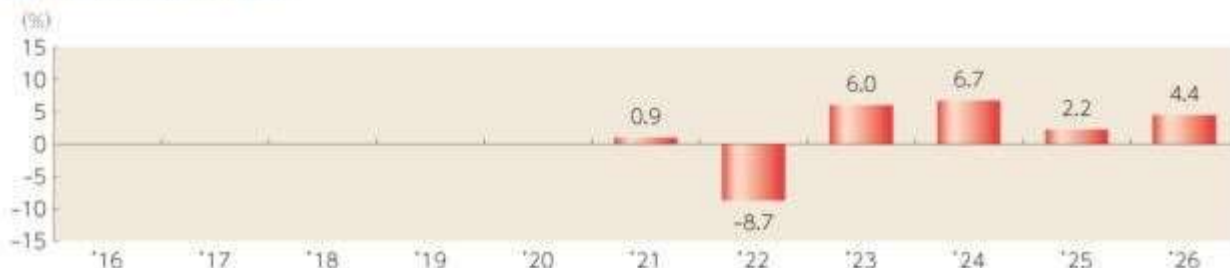
### ■主要な資産の状況

| 資産別構成              | 比率     | 組入上位通貨       | 比率    | 組入上位銘柄            | 種類 | 業種／種別           | 国・地域 | 比率   |
|--------------------|--------|--------------|-------|-------------------|----|-----------------|------|------|
| 国内株式               | 19.9%  | 1 円          | 82.1% | NVIDIA CORP.      | 株式 | 半導体・半導体製造装置     | アメリカ | 0.9% |
| 国内債券               | 30.8%  | 2 アメリカドル     | 13.8% | APPLE INC.        | 株式 | テクノロジー／ハードウェア機器 | アメリカ | 0.9% |
| 外国株式               | 17.4%  | 3 ユーロ        | 1.7%  | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 株式 | 銀行業             | 日本   | 0.7% |
| 外国債券               | 30.6%  | 4 イギリスポンド    | 0.6%  | 東京エレクトロン          | 株式 | 電気機器            | 日本   | 0.6% |
|                    |        | 5 カナダドル      | 0.6%  | MICROSOFT CORP.   | 株式 | ソフトウェア・サービス     | アメリカ | 0.5% |
|                    |        | 6 スイスフラン     | 0.4%  | 第180回利付国債(5年)     | 債券 | 国債              | 日本   | 0.8% |
|                    |        | 7 オーストラリアドル  | 0.3%  | 第478回利付国債(2年)     | 債券 | 国債              | 日本   | 0.6% |
|                    |        | 8 スウェーデンクローネ | 0.1%  | 第172回利付国債(5年)     | 債券 | 国債              | 日本   | 0.6% |
| コールローン他<br>(負債控除後) | 1.3%   | 9 デンマーククローネ  | 0.1%  | 第177回利付国債(5年)     | 債券 | 国債              | 日本   | 0.6% |
| 合計                 | 100.0% | 10 香港ドル      | 0.1%  | 第183回利付国債(5年)     | 債券 | 国債              | 日本   | 0.6% |

| その他資産の状況     | 比率   |
|--------------|------|
| 株価指数先物取引（買建） | 0.3% |

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

### ■年間収益率の推移



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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### ①申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

#### ②申込単位

販売会社が定める単位

#### ③申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

#### ④申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

#### ⑤申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認ください。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ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/>

#### ⑥申込手数料

ありません。

#### ⑦申込方法

取得申込者は、販売会社取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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が販売会社により異なる場合があります。

#### ⑧申込受付時間

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時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。

#### ⑨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、取得申込みの受付を中止することがあります。

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

## 2【換金（解約）手続等】

### ①解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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

### ②解約単位

販売会社が定める単位

### ③解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

### ④信託財産留保額

ありません。

### ⑤解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

### ⑥解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ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/>

### ⑦支払開始日

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

### ⑧解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時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。

### ⑨解約請求受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求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】

##### ①基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

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

（資産の評価方法）

##### ・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

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

##### ・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

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

##### ・公社債等

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

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

##### ・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

##### ・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

##### ・外貨建資産

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

##### ・外国為替予約取引

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

##### ・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

##### ②基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

##### ③基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ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】

2031年6月25日まで（2021年11月30日設定）

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

（４）【計算期間】

毎年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】

①ファンドの償還条件等

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

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

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

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

②信託約款の変更等

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

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

③ファンドの償還等に関する開示方法

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

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

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

#### ④反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

#### ⑤関係法人との契約の更改

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

#### ⑥運用報告書

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

#### ⑦委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

#### ⑧受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

#### ⑨信託事務の再信託

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

#### ⑩公告

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

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

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

### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

#### (1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に应じて受領する権利を有します。

##### ①分配金受取コース（一般コース）

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

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

②分配金再投資コース（累積投資コース）

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

（2）償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

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

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

（3）換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（2025年6月26日から2026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】

## 【ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第4期<br>[ 2025年 6月25日現在 ] | 第5期<br>[ 2026年 6月25日現在 ] |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
| 資産の部            |                          |                          |
| 流動資産            |                          |                          |
| コール・ローン         | 17,206,686,729           | 187,793,476              |
| 親投資信託受益証券       | 40,465,149,405           | 35,789,826,794           |
| 未収入金            | -                        | 1,924,260,000            |
| 未収利息            | 218,803                  | 4,971                    |
| 流動資産合計          | 57,672,054,937           | 37,901,885,241           |
| 資産合計            | 57,672,054,937           | 37,901,885,241           |
| 負債の部            |                          |                          |
| 流動負債            |                          |                          |
| 未払解約金           | 293,162,629              | 388,810,648              |
| 未払受託者報酬         | 8,500,777                | 6,430,358                |
| 未払委託者報酬         | 45,904,157               | 34,723,869               |
| その他未払費用         | 1,054,041                | 797,301                  |
| 流動負債合計          | 348,621,604              | 430,762,176              |
| 負債合計            | 348,621,604              | 430,762,176              |
| 純資産の部           |                          |                          |
| 元本等             |                          |                          |
| 元本              | 56,751,011,584           | 33,687,761,096           |
| 剰余金             |                          |                          |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 572,421,749              | 3,783,361,969            |
| （分配準備積立金）       | 4,965,671,429            | 4,393,743,843            |
| 元本等合計           | 57,323,433,333           | 37,471,123,065           |
| 純資産合計           | 57,323,433,333           | 37,471,123,065           |
| 負債純資産合計         | 57,672,054,937           | 37,901,885,241           |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 第4期<br>自 2024年 6月26日<br>至 2025年 6月25日 | 第5期<br>自 2025年 6月26日<br>至 2026年 6月25日 |
|-------------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                       |                                       |
| 受取利息                                      | 36,654,721                            | 45,631,920                            |
| 有価証券売買等損益                                 | △2,881,753,426                        | 4,920,841,177                         |
| 営業収益合計                                    | △2,845,098,705                        | 4,966,473,097                         |
| 営業費用                                      |                                       |                                       |
| 受託者報酬                                     | 18,794,198                            | 14,019,523                            |
| 委託者報酬                                     | 101,488,581                           | 75,705,319                            |
| その他費用                                     | 2,330,361                             | 1,738,297                             |
| 営業費用合計                                    | 122,613,140                           | 91,463,139                            |
| 営業利益又は営業損失（△）                             | △2,967,711,845                        | 4,875,009,958                         |
| 経常利益又は経常損失（△）                             | △2,967,711,845                        | 4,875,009,958                         |
| 当期純利益又は当期純損失（△）                           | △2,967,711,845                        | 4,875,009,958                         |
| 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（△） | △521,279,645                          | 1,490,736,994                         |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△）                           | 4,228,667,255                         | 572,421,749                           |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 25,192,072                            | 123,303,007                           |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 25,192,072                            | 123,303,007                           |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 1,235,005,378                         | 296,635,751                           |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 1,235,005,378                         | 296,635,751                           |
| 分配金                                       | -                                     | -                                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）                           | 572,421,749                           | 3,783,361,969                         |

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                    |                                                 |
|--------------------|-------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。 |
|--------------------|-------------------------------------------------|

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

|           | 第4期<br>[2025年 6月25日現在] | 第5期<br>[2026年 6月25日現在] |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 1. 期首元本額  | 78,720,458,164円        | 56,751,011,584円        |
| 期中追加設定元本額 | 1,096,494,669円         | 2,880,868,024円         |
| 期中一部解約元本額 | 23,065,941,249円        | 25,944,118,512円        |
| 2. 受益権の総数 | 56,751,011,584口        | 33,687,761,096口        |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第4期<br>自 2024年 6月26日<br>至 2025年 6月25日 |              |                 | 第5期<br>自 2025年 6月26日<br>至 2026年 6月25日 |              |                 |
|---------------------------------------|--------------|-----------------|---------------------------------------|--------------|-----------------|
| 1. 分配金の計算過程                           |              |                 | 1. 分配金の計算過程                           |              |                 |
| 項目                                    |              |                 | 項目                                    |              |                 |
| 費用控除後の配当等収益額                          | A            | 721,974,302円    | 費用控除後の配当等収益額                          | A            | 617,966,738円    |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額             | B            | －円              | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額             | B            | 986,705,430円    |
| 収益調整金額                                | C            | 160,880,108円    | 収益調整金額                                | C            | 257,851,846円    |
| 分配準備積立金額                              | D            | 4,243,697,127円  | 分配準備積立金額                              | D            | 2,789,071,675円  |
| 当ファンドの分配対象収益額                         | E=A+B+C+D    | 5,126,551,537円  | 当ファンドの分配対象収益額                         | E=A+B+C+D    | 4,651,595,689円  |
| 当ファンドの期末残存口数                          | F            | 56,751,011,584口 | 当ファンドの期末残存口数                          | F            | 33,687,761,096口 |
| 1万口当たり収益分配対象額                         | G=E/F*10,000 | 903円            | 1万口当たり収益分配対象額                         | G=E/F*10,000 | 1,380円          |
| 1万口当たり分配金額                            | H            | －円              | 1万口当たり分配金額                            | H            | －円              |
| 収益分配金金額                               | I=F*H/10,000 | －円              | 収益分配金金額                               | I=F*H/10,000 | －円              |

## (金融商品に関する注記)

## 1 金融商品の状況に関する事項

| 区分                       | 第4期<br>自 2024年 6月26日<br>至 2025年 6月25日                                                                                                                                                          | 第5期<br>自 2025年 6月26日<br>至 2026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                                    |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。<br>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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4期<br>[2025年 6月25日現在]                               | 第5期<br>[2026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<br>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 | (1) 有価証券<br>同左         |

| 区分                        | 第4期<br>[2025年 6月25日現在]                                                                                                                                                                                                | 第5期<br>[2026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 | <p>(2) デリバティブ取引<br/>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品<br/>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>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。</p> | <p>(2) デリバティブ取引<br/>同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品<br/>同左</p> <p>同左</p> |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種類        | 第4期<br>[2025年 6月25日現在]   | 第5期<br>[2026年 6月25日現在]   |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) |
| 親投資信託受益証券 | 512,428,394              | 766,933,335              |
| 合計        | 512,428,394              | 766,933,335              |

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

|              | 第4期<br>[2025年 6月25日現在] | 第5期<br>[2026年 6月25日現在] |
|--------------|------------------------|------------------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.0101円                | 1.1123円                |
| (1万口当たり純資産額) | (10,101円)              | (11,123円)              |

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種 類       | 銘 柄                   | 口数             | 評価額            | 備考 |
|-----------|-----------------------|----------------|----------------|----|
| 親投資信託受益証券 | ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド | 10,772,350,463 | 11,863,589,564 |    |
|           | 国内債券インデックスマザーファンド     | 10,753,754,246 | 8,893,354,761  |    |
|           | 日本短期債券マザーファンド         | 998,597,382    | 1,127,017,005  |    |
|           | T O P I Xマザーファンド      | 1,437,842,350  | 7,432,782,244  |    |
|           | 外国株式インデックスマザーファンド     | 617,224,786    | 6,473,083,220  |    |
| 合計        |                       | 24,579,769,227 | 35,789,826,794 |    |

## 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）

[2026年 6月25日現在]

|                   |                   |
|-------------------|-------------------|
| <b>資産の部</b>       |                   |
| 流動資産              |                   |
| コール・ローン           | 65,924,188,308    |
| 株式                | 2,904,384,046,700 |
| 派生商品評価勘定          | 407,818,645       |
| 未収配当金             | 9,741,542,193     |
| 未収利息              | 1,745,311         |
| その他未収収益           | 255,914,327       |
| 差入委託証拠金           | 1,484,144,809     |
| 流動資産合計            | 2,982,199,400,293 |
| <b>資産合計</b>       |                   |
| 2,982,199,400,293 |                   |
| <b>負債の部</b>       |                   |
| 流動負債              |                   |
| 派生商品評価勘定          | 10,106,930        |
| 前受金               | 67,555,100        |
| 未払金               | 2,011,550,049     |
| 未払解約金             | 903,427,371       |
| 未払利息              | 27,398,614        |
| 受入担保金             | 50,701,543,362    |
| 流動負債合計            | 53,721,581,426    |
| <b>負債合計</b>       |                   |
| 53,721,581,426    |                   |
| <b>純資産の部</b>      |                   |
| 元本等               |                   |
| 元本                | 566,498,146,277   |
| 剰余金               |                   |
| 剰余金又は欠損金（△）       | 2,361,979,672,590 |
| 元本等合計             | 2,928,477,818,867 |
| <b>純資産合計</b>      |                   |
| 2,928,477,818,867 |                   |
| <b>負債純資産合計</b>    |                   |
| 2,982,199,400,293 |                   |

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

|           |                  |
|-----------|------------------|
|           | [2026年 6月25日現在]  |
| 1. 期首     | 2025年 6月26日      |
| 期首元本額     | 488,527,895,869円 |
| 期中追加設定元本額 | 208,441,633,781円 |
| 期中一部解約元本額 | 130,471,383,373円 |

|                                                  | [2026年 6月25日現在]  |
|--------------------------------------------------|------------------|
| 元本の内訳※                                           |                  |
| 三菱UFJ トピックスインデックスオープン                            | 5,913,092,618円   |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定型)                          | 542,124,422円     |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型)                        | 3,089,380,217円   |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド (成長型)                          | 3,695,009,393円   |
| 三菱UFJ トピックスオープン (確定拠出年金)                         | 3,932,063,166円   |
| 三菱UFJ プライムバランス (安定型) (確定拠出年金)                    | 3,734,842,914円   |
| 三菱UFJ プライムバランス (安定成長型) (確定拠出年金)                  | 24,848,690,571円  |
| 三菱UFJ プライムバランス (成長型) (確定拠出年金)                    | 36,259,513,944円  |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)                       | 52,581,554円      |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型)                          | 149,955,639円     |
| eMAXIS TOPIXインデックス                               | 7,915,530,671円   |
| eMAXIS バランス (8資産均等型)                             | 1,673,061,361円   |
| eMAXIS バランス (波乗り型)                               | 68,231,420円      |
| 三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)                    | 2,572,221,932円   |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)                | 630,039,921円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)                | 1,130,111,288円   |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)                | 1,253,048,395円   |
| eMAXIS Slim 国内株式 (TOPIX)                         | 142,670,502,412円 |
| 国内株式セレクション (ラップ向け)                               | 4,856,002,233円   |
| eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)                        | 12,923,592,139円  |
| つみたて日本株式 (TOPIX)                                 | 19,497,991,044円  |
| つみたて8資産均等バランス                                    | 6,517,419,632円   |
| つみたて4資産均等バランス                                    | 2,762,321,835円   |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s                            | 3,584,721円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s                            | 5,127,380円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s                            | 10,469,154円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)                | 688,267,269円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)                | 1,078,253,875円   |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)                | 820,055,192円     |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式15)                            | 620,344,761円     |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式40)                            | 2,005,579,159円   |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式65)                            | 5,768,868,012円   |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)                       | 3,532,893,696円   |
| 三菱UFJ DC年金インデックス (国内株式)                          | 10,759,470,285円  |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)                | 811,043,954円     |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式25)                            | 121,118,556円     |
| 国内株式インデックス・オープン (ラップ向け)                          | 28,351,386,623円  |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)                | 493,822,292円     |
| ラップ向けインデックスf 国内株式                                | 4,306,746,238円   |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)                       | 129,259,963円     |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)                       | 5,441,416,055円   |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)                       | 3,384,752,519円   |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式80)                            | 152,922,725円     |
| ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)                        | 1,437,842,350円   |
| ラップ向けダイナミックアロケーションファンド                           | 68,651,921円      |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド                            | 19,358,974円      |
| アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)                         | 111,391,407円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)                | 112,747,736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 | 4,569,611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  | 35,036,820円      |
| eMAXIS/PayPay証券 全世界バランス                          | 65,079,713円      |
| 三菱UFJ 資産配分最適化バランス (R1)                           | 19,361,749円      |
| 三菱UFJ 資産配分最適化バランス (R2)                           | 166,351,649円     |

|                                            | [2026年 6月25日現在] |
|--------------------------------------------|-----------------|
| 三菱UFJ 資産配分最適化バランス（R3）                      | 1,046,189,778円  |
| 三菱UFJ 資産配分最適化バランス（R4）                      | 838,872,279円    |
| 三菱UFJ 資産配分最適化バランス（R5）                      | 324,767,054円    |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）                  | 394,599,537円    |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）                  | 1,071,559,424円  |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）                 | 178,499,563円    |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）             | 1,033,585,630円  |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）                  | 109,828,188円    |
| eMAXIS バランス（4資産均等型）                        | 864,385,094円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）                  | 146,994,587円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）                  | 215,382,792円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）                 | 982,019,324円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）                    | 852,171,814円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）                   | 1,765,376,079円  |
| 三菱UFJ トピックスオープン                            | 811,397,940円    |
| 三菱UFJ DCトピックスオープン                          | 7,247,488,070円  |
| 三菱UFJ トピックスオープンVA（適格機関投資家限定）               | 26,007,052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）         | 1,725,214,840円  |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）              | 4,608,013円      |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）              | 1,928,261,998円  |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）            | 23,408,532円     |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）            | 682,943,517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）             | 72,493,987,300円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）            | 109,246,586円    |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）            | 85,096円         |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）              | 104,428,735円    |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）              | 174,252,018円    |
| MUAM インデックスファンドTOPIXi（適格機関投資家限定）           | 3,683,175,156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）    | 1,689,556,468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）   | 225,503,717円    |
| MUKAM 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）       | 232,419,085円    |
| 世界8資産 バランスファンドVL（適格機関投資家限定）                | 104,971,606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）          | 2,261,001,855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）    | 109,225,610円    |
| MUKAM 日本株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）           | 9,833,991,776円  |
| MUKAM スマート・クオリティ・セクション2（適格機関投資家限定）         | 124,466,527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） | 8,184,527,742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）  | 58,996,948円     |
| 日米コアバランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）                 | 51,939,021円     |
| 日本株式インデックスファンドS                            | 11,026,071,103円 |
| グローバルバランスオープンV（適格機関投資家限定）                  | 60,959,783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）        | 8,963,462,443円  |
| TOPIXインデックスファンドV（適格機関投資家限定）                | 7,574,780円      |
| パッシブバランスファンド（2%コース）（適格機関投資家転売制限付）          | 2,747,820円      |
| パッシブバランスファンド（5%コース）（適格機関投資家転売制限付）          | 49,218,883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）    | 63,312,841円     |
| MUKAM 日米コアバランス 2021-07（適格機関投資家限定）          | 166,425,299円    |

|                                                   | [2026年 6月25日現在]  |
|---------------------------------------------------|------------------|
| 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）           | 382,215,109円     |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンド                                  | 4,916,675,786円   |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA                        | 1,738,579円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA                      | 4,464,377円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA                        | 1,113,456円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA                        | 4,371,672円       |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1                               | 305,442,149円     |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンドVA                                | 43,227,778円      |
| 三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）                        | 1,377,227円       |
| 三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）                        | 9,855,698円       |
| 三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）                        | 720,838円         |
| 三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）                        | 8,904,732円       |
| 三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド                              | 1,483,877,653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）               | 203,001,873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）             | 948,855,323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）               | 963,401,362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）               | 992,691,113円     |
| 三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド                            | 56,957,999,169円  |
| 合計                                                | 566,498,146,277円 |
| 2. 貸付有価証券<br>貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っております。<br>株式 | 48,844,392,880円  |
| 3. 受益権の総数                                         | 566,498,146,277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 2025年 6月26日<br>至 2026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。<br>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。<br>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。<br>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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                         | [2026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<br>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。<br>（2）デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。<br>（3）上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。                                                                                                                                     |

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | [2026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 | 259,950,118,075    |
| 合計 | 259,950,118,075    |

(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

| [2026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<br>買建 | 24,680,844,900 | —     | 25,078,865,000 | 398,020,100 |
| 合計              |                | 24,680,844,900 | —     | 25,078,865,000 | 398,020,100 |

（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）

|              | [2026年 6月25日現在] |
|--------------|-----------------|
| 1口当たり純資産額    | 5.1694円         |
| (1万口当たり純資産額) | (51,694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         | 30,300  | 4,360.00 | 132,108,000 | 貸付有価証券<br>6,200株  |
| 1332 | ニッスイ       | 664,300 | 1,271.50 | 844,657,450 | 貸付有価証券<br>10,400株 |
| 1333 | Um i o s   | 351,900 | 1,284.00 | 451,839,600 | 貸付有価証券<br>4,800株  |
| 1375 | ユキグニファクトリー | 61,700  | 1,104.00 | 68,116,800  | 貸付有価証券<br>18,200株 |
| 1376 | カネコ種苗      | 20,500  | 1,447.00 | 29,663,500  | 貸付有価証券<br>6,100株  |
| 1377 | サカタのタネ     | 87,800  | 4,155.00 | 364,809,000 | 貸付有価証券<br>1,300株  |

|      |                 |           |           |               |                   |
|------|-----------------|-----------|-----------|---------------|-------------------|
| 1379 | ホクト             | 64,500    | 1,853.00  | 119,518,500   | 貸付有価証券<br>20,000株 |
| 1514 | 住石ホールディングス      | 65,000    | 526.00    | 34,190,000    | 貸付有価証券<br>19,200株 |
| 1515 | 日鉄鉱業            | 139,200   | 2,397.00  | 333,662,400   | 貸付有価証券<br>43,600株 |
| 1605 | I N P E X       | 2,433,700 | 3,287.00  | 7,999,571,900 | 貸付有価証券<br>6,800株  |
| 1662 | 石油資源開発          | 447,100   | 1,569.00  | 701,499,900   |                   |
| 1663 | K&Oエナジーグループ     | 32,900    | 3,815.00  | 125,513,500   | 貸付有価証券<br>100株    |
| 1414 | ショーボンドホールディングス  | 423,300   | 1,249.00  | 528,701,700   | 貸付有価証券<br>5,600株  |
| 1417 | ミライト・ワン         | 247,100   | 3,850.00  | 951,335,000   | 貸付有価証券<br>3,300株  |
| 1419 | タマホーム           | 45,500    | 2,752.00  | 125,216,000   | 貸付有価証券<br>14,200株 |
| 1716 | 第一カッター興業        | 18,600    | 1,372.00  | 25,519,200    | 貸付有価証券<br>5,500株  |
| 1719 | 安藤・間            | 384,900   | 1,731.50  | 666,454,350   | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 1720 | 東急建設            | 227,000   | 1,152.00  | 261,504,000   | 貸付有価証券<br>3,300株  |
| 1721 | コムシスホールディングス    | 228,100   | 5,350.00  | 1,220,335,000 | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 1762 | 高松コンストラクショングループ | 53,800    | 3,465.00  | 186,417,000   | 貸付有価証券<br>15,900株 |
| 1766 | 東建コーポレーション      | 15,600    | 12,440.00 | 194,064,000   | 貸付有価証券<br>4,900株  |
| 1780 | ヤマウラ            | 40,800    | 1,410.00  | 57,528,000    |                   |
| 1786 | オリエンタル白石        | 268,300   | 334.00    | 89,612,200    | 貸付有価証券<br>83,300株 |
| 1801 | 大成建設            | 378,500   | 13,705.00 | 5,187,342,500 | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 1802 | 大林組             | 1,604,600 | 3,117.00  | 5,001,538,200 | 貸付有価証券<br>24,000株 |
| 1803 | 清水建設            | 1,385,200 | 2,488.50  | 3,447,070,200 | 貸付有価証券<br>12,900株 |
| 1808 | 長谷工コーポレーション     | 452,300   | 2,761.00  | 1,248,800,300 | 貸付有価証券<br>6,700株  |
| 1810 | 松井建設            | 41,400    | 1,324.00  | 54,813,600    | 貸付有価証券<br>12,200株 |
| 1812 | 鹿島建設            | 1,124,000 | 5,670.00  | 6,373,080,000 | 貸付有価証券<br>16,200株 |
| 1813 | 不動テトラ           | 28,700    | 2,575.00  | 73,902,500    |                   |
| 1815 | 鉄建建設            | 31,800    | 4,345.00  | 138,171,000   | 貸付有価証券<br>9,900株  |
| 1820 | 西松建設            | 80,800    | 5,244.00  | 423,715,200   |                   |
| 1822 | 大豊建設            | 69,900    | 740.00    | 51,726,000    | 貸付有価証券<br>20,700株 |

|      |                |           |          |               |                   |
|------|----------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 1833 | 奥村組            | 82,200    | 5,590.00 | 459,498,000   | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 1835 | 東鉄工業           | 55,800    | 4,160.00 | 232,128,000   | 貸付有価証券<br>800株    |
| 1852 | 浅沼組            | 203,000   | 815.00   | 165,445,000   | 貸付有価証券<br>63,100株 |
| 1860 | 戸田建設           | 614,700   | 1,609.50 | 989,359,650   | 貸付有価証券<br>9,000株  |
| 1861 | 熊谷組            | 301,200   | 1,362.00 | 410,234,400   |                   |
| 1870 | 矢作建設工業         | 94,800    | 1,789.00 | 169,597,200   | 貸付有価証券<br>29,100株 |
| 1871 | ピーエス・コンストラクション | 45,900    | 2,151.00 | 98,730,900    | 貸付有価証券<br>14,200株 |
| 1873 | 日本ハウスホールディングス  | 108,200   | 305.00   | 33,001,000    | 貸付有価証券<br>33,600株 |
| 1879 | 新日本建設          | 71,200    | 2,092.00 | 148,950,400   | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 1882 | 東亜道路工業         | 77,900    | 1,515.00 | 118,018,500   | 貸付有価証券<br>24,400株 |
| 1885 | 東亜建設工業         | 187,100   | 2,043.00 | 382,245,300   | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 1887 | 日本国土開発         | 155,300   | 512.00   | 79,513,600    | 貸付有価証券<br>45,900株 |
| 1888 | 若築建設           | 15,000    | 3,205.00 | 48,075,000    | 貸付有価証券<br>4,400株  |
| 1893 | 五洋建設           | 718,700   | 1,675.50 | 1,204,181,850 | 貸付有価証券<br>9,600株  |
| 1898 | 世紀東急工業         | 79,600    | 1,429.00 | 113,748,400   | 貸付有価証券<br>24,600株 |
| 1899 | 福田組            | 17,400    | 7,540.00 | 131,196,000   |                   |
| 1911 | 住友林業           | 1,315,100 | 1,347.50 | 1,772,097,250 | 貸付有価証券<br>18,900株 |
| 1925 | 大和ハウス工業        | 1,402,500 | 4,351.00 | 6,102,277,500 | 貸付有価証券<br>800株    |
| 1926 | ライト工業          | 91,400    | 4,015.00 | 366,971,000   | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 1928 | 積水ハウス          | 1,510,800 | 3,280.00 | 4,955,424,000 | 貸付有価証券<br>22,100株 |
| 1929 | 日特建設           | 48,400    | 1,081.00 | 52,320,400    | 貸付有価証券<br>15,000株 |
| 1930 | 北陸電気工事         | 29,000    | 1,709.00 | 49,561,000    |                   |
| 1934 | ユアテック          | 107,000   | 2,406.00 | 257,442,000   |                   |
| 1938 | 日本リーテック        | 38,800    | 2,704.00 | 104,915,200   | 貸付有価証券<br>12,100株 |
| 1939 | 四電工            | 63,600    | 2,032.00 | 129,235,200   | 貸付有価証券<br>19,000株 |
| 1941 | 中電工            | 67,400    | 5,680.00 | 382,832,000   | 貸付有価証券<br>1,200株  |
| 1942 | 関電工            | 277,800   | 6,673.00 | 1,853,759,400 | 貸付有価証券<br>4,000株  |

|      |                 |         |          |               |                   |
|------|-----------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 1944 | きんでん            | 347,800 | 8,162.00 | 2,838,743,600 | 貸付有価証券<br>5,000株  |
| 1945 | 東京エネシス          | 45,000  | 2,180.00 | 98,100,000    | 貸付有価証券<br>800株    |
| 1946 | トーエネック          | 98,100  | 2,258.00 | 221,509,800   | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 1950 | 日本電設工業          | 95,200  | 4,375.00 | 416,500,000   | 貸付有価証券<br>29,000株 |
| 1951 | エクシオグループ        | 476,900 | 2,760.00 | 1,316,244,000 | 貸付有価証券<br>4,100株  |
| 1952 | 新日本空調           | 65,700  | 3,630.00 | 238,491,000   | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 1959 | クラフティア          | 109,600 | 9,496.00 | 1,040,761,600 | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 1961 | 三機工業            | 311,200 | 3,125.00 | 972,500,000   | 貸付有価証券<br>96,900株 |
| 1963 | 日揮ホールディングス      | 519,400 | 2,540.50 | 1,319,535,700 | 貸付有価証券<br>6,100株  |
| 1964 | 中外炉工業           | 13,600  | 4,035.00 | 54,876,000    |                   |
| 1968 | 太平電業            | 100,800 | 2,574.00 | 259,459,200   | 貸付有価証券<br>13,100株 |
| 1969 | 高砂熱学工業          | 271,500 | 4,973.00 | 1,350,169,500 | 貸付有価証券<br>3,600株  |
| 1975 | 朝日工業社           | 52,600  | 4,325.00 | 227,495,000   | 貸付有価証券<br>700株    |
| 1976 | 明星工業            | 85,200  | 1,833.00 | 156,171,600   | 貸付有価証券<br>26,500株 |
| 1979 | 大気社             | 122,700 | 4,935.00 | 605,524,500   | 貸付有価証券<br>1,900株  |
| 1980 | ダイダン            | 293,200 | 2,904.00 | 851,452,800   | 貸付有価証券<br>3,900株  |
| 1982 | 日比谷総合設備         | 68,000  | 3,090.00 | 210,120,000   | 貸付有価証券<br>1,200株  |
| 256A | 飛島ホールディングス      | 52,000  | 1,965.00 | 102,180,000   | 貸付有価証券<br>15,400株 |
| 3267 | フィル・カンパニー       | 8,900   | 668.00   | 5,945,200     | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 5074 | テスホールディングス      | 136,600 | 1,015.00 | 138,649,000   | 貸付有価証券<br>42,100株 |
| 5076 | インフロニア・ホールディングス | 531,200 | 2,704.00 | 1,436,364,800 | 貸付有価証券<br>7,700株  |
| 6330 | 東洋エンジニアリング      | 113,700 | 1,957.00 | 222,510,900   | 貸付有価証券<br>22,200株 |
| 6379 | レイズネクスト         | 73,300  | 2,216.00 | 162,432,800   | 貸付有価証券<br>21,700株 |
| 2001 | ニッポン            | 180,100 | 2,805.00 | 505,180,500   | 貸付有価証券<br>18,900株 |
| 2002 | 日清製粉グループ本社      | 490,700 | 1,960.00 | 961,772,000   |                   |
| 2003 | 日東富士製粉          | 36,300  | 1,701.00 | 61,746,300    | 貸付有価証券<br>4,600株  |
| 2004 | 昭和産業            | 43,000  | 3,360.00 | 144,480,000   |                   |

|      |                 |           |          |               |                   |
|------|-----------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 2053 | 中部飼料            | 64,600    | 1,861.00 | 120,220,600   | 貸付有価証券<br>300株    |
| 2060 | フィード・ワン         | 66,900    | 1,228.00 | 82,153,200    |                   |
| 2108 | 日本甜菜製糖          | 22,300    | 4,680.00 | 104,364,000   | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 2109 | DM三井製糖          | 42,600    | 3,215.00 | 136,959,000   | 貸付有価証券<br>13,300株 |
| 2117 | ウェルネオシュガー       | 28,500    | 2,580.00 | 73,530,000    | 貸付有価証券<br>8,400株  |
| 2201 | 森永製菓            | 199,700   | 2,559.50 | 511,132,150   |                   |
| 2204 | 中村屋             | 12,700    | 3,160.00 | 40,132,000    | 貸付有価証券<br>3,800株  |
| 2206 | 江崎グリコ           | 145,600   | 5,415.00 | 788,424,000   | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 2207 | me i t o        | 21,700    | 3,130.00 | 67,921,000    |                   |
| 2209 | 井村屋グループ         | 27,800    | 2,342.00 | 65,107,600    | 貸付有価証券<br>8,200株  |
| 2211 | 不二家             | 34,900    | 2,341.00 | 81,700,900    |                   |
| 2212 | 山崎製パン           | 340,600   | 3,145.00 | 1,071,187,000 |                   |
| 2217 | モロゾフ            | 47,700    | 1,520.00 | 72,504,000    | 貸付有価証券<br>14,900株 |
| 2220 | 亀田製菓            | 97,100    | 1,203.00 | 116,811,300   | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 2222 | 寿スピリッツ          | 270,800   | 2,445.50 | 662,241,400   | 貸付有価証券<br>4,400株  |
| 2229 | カルビー            | 233,000   | 2,863.00 | 667,079,000   | 貸付有価証券<br>3,400株  |
| 2264 | 森永乳業            | 183,200   | 4,887.00 | 895,298,400   | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 2266 | 六甲バター           | 41,500    | 1,068.00 | 44,322,000    |                   |
| 2267 | ヤクルト本社          | 655,500   | 2,725.50 | 1,786,565,250 | 貸付有価証券<br>10,200株 |
| 2269 | 明治ホールディングス      | 709,100   | 3,750.00 | 2,659,125,000 | 貸付有価証券<br>5,800株  |
| 2270 | 雪印メグミルク         | 123,400   | 3,635.00 | 448,559,000   |                   |
| 2281 | プリマハム           | 68,400    | 2,318.00 | 158,551,200   | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 2282 | 日本ハム            | 182,200   | 5,979.00 | 1,089,373,800 |                   |
| 2288 | 丸大食品            | 51,200    | 2,227.00 | 114,022,400   | 貸付有価証券<br>13,800株 |
| 2292 | S F o o d s     | 56,100    | 2,635.00 | 147,823,500   | 貸付有価証券<br>16,600株 |
| 2294 | 柿安本店            | 19,800    | 2,484.00 | 49,183,200    | 貸付有価証券<br>6,300株  |
| 2296 | 伊藤ハム米久ホールディングス  | 88,900    | 4,670.00 | 415,163,000   | 貸付有価証券<br>1,200株  |
| 2501 | サッポロホールディングス    | 761,500   | 2,038.50 | 1,552,317,750 |                   |
| 2502 | アサヒグループホールディングス | 3,821,800 | 1,540.00 | 5,885,572,000 | 貸付有価証券<br>54,800株 |
| 2503 | キリンホールディングス     | 1,892,600 | 2,815.50 | 5,328,615,300 |                   |

|      |                          |           |          |                |                   |
|------|--------------------------|-----------|----------|----------------|-------------------|
| 250A | シマダヤ                     | 23,500    | 1,631.00 | 38,328,500     | 貸付有価証券<br>6,900株  |
| 2531 | 宝ホールディングス                | 419,400   | 2,290.00 | 960,426,000    | 貸付有価証券<br>5,000株  |
| 2533 | オエノンホールディングス             | 152,100   | 485.00   | 73,768,500     | 貸付有価証券<br>45,000株 |
| 2579 | コカ・コーラ ボトラーズジャパン<br>ホールデ | 331,000   | 4,307.00 | 1,425,617,000  |                   |
| 2585 | ライフドリンク カンパニー            | 91,000    | 1,608.00 | 146,328,000    | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 2587 | サントリービバレッジ&フード           | 358,300   | 4,449.00 | 1,594,076,700  | 貸付有価証券<br>5,200株  |
| 2590 | ダイドーグループホールディングス         | 57,600    | 2,607.00 | 150,163,200    | 貸付有価証券<br>17,000株 |
| 2593 | 伊藤園                      | 164,700   | 2,836.50 | 467,171,550    |                   |
| 2594 | キーコーヒー                   | 57,000    | 1,965.00 | 112,005,000    | 貸付有価証券<br>16,900株 |
| 2602 | 日清オイリオグループ               | 202,600   | 1,828.00 | 370,352,800    |                   |
| 2607 | 不二製油                     | 101,600   | 3,890.00 | 395,224,000    | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 2613 | J-オイルミルズ                 | 58,300    | 2,031.00 | 118,407,300    | 貸付有価証券<br>900株    |
| 2801 | キッコーマン                   | 1,686,400 | 1,636.50 | 2,759,793,600  | 貸付有価証券<br>15,300株 |
| 2802 | 味の素                      | 2,456,700 | 5,742.00 | 14,106,371,400 | 貸付有価証券<br>7,200株  |
| 2804 | ブルドックソース                 | 25,500    | 1,717.00 | 43,783,500     | 貸付有価証券<br>7,600株  |
| 2809 | キューピー                    | 273,500   | 4,326.00 | 1,183,161,000  | 貸付有価証券<br>4,000株  |
| 2810 | ハウス食品グループ本社              | 190,400   | 3,690.00 | 702,576,000    | 貸付有価証券<br>2,500株  |
| 2811 | カゴメ                      | 264,200   | 2,581.00 | 681,900,200    |                   |
| 2815 | アリアケジャパン                 | 57,100    | 4,995.00 | 285,214,500    | 貸付有価証券<br>800株    |
| 2819 | エバラ食品工業                  | 12,900    | 2,371.00 | 30,585,900     | 貸付有価証券<br>3,800株  |
| 2871 | ニチレイ                     | 447,000   | 2,148.00 | 960,156,000    | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 2875 | 東洋水産                     | 235,700   | 9,833.00 | 2,317,638,100  | 貸付有価証券<br>3,400株  |
| 2882 | イトーアンドホールディングス           | 24,100    | 2,012.00 | 48,489,200     | 貸付有価証券<br>7,500株  |
| 2884 | ヨシムラ・フード・ホールディングス        | 37,200    | 610.00   | 22,692,000     |                   |
| 2897 | 日清食品ホールディングス             | 575,200   | 2,732.50 | 1,571,734,000  | 貸付有価証券<br>7,100株  |
| 2908 | フジッコ                     | 58,100    | 1,498.00 | 87,033,800     | 貸付有価証券<br>18,000株 |
| 2910 | ロック・フィールド                | 57,000    | 1,316.00 | 75,012,000     | 貸付有価証券<br>900株    |

|      |                |           |           |                |                    |
|------|----------------|-----------|-----------|----------------|--------------------|
| 2914 | 日本たばこ産業        | 3,092,500 | 5,948.00  | 18,394,190,000 | 貸付有価証券<br>44,300株  |
| 2915 | ケンコーマヨネーズ      | 31,800    | 2,010.00  | 63,918,000     | 貸付有価証券<br>9,400株   |
| 2918 | わらべや日洋ホールディングス | 34,100    | 2,562.00  | 87,364,200     | 貸付有価証券<br>10,100株  |
| 2922 | なとり            | 32,000    | 1,915.00  | 61,280,000     | 貸付有価証券<br>9,400株   |
| 2929 | ファーマフーズ        | 61,800    | 543.00    | 33,557,400     | 貸付有価証券<br>18,300株  |
| 2931 | ユーグレナ          | 349,900   | 320.00    | 111,968,000    | 貸付有価証券<br>109,900株 |
| 2933 | 紀文食品           | 44,100    | 1,055.00  | 46,525,500     | 貸付有価証券<br>13,100株  |
| 2935 | ピククルスホールディングス  | 29,800    | 1,100.00  | 32,780,000     | 貸付有価証券<br>8,800株   |
| 409A | オリオンビール        | 114,600   | 1,196.00  | 137,061,600    | 貸付有価証券<br>24,800株  |
| 4526 | 理研ビタミン         | 44,500    | 3,075.00  | 136,837,500    | 貸付有価証券<br>13,800株  |
| 3001 | 片倉工業           | 54,500    | 2,363.00  | 128,783,500    | 貸付有価証券<br>16,900株  |
| 3002 | グンゼ            | 73,300    | 3,870.00  | 283,671,000    | 貸付有価証券<br>21,700株  |
| 3103 | ユニチカ           | 178,600   | 1,070.00  | 191,102,000    | 貸付有価証券<br>52,800株  |
| 3104 | 富士紡ホールディングス    | 72,400    | 4,290.00  | 310,596,000    | 貸付有価証券<br>22,300株  |
| 3106 | 倉敷紡績           | 36,100    | 10,260.00 | 370,386,000    | 貸付有価証券<br>11,200株  |
| 3109 | シキボウ           | 34,700    | 1,018.00  | 35,324,600     | 貸付有価証券<br>10,300株  |
| 3201 | 日本毛織           | 129,200   | 1,689.00  | 218,218,800    | 貸付有価証券<br>40,200株  |
| 3302 | 帝国繊維           | 53,300    | 3,380.00  | 180,154,000    | 貸付有価証券<br>16,600株  |
| 3401 | 帝人             | 459,100   | 1,631.00  | 748,792,100    | 貸付有価証券<br>7,200株   |
| 3402 | 東レ             | 3,489,500 | 1,158.00  | 4,040,841,000  | 貸付有価証券<br>54,300株  |
| 3569 | セーレン           | 112,400   | 3,270.00  | 367,548,000    | 貸付有価証券<br>1,700株   |
| 3580 | 小松マテーレ         | 68,300    | 706.00    | 48,219,800     | 貸付有価証券<br>20,200株  |
| 3591 | ワコールホールディングス   | 101,500   | 4,387.00  | 445,280,500    | 貸付有価証券<br>1,500株   |
| 3608 | T S I ホールディングス | 134,900   | 1,149.00  | 155,000,100    | 貸付有価証券<br>2,300株   |
| 3612 | ワールド           | 171,000   | 1,572.00  | 268,812,000    |                    |
| 8011 | 三陽商会           | 24,200    | 3,950.00  | 95,590,000     | 貸付有価証券<br>7,100株   |

|      |                |           |           |               |                   |
|------|----------------|-----------|-----------|---------------|-------------------|
| 8016 | オンワードホールディングス  | 301,700   | 723.00    | 218,129,100   | 貸付有価証券<br>4,900株  |
| 8029 | ルックホールディングス    | 16,600    | 2,655.00  | 44,073,000    | 貸付有価証券<br>4,900株  |
| 8111 | ゴールドウイン        | 302,600   | 2,168.50  | 656,188,100   | 貸付有価証券<br>3,100株  |
| 3708 | 特種東海製紙         | 90,500    | 1,812.00  | 163,986,000   | 貸付有価証券<br>28,000株 |
| 3861 | 王子ホールディングス     | 1,960,600 | 781.50    | 1,532,208,900 | 貸付有価証券<br>5,500株  |
| 3863 | 日本製紙           | 292,100   | 1,246.00  | 363,956,600   | 貸付有価証券<br>90,300株 |
| 3865 | 北越コーポレーション     | 252,100   | 872.00    | 219,831,200   | 貸付有価証券<br>75,800株 |
| 3880 | 大王製紙           | 261,300   | 916.00    | 239,350,800   | 貸付有価証券<br>3,800株  |
| 3941 | レンゴー           | 543,900   | 1,407.50  | 765,539,250   | 貸付有価証券<br>6,800株  |
| 3946 | トーモク           | 29,900    | 3,870.00  | 115,713,000   | 貸付有価証券<br>9,400株  |
| 3950 | ザ・パックス         | 103,900   | 1,371.00  | 142,446,900   | 貸付有価証券<br>17,000株 |
| 2930 | 北の達人コーポレーション   | 218,100   | 114.00    | 24,863,400    | 貸付有価証券<br>64,400株 |
| 3101 | 東洋紡            | 223,800   | 1,720.00  | 384,936,000   | 貸付有価証券<br>3,300株  |
| 3405 | クラレ            | 654,800   | 1,699.50  | 1,112,832,600 | 貸付有価証券<br>9,900株  |
| 3407 | 旭化成            | 3,431,700 | 1,794.00  | 6,156,469,800 | 貸付有価証券<br>49,200株 |
| 4004 | レゾナック・ホールディングス | 500,300   | 17,770.00 | 8,890,331,000 |                   |
| 4005 | 住友化学           | 4,165,800 | 520.60    | 2,168,715,480 | 貸付有価証券<br>15,600株 |
| 4008 | 住友精化           | 108,200   | 1,291.00  | 139,686,200   | 貸付有価証券<br>34,000株 |
| 4021 | 日産化学           | 260,500   | 8,534.00  | 2,223,107,000 | 貸付有価証券<br>3,800株  |
| 4022 | ラサ工業           | 84,500    | 2,299.00  | 194,265,500   | 貸付有価証券<br>25,200株 |
| 4023 | クレハ            | 77,200    | 3,800.00  | 293,360,000   | 貸付有価証券<br>24,300株 |
| 4025 | 多木化学           | 20,100    | 4,715.00  | 94,771,500    | 貸付有価証券<br>6,000株  |
| 4027 | テイカ            | 37,000    | 2,342.00  | 86,654,000    | 貸付有価証券<br>600株    |
| 4028 | 石原産業           | 85,900    | 2,963.00  | 254,521,700   |                   |
| 4041 | 日本曹達           | 106,900   | 3,555.00  | 380,029,500   |                   |
| 4042 | 東ソー            | 754,000   | 2,952.50  | 2,226,185,000 | 貸付有価証券<br>10,000株 |
| 4043 | トクヤマ           | 181,100   | 5,150.00  | 932,665,000   | 貸付有価証券<br>2,400株  |

|      |              |           |           |                |                   |
|------|--------------|-----------|-----------|----------------|-------------------|
| 4044 | セントラル硝子      | 65,300    | 4,505.00  | 294,176,500    | 貸付有価証券<br>20,300株 |
| 4045 | 東亜合成         | 208,700   | 1,782.50  | 372,007,750    | 貸付有価証券<br>3,200株  |
| 4046 | 大阪ソーダ        | 180,800   | 1,889.00  | 341,531,200    | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 4047 | 関東電化工業       | 100,100   | 4,055.00  | 405,905,500    | 貸付有価証券<br>100株    |
| 4061 | デンカ          | 205,400   | 4,437.00  | 911,359,800    | 貸付有価証券<br>600株    |
| 4063 | 信越化学工業       | 4,604,000 | 7,150.00  | 32,918,600,000 | 貸付有価証券<br>66,000株 |
| 4064 | 日本カーバイド工業    | 25,500    | 3,740.00  | 95,370,000     |                   |
| 4078 | 堺化学工業        | 40,200    | 5,110.00  | 205,422,000    |                   |
| 4082 | 第一稀元素化学工業    | 51,900    | 2,148.00  | 111,481,200    | 貸付有価証券<br>15,300株 |
| 4091 | 日本酸素ホールディングス | 586,000   | 5,673.00  | 3,324,378,000  |                   |
| 4092 | 日本化学工業       | 20,700    | 5,270.00  | 109,089,000    | 貸付有価証券<br>300株    |
| 4095 | 日本パーカライジング   | 256,300   | 1,728.00  | 442,886,400    | 貸付有価証券<br>3,400株  |
| 4097 | 高圧ガス工業       | 75,200    | 1,124.00  | 84,524,800     | 貸付有価証券<br>23,400株 |
| 4099 | 四国化成ホールディングス | 58,500    | 7,290.00  | 426,465,000    |                   |
| 4100 | 戸田工業         | 11,800    | 1,826.00  | 21,546,800     | 貸付有価証券<br>3,600株  |
| 4109 | ステラ ケミファ     | 27,600    | 6,820.00  | 188,232,000    | 貸付有価証券<br>400株    |
| 4112 | 保土谷化学工業      | 32,500    | 2,154.00  | 70,005,000     | 貸付有価証券<br>500株    |
| 4114 | 日本触媒         | 318,900   | 2,085.50  | 665,065,950    | 貸付有価証券<br>4,800株  |
| 4116 | 大日精化工業       | 140,000   | 1,055.00  | 147,700,000    | 貸付有価証券<br>43,800株 |
| 4118 | カネカ          | 121,800   | 5,763.00  | 701,933,400    | 貸付有価証券<br>1,900株  |
| 4182 | 三菱瓦斯化学       | 368,200   | 5,273.00  | 1,941,518,600  | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 4183 | 三井化学         | 931,700   | 2,187.00  | 2,037,627,900  | 貸付有価証券<br>13,400株 |
| 4186 | 東京応化工業       | 247,000   | 11,515.00 | 2,844,205,000  | 貸付有価証券<br>3,600株  |
| 4187 | 大阪有機化学工業     | 43,300    | 5,900.00  | 255,470,000    | 貸付有価証券<br>700株    |
| 4188 | 三菱ケミカルグループ   | 3,622,000 | 1,095.00  | 3,966,090,000  | 貸付有価証券<br>54,300株 |
| 4189 | KHネオケム       | 86,200    | 2,961.00  | 255,238,200    | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 4202 | ダイセル         | 567,600   | 1,345.50  | 763,705,800    | 貸付有価証券<br>4,200株  |

|      |           |           |           |               |                   |
|------|-----------|-----------|-----------|---------------|-------------------|
| 4203 | 住友ベークライト  | 170,600   | 7,592.00  | 1,295,195,200 | 貸付有価証券<br>2,400株  |
| 4204 | 積水化学工業    | 1,081,700 | 2,546.50  | 2,754,549,050 | 貸付有価証券<br>6,400株  |
| 4205 | 日本ゼオン     | 364,000   | 2,424.50  | 882,518,000   |                   |
| 4206 | アイカ工業     | 130,600   | 3,660.00  | 477,996,000   | 貸付有価証券<br>800株    |
| 4208 | UBE       | 266,800   | 3,181.00  | 848,690,800   |                   |
| 4212 | 積水樹脂      | 61,500    | 2,523.00  | 155,164,500   | 貸付有価証券<br>19,200株 |
| 4216 | 旭有機材      | 34,400    | 7,590.00  | 261,096,000   | 貸付有価証券<br>200株    |
| 4218 | ニチバン      | 32,100    | 1,849.00  | 59,352,900    | 貸付有価証券<br>10,000株 |
| 4220 | リケンテクノス   | 89,200    | 1,696.00  | 151,283,200   | 貸付有価証券<br>27,700株 |
| 4221 | 大倉工業      | 26,400    | 4,935.00  | 130,284,000   | 貸付有価証券<br>7,800株  |
| 4228 | 積水化成品工業   | 81,700    | 560.00    | 45,752,000    | 貸付有価証券<br>24,200株 |
| 4229 | 群栄化学工業    | 12,200    | 4,670.00  | 56,974,000    |                   |
| 4246 | ダイキョーニシカワ | 109,800   | 1,010.00  | 110,898,000   | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 4249 | 森六        | 27,900    | 2,343.00  | 65,369,700    | 貸付有価証券<br>8,200株  |
| 4251 | 恵和        | 33,500    | 1,237.00  | 41,439,500    |                   |
| 4272 | 日本化薬      | 371,100   | 2,057.50  | 763,538,250   | 貸付有価証券<br>4,900株  |
| 4275 | カーリット     | 44,300    | 2,134.00  | 94,536,200    | 貸付有価証券<br>13,300株 |
| 4362 | 日本精化      | 32,200    | 2,570.00  | 82,754,000    | 貸付有価証券<br>500株    |
| 4368 | 扶桑化学工業    | 164,700   | 4,815.00  | 793,030,500   | 貸付有価証券<br>2,100株  |
| 4369 | トリケミカル研究所 | 62,800    | 3,615.00  | 227,022,000   | 貸付有価証券<br>18,600株 |
| 4401 | ADEKA     | 200,600   | 4,353.00  | 873,211,800   | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 4403 | 日油        | 594,300   | 2,582.50  | 1,534,779,750 | 貸付有価証券<br>8,600株  |
| 4410 | ハリマ化成グループ | 40,300    | 1,077.00  | 43,403,100    | 貸付有価証券<br>12,500株 |
| 4452 | 花王        | 1,227,400 | 6,241.00  | 7,660,203,400 | 貸付有価証券<br>18,100株 |
| 4461 | 第一工業製薬    | 20,700    | 12,760.00 | 264,132,000   | 貸付有価証券<br>300株    |
| 4462 | 石原ケミカル    | 22,000    | 3,495.00  | 76,890,000    | 貸付有価証券<br>6,500株  |
| 4471 | 三洋化成工業    | 31,800    | 5,020.00  | 159,636,000   | 貸付有価証券<br>9,400株  |

|      |                  |           |           |                |                   |
|------|------------------|-----------|-----------|----------------|-------------------|
| 4611 | 大日本塗料            | 57,400    | 1,331.00  | 76,399,400     | 貸付有価証券<br>17,000株 |
| 4612 | 日本ペイントホールディングス   | 2,749,100 | 1,049.00  | 2,883,805,900  |                   |
| 4613 | 関西ペイント           | 412,800   | 2,648.00  | 1,093,094,400  | 貸付有価証券<br>6,000株  |
| 4617 | 中国塗料             | 106,300   | 3,410.00  | 362,483,000    | 貸付有価証券<br>33,200株 |
| 4620 | 藤倉化成             | 59,600    | 1,079.00  | 64,308,400     | 貸付有価証券<br>17,600株 |
| 4626 | 太陽ホールディングス       | 248,400   | 5,050.00  | 1,254,420,000  |                   |
| 4631 | D I C            | 183,900   | 5,148.00  | 946,717,200    |                   |
| 4633 | サカタインクス          | 115,200   | 2,445.00  | 281,664,000    |                   |
| 4634 | a r t i e n c e  | 97,200    | 4,370.00  | 424,764,000    | 貸付有価証券<br>30,200株 |
| 4901 | 富士フイルムホールディングス   | 3,125,500 | 3,413.00  | 10,667,331,500 |                   |
| 4911 | 資生堂              | 1,005,100 | 2,500.00  | 2,512,750,000  | 貸付有価証券<br>10,800株 |
| 4912 | ライオン             | 594,900   | 1,697.50  | 1,009,842,750  | 貸付有価証券<br>8,600株  |
| 4914 | 高砂香料工業           | 194,800   | 1,121.00  | 218,370,800    | 貸付有価証券<br>59,300株 |
| 4919 | ミルボン             | 81,200    | 2,667.00  | 216,560,400    | 貸付有価証券<br>3,400株  |
| 4922 | コーセーホールディングス     | 117,100   | 5,000.00  | 585,500,000    | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 4923 | コタ               | 56,300    | 1,138.00  | 64,069,400     | 貸付有価証券<br>16,700株 |
| 4927 | ポーラ・オルビスホールディングス | 265,700   | 1,255.50  | 333,586,350    |                   |
| 4928 | ノエビアホールディングス     | 46,200    | 4,320.00  | 199,584,000    | 貸付有価証券<br>13,900株 |
| 4931 | 新日本製薬            | 29,600    | 1,939.00  | 57,394,400     | 貸付有価証券<br>8,800株  |
| 4933 | I - n e          | 13,700    | 1,255.00  | 17,193,500     | 貸付有価証券<br>4,100株  |
| 4936 | アクシージア           | 28,000    | 319.00    | 8,932,000      | 貸付有価証券<br>9,100株  |
| 4951 | エステー             | 48,900    | 1,482.00  | 72,469,800     | 貸付有価証券<br>15,100株 |
| 4956 | コニシ              | 163,300   | 1,498.00  | 244,623,400    | 貸付有価証券<br>50,700株 |
| 4958 | 長谷川香料            | 99,100    | 3,270.00  | 324,057,000    | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 4967 | 小林製薬             | 135,800   | 5,544.00  | 752,875,200    |                   |
| 4968 | 荒川化学工業           | 43,900    | 2,222.00  | 97,545,800     | 貸付有価証券<br>13,700株 |
| 4971 | メック              | 37,800    | 11,300.00 | 427,140,000    | 貸付有価証券<br>600株    |
| 4973 | 日本高純度化学          | 12,900    | 5,830.00  | 75,207,000     |                   |
| 4975 | J C U            | 55,700    | 8,000.00  | 445,600,000    | 貸付有価証券<br>17,400株 |

|      |            |           |          |                |                   |
|------|------------|-----------|----------|----------------|-------------------|
| 4979 | ＯＡＴアグリオ    | 19,300    | 2,592.00 | 50,025,600     | 貸付有価証券<br>6,000株  |
| 4980 | デクセリアルズ    | 439,100   | 5,021.00 | 2,204,721,100  | 貸付有価証券<br>6,400株  |
| 4985 | アース製薬      | 47,200    | 4,690.00 | 221,368,000    | 貸付有価証券<br>14,700株 |
| 4992 | 北興化学工業     | 37,200    | 2,245.00 | 83,514,000     |                   |
| 4994 | 大成ラミックグループ | 15,000    | 2,372.00 | 35,580,000     | 貸付有価証券<br>4,400株  |
| 4996 | クミアイ化学工業   | 231,700   | 733.00   | 169,836,100    | 貸付有価証券<br>68,600株 |
| 4997 | 日本農薬       | 79,200    | 1,020.00 | 80,784,000     | 貸付有価証券<br>23,400株 |
| 5142 | アキレス       | 28,100    | 1,166.00 | 32,764,600     | 貸付有価証券<br>8,800株  |
| 5208 | 有沢製作所      | 90,900    | 2,631.00 | 239,157,900    | 貸付有価証券<br>28,100株 |
| 6988 | 日東電工       | 1,574,100 | 3,213.00 | 5,057,583,300  | 貸付有価証券<br>23,500株 |
| 7874 | レック        | 51,600    | 911.00   | 47,007,600     | 貸付有価証券<br>15,300株 |
| 7888 | 三光合成       | 65,200    | 763.00   | 49,747,600     | 貸付有価証券<br>19,300株 |
| 7917 | ZACROS     | 163,900   | 1,339.00 | 219,462,100    | 貸付有価証券<br>2,400株  |
| 7931 | 未来工業       | 24,700    | 3,025.00 | 74,717,500     | 貸付有価証券<br>7,300株  |
| 7942 | J S P      | 30,400    | 2,542.00 | 77,276,800     |                   |
| 7947 | エフピコ       | 98,100    | 2,614.00 | 256,433,400    | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 7970 | 信越ポリマー     | 111,800   | 2,372.00 | 265,189,600    | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 7988 | ニフコ        | 193,700   | 4,771.00 | 924,142,700    | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 7995 | バルカー       | 43,300    | 7,680.00 | 332,544,000    | 貸付有価証券<br>600株    |
| 8113 | ユニ・チャーム    | 3,239,900 | 934.60   | 3,028,010,540  | 貸付有価証券<br>11,400株 |
| 4151 | 協和キリン      | 609,600   | 2,559.50 | 1,560,271,200  | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 4502 | 武田薬品工業     | 4,613,500 | 5,054.00 | 23,316,629,000 | 貸付有価証券<br>66,100株 |
| 4503 | アステラス製薬    | 4,547,100 | 2,147.00 | 9,762,623,700  | 貸付有価証券<br>65,200株 |
| 4506 | 住友ファーマ     | 520,900   | 1,493.50 | 777,964,150    |                   |
| 4507 | 塩野義製薬      | 1,891,500 | 2,718.50 | 5,142,042,750  | 貸付有価証券<br>4,400株  |
| 4516 | 日本新薬       | 135,800   | 4,037.00 | 548,224,600    | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 4519 | 中外製薬       | 1,622,700 | 7,534.00 | 12,225,421,800 | 貸付有価証券<br>23,300株 |

|      |                 |           |           |                |                    |
|------|-----------------|-----------|-----------|----------------|--------------------|
| 4521 | 科研製薬            | 76,800    | 3,845.00  | 295,296,000    | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 4523 | エーザイ            | 676,500   | 3,949.00  | 2,671,498,500  |                    |
| 4527 | ロート製薬           | 547,800   | 2,355.00  | 1,290,069,000  | 貸付有価証券<br>7,900株   |
| 4528 | 小野薬品工業          | 1,156,700 | 2,340.50  | 2,707,256,350  | 貸付有価証券<br>15,200株  |
| 4534 | 持田製薬            | 63,300    | 3,140.00  | 198,762,000    | 貸付有価証券<br>1,000株   |
| 4536 | 参天製薬            | 872,100   | 2,128.00  | 1,855,828,800  | 貸付有価証券<br>5,400株   |
| 4538 | 扶桑薬品工業          | 20,100    | 2,064.00  | 41,486,400     | 貸付有価証券<br>5,900株   |
| 4540 | ツムラ             | 178,000   | 3,697.00  | 658,066,000    | 貸付有価証券<br>2,600株   |
| 4547 | キッセイ薬品工業        | 81,000    | 4,035.00  | 326,835,000    |                    |
| 4548 | 生化学工業           | 87,800    | 714.00    | 62,689,200     |                    |
| 4549 | 栄研化学            | 73,400    | 2,489.00  | 182,692,600    | 貸付有価証券<br>22,900株  |
| 4552 | J C Rファーマ       | 225,600   | 454.00    | 102,422,400    | 貸付有価証券<br>2,600株   |
| 4553 | 東和薬品            | 69,700    | 3,835.00  | 267,299,500    | 貸付有価証券<br>1,700株   |
| 4554 | 富士製薬工業          | 41,000    | 2,151.00  | 88,191,000     | 貸付有価証券<br>12,700株  |
| 4559 | ゼリア新薬工業         | 67,800    | 2,026.00  | 137,362,800    |                    |
| 4565 | ネクセラファーマ        | 227,400   | 937.00    | 213,073,800    | 貸付有価証券<br>49,500株  |
| 4568 | 第一三共            | 4,759,900 | 2,566.50  | 12,216,283,350 | 貸付有価証券<br>63,300株  |
| 4569 | 杏林製薬            | 104,300   | 1,143.00  | 119,214,900    | 貸付有価証券<br>14,700株  |
| 4574 | 大幸薬品            | 107,700   | 273.00    | 29,402,100     | 貸付有価証券<br>33,400株  |
| 4577 | ダイト             | 64,000    | 1,241.00  | 79,424,000     | 貸付有価証券<br>18,900株  |
| 4578 | 大塚ホールディングス      | 1,154,500 | 10,840.00 | 12,514,780,000 | 貸付有価証券<br>9,300株   |
| 4587 | ペプチドリーム         | 251,300   | 997.30    | 250,621,490    |                    |
| 4880 | セルソース           | 30,700    | 304.00    | 9,332,800      | 貸付有価証券<br>9,100株   |
| 4886 | あすか製薬ホールディングス   | 50,000    | 2,237.00  | 111,850,000    | 貸付有価証券<br>700株     |
| 4887 | サワイグループホールディングス | 267,900   | 1,650.50  | 442,168,950    | 貸付有価証券<br>1,600株   |
| 3315 | 日本コークス工業        | 526,000   | 93.00     | 48,918,000     | 貸付有価証券<br>155,400株 |
| 5011 | ニチレキグループ        | 55,100    | 2,128.00  | 117,252,800    | 貸付有価証券<br>17,100株  |
| 5013 | ユシロ             | 26,900    | 2,898.00  | 77,956,200     | 貸付有価証券<br>8,400株   |

|      |                  |           |           |               |                   |
|------|------------------|-----------|-----------|---------------|-------------------|
| 5019 | 出光興産             | 2,127,900 | 1,209.50  | 2,573,695,050 | 貸付有価証券<br>18,000株 |
| 5020 | ENEOSホールディングス    | 7,324,400 | 1,191.00  | 8,723,360,400 | 貸付有価証券<br>15,300株 |
| 5021 | コスモエネルギーホールディングス | 287,100   | 3,674.00  | 1,054,805,400 | 貸付有価証券<br>5,000株  |
| 5101 | 横浜ゴム             | 289,500   | 7,577.00  | 2,193,541,500 | 貸付有価証券<br>4,200株  |
| 5105 | TOYO TIRE        | 327,700   | 3,799.00  | 1,244,932,300 | 貸付有価証券<br>4,700株  |
| 5108 | ブリヂストン           | 2,836,300 | 3,425.00  | 9,714,327,500 | 貸付有価証券<br>28,200株 |
| 5110 | 住友ゴム工業           | 559,300   | 2,175.50  | 1,216,757,150 | 貸付有価証券<br>4,700株  |
| 5121 | 藤倉コンポジット         | 42,700    | 2,575.00  | 109,952,500   | 貸付有価証券<br>800株    |
| 5122 | オカモト             | 27,400    | 5,320.00  | 145,768,000   | 貸付有価証券<br>8,500株  |
| 5185 | フコク              | 24,600    | 1,786.00  | 43,935,600    |                   |
| 5186 | ニッタ              | 50,900    | 6,250.00  | 318,125,000   | 貸付有価証券<br>15,900株 |
| 5192 | 三ツ星ベルト           | 66,100    | 3,960.00  | 261,756,000   | 貸付有価証券<br>20,700株 |
| 5195 | バンドー化学           | 76,900    | 2,218.00  | 170,564,200   | 貸付有価証券<br>24,000株 |
| 3110 | 日東紡績             | 65,600    | 20,440.00 | 1,340,864,000 | 貸付有価証券<br>900株    |
| 5201 | A G C            | 504,300   | 7,264.00  | 3,663,235,200 | 貸付有価証券<br>7,300株  |
| 5202 | 日本板硝子            | 301,800   | 474.00    | 143,053,200   |                   |
| 5214 | 日本電気硝子           | 173,000   | 6,697.00  | 1,158,581,000 | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 5218 | オハラ              | 19,700    | 1,601.00  | 31,539,700    | 貸付有価証券<br>300株    |
| 5232 | 住友大阪セメント         | 86,800    | 6,372.00  | 553,089,600   | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 5233 | 太平洋セメント          | 319,800   | 4,092.00  | 1,308,621,600 | 貸付有価証券<br>4,600株  |
| 5262 | 日本ヒューム           | 90,800    | 1,010.00  | 91,708,000    | 貸付有価証券<br>26,800株 |
| 5269 | 日本コンクリート工業       | 100,500   | 323.00    | 32,461,500    | 貸付有価証券<br>29,700株 |
| 5273 | 三谷セキサン           | 85,200    | 1,466.00  | 124,903,200   |                   |
| 5288 | アジアパイルホールディングス   | 81,000    | 1,485.00  | 120,285,000   | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 5301 | 東海カーボン           | 521,700   | 1,719.00  | 896,802,300   | 貸付有価証券<br>7,500株  |
| 5302 | 日本カーボン           | 29,700    | 4,685.00  | 139,144,500   | 貸付有価証券<br>9,300株  |
| 5310 | 東洋炭素             | 44,600    | 7,920.00  | 353,232,000   |                   |

|      |               |            |           |               |                    |
|------|---------------|------------|-----------|---------------|--------------------|
| 5331 | ノリタケ          | 108,600    | 4,340.00  | 471,324,000   | 貸付有価証券<br>1,800株   |
| 5332 | TOTO          | 321,500    | 8,868.00  | 2,851,062,000 |                    |
| 5333 | NGK           | 564,900    | 7,853.00  | 4,436,159,700 | 貸付有価証券<br>8,300株   |
| 5334 | 日本特殊陶業        | 423,600    | 10,860.00 | 4,600,296,000 | 貸付有価証券<br>3,700株   |
| 5344 | MARUWA        | 21,500     | 69,080.00 | 1,485,220,000 | 貸付有価証券<br>100株     |
| 5351 | 品川リフラ         | 63,800     | 1,894.00  | 120,837,200   | 貸付有価証券<br>19,900株  |
| 5357 | ヨータイ          | 30,300     | 1,750.00  | 53,025,000    | 貸付有価証券<br>9,000株   |
| 5384 | フジミインコーポレーテッド | 154,800    | 4,720.00  | 730,656,000   | 貸付有価証券<br>31,600株  |
| 5393 | ニチアス          | 406,100    | 4,063.00  | 1,649,984,300 | 貸付有価証券<br>5,700株   |
| 7943 | ニチハ           | 60,000     | 3,070.00  | 184,200,000   | 貸付有価証券<br>1,000株   |
| 5401 | 日本製鉄          | 14,540,900 | 547.00    | 7,953,872,300 | 貸付有価証券<br>124,500株 |
| 5406 | 神戸製鋼所         | 1,072,500  | 1,875.00  | 2,010,937,500 |                    |
| 5408 | 中山製鋼所         | 109,700    | 602.00    | 66,039,400    | 貸付有価証券<br>32,500株  |
| 5410 | 合同製鐵          | 29,800     | 2,567.00  | 76,496,600    | 貸付有価証券<br>8,800株   |
| 5411 | JFEホールディングス   | 1,730,300  | 1,546.00  | 2,675,043,800 |                    |
| 5423 | 東京製鐵          | 148,900    | 1,678.00  | 249,854,200   | 貸付有価証券<br>2,200株   |
| 5440 | 共英製鋼          | 60,700     | 1,707.00  | 103,614,900   | 貸付有価証券<br>18,800株  |
| 5444 | 大和工業          | 95,900     | 12,100.00 | 1,160,390,000 | 貸付有価証券<br>400株     |
| 5445 | 東京鐵鋼          | 58,800     | 1,809.00  | 106,369,200   | 貸付有価証券<br>17,400株  |
| 5449 | 大阪製鐵          | 24,500     | 2,284.00  | 55,958,000    | 貸付有価証券<br>7,200株   |
| 5451 | ヨドコウ          | 302,000    | 1,268.00  | 382,936,000   | 貸付有価証券<br>92,800株  |
| 5461 | 中部鋼鈑          | 48,700     | 1,962.00  | 95,549,400    | 貸付有価証券<br>15,100株  |
| 5463 | 丸一鋼管          | 535,800    | 1,647.50  | 882,730,500   | 貸付有価証券<br>7,200株   |
| 5464 | モリ工業          | 60,000     | 930.00    | 55,800,000    | 貸付有価証券<br>17,800株  |
| 5471 | 大同特殊鋼         | 377,900    | 2,958.00  | 1,117,828,200 | 貸付有価証券<br>4,900株   |
| 5480 | 日本冶金工業        | 35,900     | 4,790.00  | 171,961,000   | 貸付有価証券<br>11,200株  |
| 5482 | 愛知製鋼          | 99,800     | 3,045.00  | 303,891,000   | 貸付有価証券<br>29,700株  |

|      |                |           |           |                |                   |
|------|----------------|-----------|-----------|----------------|-------------------|
| 5541 | 大太平洋金属         | 45,400    | 2,171.00  | 98,563,400     | 貸付有価証券<br>13,400株 |
| 5563 | 新日本電工          | 292,100   | 464.00    | 135,534,400    |                   |
| 5602 | 栗本鐵工所          | 123,700   | 1,392.00  | 172,190,400    | 貸付有価証券<br>38,600株 |
| 5632 | 三菱製鋼           | 36,400    | 2,217.00  | 80,698,800     | 貸付有価証券<br>7,800株  |
| 5659 | 日本精線           | 42,300    | 1,440.00  | 60,912,000     |                   |
| 5698 | エンビプロ・ホールディングス | 46,900    | 833.00    | 39,067,700     | 貸付有価証券<br>13,800株 |
| 5016 | J X金属          | 2,041,700 | 4,887.00  | 9,977,787,900  | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 5702 | 大紀アルミニウム工業所    | 75,900    | 1,526.00  | 115,823,400    | 貸付有価証券<br>23,600株 |
| 5703 | 日本軽金属ホールディングス  | 155,800   | 2,822.00  | 439,667,600    | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 5706 | 三井金属           | 133,200   | 46,390.00 | 6,179,148,000  |                   |
| 5707 | 東邦亜鉛           | 47,200    | 787.00    | 37,146,400     | 貸付有価証券<br>14,000株 |
| 5711 | 三菱マテリアル        | 355,800   | 4,424.00  | 1,574,059,200  | 貸付有価証券<br>5,500株  |
| 5713 | 住友金属鉱山         | 730,700   | 7,653.00  | 5,592,047,100  | 貸付有価証券<br>5,400株  |
| 5714 | DOWAホールディングス   | 143,800   | 8,735.00  | 1,256,093,000  |                   |
| 5715 | 古河機械金属         | 56,600    | 3,680.00  | 208,288,000    | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 5726 | 大阪チタニウムテクノロジーズ | 92,500    | 2,660.00  | 246,050,000    | 貸付有価証券<br>27,300株 |
| 5741 | U A C J        | 322,400   | 2,498.00  | 805,355,200    | 貸付有価証券<br>4,400株  |
| 5757 | C Kサンエツ        | 12,900    | 5,410.00  | 69,789,000     | 貸付有価証券<br>3,800株  |
| 5801 | 古河電気工業         | 177,600   | 49,920.00 | 8,865,792,000  | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 5802 | 住友電気工業         | 1,841,500 | 12,240.00 | 22,539,960,000 |                   |
| 5803 | フジクラ           | 4,117,400 | 6,436.00  | 26,499,586,400 |                   |
| 5805 | SW C C         | 77,500    | 13,980.00 | 1,083,450,000  | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 5821 | 平河ヒューテック       | 32,200    | 3,785.00  | 121,877,000    | 貸付有価証券<br>9,500株  |
| 5851 | リョービ           | 61,500    | 2,741.00  | 168,571,500    | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 5857 | A R Eホールディングス  | 235,000   | 2,860.00  | 672,100,000    | 貸付有価証券<br>3,100株  |
| 3421 | 稲葉製作所          | 26,300    | 1,728.00  | 45,446,400     | 貸付有価証券<br>7,800株  |
| 3431 | 宮地エンジニアリンググループ | 69,500    | 1,514.00  | 105,223,000    | 貸付有価証券<br>20,500株 |
| 3433 | トーカロ           | 153,800   | 3,335.00  | 512,923,000    | 貸付有価証券<br>2,300株  |

|      |                  |           |          |               |                   |
|------|------------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 3436 | SUMCO            | 1,015,200 | 3,794.00 | 3,851,668,800 | 貸付有価証券<br>14,600株 |
| 3443 | 川田テクノロジーズ        | 121,600   | 1,295.00 | 157,472,000   | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 3445 | R S Technologies | 36,000    | 7,080.00 | 254,880,000   | 貸付有価証券<br>600株    |
| 5901 | 東洋製罐グループホールディングス | 266,400   | 4,111.00 | 1,095,170,400 |                   |
| 5902 | ホッカンホールディングス     | 28,600    | 2,333.00 | 66,723,800    | 貸付有価証券<br>9,000株  |
| 5909 | コロナ              | 29,800    | 947.00   | 28,220,600    | 貸付有価証券<br>8,800株  |
| 5911 | 横河ブリッジホールディングス   | 91,800    | 2,800.00 | 257,040,000   | 貸付有価証券<br>28,600株 |
| 5929 | 三和ホールディングス       | 512,600   | 3,749.00 | 1,921,737,400 | 貸付有価証券<br>7,500株  |
| 5930 | 文化シヤッター          | 167,500   | 1,885.00 | 315,737,500   | 貸付有価証券<br>51,600株 |
| 5932 | 三協立山             | 67,100    | 619.00   | 41,534,900    | 貸付有価証券<br>19,900株 |
| 5933 | アルインコ            | 40,700    | 1,050.00 | 42,735,000    | 貸付有価証券<br>12,000株 |
| 5938 | L I X I L        | 833,600   | 1,757.50 | 1,465,052,000 | 貸付有価証券<br>9,600株  |
| 5943 | ノーリツ             | 93,800    | 2,292.00 | 214,989,600   | 貸付有価証券<br>29,200株 |
| 5946 | 長府製作所            | 52,900    | 2,007.00 | 106,170,300   | 貸付有価証券<br>8,000株  |
| 5947 | リンナイ             | 272,800   | 3,543.00 | 966,530,400   | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 5957 | 日東精工             | 69,600    | 780.00   | 54,288,000    |                   |
| 5959 | 岡部               | 91,400    | 904.00   | 82,625,600    | 貸付有価証券<br>25,700株 |
| 5970 | ジーテクト            | 67,900    | 2,055.00 | 139,534,500   | 貸付有価証券<br>900株    |
| 5975 | 東プレ              | 94,000    | 2,644.00 | 248,536,000   | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 5976 | 高周波熱錬            | 76,100    | 1,281.00 | 97,484,100    | 貸付有価証券<br>23,600株 |
| 5981 | 東京製綱             | 31,400    | 1,967.00 | 61,763,800    |                   |
| 5985 | サンコール            | 52,700    | 1,941.00 | 102,290,700   | 貸付有価証券<br>15,600株 |
| 5988 | パイオラックス          | 57,300    | 1,545.00 | 88,528,500    | 貸付有価証券<br>5,400株  |
| 5989 | エイチワン            | 54,900    | 1,467.00 | 80,538,300    | 貸付有価証券<br>800株    |
| 5991 | 日本発條             | 402,000   | 4,012.00 | 1,612,824,000 | 貸付有価証券<br>4,400株  |
| 5992 | 中央発條             | 34,600    | 3,825.00 | 132,345,000   | 貸付有価証券<br>10,300株 |
| 7989 | 立川ブラインド工業        | 27,100    | 2,521.00 | 68,319,100    | 貸付有価証券<br>8,000株  |

|      |             |         |           |                |                   |
|------|-------------|---------|-----------|----------------|-------------------|
| 544A | GMSグループ     | 68,900  | 357.00    | 24,597,300     | 貸付有価証券<br>20,400株 |
| 5631 | 日本製鋼所       | 158,200 | 7,945.00  | 1,256,899,000  | 貸付有価証券<br>1,900株  |
| 575A | 前澤ホールディングス  | 37,100  | 1,369.00  | 50,789,900     |                   |
| 6005 | 三浦工業        | 242,200 | 3,181.00  | 770,438,200    | 貸付有価証券<br>3,500株  |
| 6013 | タクマ         | 146,300 | 3,715.00  | 543,504,500    | 貸付有価証券<br>2,500株  |
| 6101 | ツガミ         | 111,300 | 7,780.00  | 865,914,000    |                   |
| 6103 | オークマ        | 91,300  | 4,520.00  | 412,676,000    | 貸付有価証券<br>27,000株 |
| 6104 | 芝浦機械        | 62,400  | 4,430.00  | 276,432,000    | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 6113 | アマダ         | 736,300 | 3,088.00  | 2,273,694,400  | 貸付有価証券<br>9,300株  |
| 6118 | アイダエンジニアリング | 92,300  | 1,176.00  | 108,544,800    | 貸付有価証券<br>400株    |
| 6134 | F U J I     | 208,000 | 8,463.00  | 1,760,304,000  | 貸付有価証券<br>1,200株  |
| 6135 | 牧野フライス製作所   | 52,900  | 15,710.00 | 831,059,000    | 貸付有価証券<br>15,700株 |
| 6136 | オーエスジー      | 185,800 | 3,648.00  | 677,798,400    |                   |
| 6140 | 旭ダイヤモンド工業   | 121,700 | 1,230.00  | 149,691,000    | 貸付有価証券<br>37,800株 |
| 6141 | DMG森精機      | 357,600 | 3,686.00  | 1,318,113,600  | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 6143 | ソディック       | 127,100 | 2,064.00  | 262,334,400    | 貸付有価証券<br>1,900株  |
| 6146 | ディスコ        | 251,600 | 85,970.00 | 21,630,052,000 | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 6151 | 日東工器        | 18,500  | 1,717.00  | 31,764,500     | 貸付有価証券<br>5,800株  |
| 6157 | 日進工具        | 43,500  | 939.00    | 40,846,500     |                   |
| 6167 | 富士ダイス       | 38,700  | 979.00    | 37,887,300     | 貸付有価証券<br>11,400株 |
| 6209 | リケンNPR      | 60,100  | 3,890.00  | 233,789,000    | 貸付有価証券<br>18,800株 |
| 6222 | 島精機製作所      | 80,700  | 875.00    | 70,612,500     | 貸付有価証券<br>25,000株 |
| 6235 | オプトラン       | 85,700  | 4,130.00  | 353,941,000    |                   |
| 6237 | イワキポンプ      | 34,800  | 3,580.00  | 124,584,000    | 貸付有価証券<br>10,800株 |
| 6238 | フリュー        | 54,700  | 1,353.00  | 74,009,100     | 貸付有価証券<br>800株    |
| 6240 | ヤマシンフィルタ    | 108,100 | 502.00    | 54,266,200     | 貸付有価証券<br>31,900株 |
| 6247 | 日阪製作所       | 61,100  | 1,776.00  | 108,513,600    | 貸付有価証券<br>18,900株 |
| 6250 | やまびこ        | 85,300  | 3,895.00  | 332,243,500    | 貸付有価証券<br>1,300株  |

|      |                |           |           |                |                   |
|------|----------------|-----------|-----------|----------------|-------------------|
| 6254 | 野村マイクロ・サイエンス   | 94,200    | 4,940.00  | 465,348,000    | 貸付有価証券<br>29,500株 |
| 6258 | 平田機工           | 74,800    | 3,150.00  | 235,620,000    | 貸付有価証券<br>23,200株 |
| 6262 | P E G A S U S  | 57,600    | 501.00    | 28,857,600     | 貸付有価証券<br>17,000株 |
| 6264 | マルマエ           | 54,300    | 2,893.00  | 157,089,900    | 貸付有価証券<br>14,900株 |
| 6266 | タツモ            | 34,400    | 4,820.00  | 165,808,000    | 貸付有価証券<br>10,200株 |
| 6268 | ナプテスコ          | 296,700   | 5,325.00  | 1,579,927,500  | 貸付有価証券<br>4,400株  |
| 6269 | 三井海洋開発         | 132,100   | 9,652.00  | 1,275,029,200  | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 6272 | レオン自動機         | 60,400    | 1,454.00  | 87,821,600     | 貸付有価証券<br>18,700株 |
| 6273 | SMC            | 148,100   | 72,930.00 | 10,800,933,000 | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 6277 | ホソカワミクロン       | 39,500    | 4,945.00  | 195,327,500    | 貸付有価証券<br>12,300株 |
| 6278 | ユニオンツール        | 22,900    | 23,530.00 | 538,837,000    | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 6279 | 瑞光             | 44,500    | 925.00    | 41,162,500     | 貸付有価証券<br>13,200株 |
| 6282 | オイレス工業         | 64,400    | 2,783.00  | 179,225,200    | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 6284 | 日精エー・エス・ビー機械   | 20,300    | 9,120.00  | 185,136,000    | 貸付有価証券<br>300株    |
| 6287 | サトー            | 71,500    | 2,342.00  | 167,453,000    |                   |
| 6289 | 技研製作所          | 47,100    | 1,715.00  | 80,776,500     | 貸付有価証券<br>14,700株 |
| 6291 | 日本エアーテック       | 24,400    | 1,293.00  | 31,549,200     | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| 6298 | ワイエイシイホールディングス | 45,300    | 1,418.00  | 64,235,400     | 貸付有価証券<br>14,200株 |
| 6301 | 小松製作所          | 2,517,500 | 6,250.00  | 15,734,375,000 | 貸付有価証券<br>12,000株 |
| 6302 | 住友重機械工業        | 308,800   | 5,288.00  | 1,632,934,400  | 貸付有価証券<br>4,500株  |
| 6305 | 日立建機           | 207,900   | 5,281.00  | 1,097,919,900  | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 6306 | 日工             | 100,500   | 905.00    | 90,952,500     | 貸付有価証券<br>23,500株 |
| 6309 | 巴工業            | 57,900    | 1,781.00  | 103,119,900    | 貸付有価証券<br>5,600株  |
| 6310 | 井関農機           | 48,900    | 1,789.00  | 87,482,100     | 貸付有価証券<br>15,300株 |
| 6315 | TOWA           | 188,800   | 3,380.00  | 638,144,000    | 貸付有価証券<br>2,300株  |
| 6317 | 北川鉄工所          | 20,500    | 1,739.00  | 35,649,500     | 貸付有価証券<br>6,100株  |

|      |                   |           |           |                |                   |
|------|-------------------|-----------|-----------|----------------|-------------------|
| 6323 | ローツェ              | 306,900   | 4,836.00  | 1,484,168,400  | 貸付有価証券<br>4,000株  |
| 6324 | ハーモニック・ドライブ・システムズ | 139,600   | 7,900.00  | 1,102,840,000  |                   |
| 6326 | クボタ               | 2,641,100 | 2,755.00  | 7,276,230,500  | 貸付有価証券<br>29,900株 |
| 6328 | 荏原実業              | 55,000    | 2,523.00  | 138,765,000    | 貸付有価証券<br>17,100株 |
| 6331 | 三菱化工機             | 55,100    | 3,930.00  | 216,543,000    | 貸付有価証券<br>10,400株 |
| 6332 | 月島ホールディングス        | 69,800    | 2,582.00  | 180,223,600    | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 6333 | ＴＥＩＫＯＫＵ           | 33,600    | 3,135.00  | 105,336,000    | 貸付有価証券<br>10,400株 |
| 6339 | 新東工業              | 105,500   | 1,210.00  | 127,655,000    | 貸付有価証券<br>31,300株 |
| 6340 | 澁谷工業              | 49,000    | 4,380.00  | 214,620,000    | 貸付有価証券<br>15,300株 |
| 6345 | アイチ コーポレーション      | 74,900    | 1,346.00  | 100,815,400    | 貸付有価証券<br>22,200株 |
| 6349 | 小森コーポレーション        | 124,000   | 1,499.00  | 185,876,000    |                   |
| 6351 | 鶴見製作所             | 73,700    | 2,215.00  | 163,245,500    |                   |
| 6358 | 酒井重工業             | 20,600    | 2,066.00  | 42,559,600     | 貸付有価証券<br>6,100株  |
| 6361 | 荏原製作所             | 1,060,600 | 6,464.00  | 6,855,718,400  | 貸付有価証券<br>15,400株 |
| 6363 | 西島製作所             | 38,600    | 2,886.00  | 111,399,600    |                   |
| 6364 | A I R M A N       | 52,500    | 1,860.00  | 97,650,000     | 貸付有価証券<br>16,300株 |
| 6367 | ダイキン工業            | 679,900   | 23,850.00 | 16,215,615,000 | 貸付有価証券<br>9,800株  |
| 6368 | オルガノ              | 71,700    | 17,100.00 | 1,226,070,000  | 貸付有価証券<br>400株    |
| 6369 | トーヨーカネツ           | 43,400    | 2,380.00  | 103,292,000    | 貸付有価証券<br>12,800株 |
| 6370 | 栗田工業              | 314,400   | 9,382.00  | 2,949,700,800  | 貸付有価証券<br>4,200株  |
| 6371 | 椿本チエイン            | 225,800   | 2,604.00  | 587,983,200    | 貸付有価証券<br>3,300株  |
| 6378 | 木村化工機             | 39,800    | 1,236.00  | 49,192,800     | 貸付有価証券<br>11,800株 |
| 6381 | アネスト岩田            | 96,800    | 1,684.00  | 163,011,200    | 貸付有価証券<br>28,600株 |
| 6383 | ダイフク              | 881,000   | 7,100.00  | 6,255,100,000  | 貸付有価証券<br>800株    |
| 6387 | サムコ               | 14,000    | 14,380.00 | 201,320,000    | 貸付有価証券<br>4,100株  |
| 6395 | タダノ               | 275,300   | 1,301.00  | 358,165,300    |                   |
| 6407 | C K D             | 157,500   | 7,840.00  | 1,234,800,000  | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 6412 | 平和                | 154,300   | 2,004.00  | 309,217,200    | 貸付有価証券<br>2,500株  |

|      |                 |           |          |               |                   |
|------|-----------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 6413 | 理想科学工業          | 83,500    | 966.00   | 80,661,000    |                   |
| 6417 | SANKYO          | 489,000   | 1,563.00 | 764,307,000   | 貸付有価証券<br>8,700株  |
| 6418 | 日本金銭機械          | 63,100    | 990.00   | 62,469,000    | 貸付有価証券<br>18,700株 |
| 6419 | マースグループホールディングス | 43,900    | 2,904.00 | 127,485,600   | 貸付有価証券<br>600株    |
| 6420 | ガリレイ            | 76,800    | 3,260.00 | 250,368,000   | 貸付有価証券<br>23,800株 |
| 6430 | ダイコク電機          | 25,800    | 2,130.00 | 54,954,000    | 貸付有価証券<br>7,600株  |
| 6432 | 竹内製作所           | 94,700    | 7,210.00 | 682,787,000   | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 6436 | アマノ             | 137,400   | 3,608.00 | 495,739,200   | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 6440 | JUKI            | 80,800    | 529.00   | 42,743,200    | 貸付有価証券<br>13,900株 |
| 6445 | ジャノメ            | 38,500    | 1,288.00 | 49,588,000    | 貸付有価証券<br>11,400株 |
| 6454 | マックス            | 287,800   | 1,676.00 | 482,352,800   | 貸付有価証券<br>89,200株 |
| 6457 | グローリー           | 136,700   | 3,872.00 | 529,302,400   | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 6458 | 新晃工業            | 140,200   | 1,247.00 | 174,829,400   | 貸付有価証券<br>43,700株 |
| 6459 | 大和冷機工業          | 80,000    | 1,672.00 | 133,760,000   | 貸付有価証券<br>23,700株 |
| 6460 | セガサミーホールディングス   | 412,700   | 2,143.00 | 884,416,100   | 貸付有価証券<br>6,200株  |
| 6463 | TPR             | 115,800   | 1,410.00 | 163,278,000   | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 6464 | ツバキ・ナカシマ        | 120,600   | 421.00   | 50,772,600    | 貸付有価証券<br>35,700株 |
| 6465 | ホシザキ            | 336,100   | 5,303.00 | 1,782,338,300 | 貸付有価証券<br>4,900株  |
| 6470 | 大豊工業            | 39,500    | 1,073.00 | 42,383,500    | 貸付有価証券<br>11,700株 |
| 6471 | 日本精工            | 966,400   | 1,195.50 | 1,155,331,200 | 貸付有価証券<br>12,000株 |
| 6472 | NTN             | 1,385,900 | 421.00   | 583,463,900   | 貸付有価証券<br>12,000株 |
| 6473 | ジェイテクト          | 492,700   | 2,046.00 | 1,008,064,200 | 貸付有価証券<br>6,200株  |
| 6474 | 不二越             | 38,500    | 6,120.00 | 235,620,000   | 貸付有価証券<br>600株    |
| 6480 | 日本トムソン          | 142,100   | 2,440.00 | 346,724,000   | 貸付有価証券<br>2,100株  |
| 6481 | THK             | 276,200   | 7,923.00 | 2,188,332,600 | 貸付有価証券<br>4,400株  |
| 6482 | YUSHIN          | 41,300    | 715.00   | 29,529,500    | 貸付有価証券<br>12,200株 |

|      |                  |            |            |                |                    |
|------|------------------|------------|------------|----------------|--------------------|
| 6485 | 前澤給装工業           | 37,400     | 1,483.00   | 55,464,200     | 貸付有価証券<br>11,100株  |
| 6486 | イーグル工業           | 57,700     | 2,873.00   | 165,772,100    |                    |
| 6490 | P I L L A R      | 48,400     | 10,830.00  | 524,172,000    | 貸付有価証券<br>14,300株  |
| 6498 | キット              | 186,200    | 2,601.00   | 484,306,200    | 貸付有価証券<br>55,300株  |
| 6586 | マキタ              | 649,500    | 5,857.00   | 3,804,121,500  | 貸付有価証券<br>9,400株   |
| 7003 | 三井E & S          | 259,100    | 4,109.00   | 1,064,641,900  | 貸付有価証券<br>4,000株   |
| 7004 | カナデビア            | 427,700    | 1,283.00   | 548,739,100    |                    |
| 7011 | 三菱重工業            | 9,781,100  | 3,618.00   | 35,388,019,800 | 貸付有価証券<br>21,800株  |
| 7013 | I H I            | 2,720,600  | 2,719.00   | 7,397,311,400  | 貸付有価証券<br>40,700株  |
| 285A | キオクシアホールディングス    | 316,800    | 103,850.00 | 32,899,680,000 | 貸付有価証券<br>16,600株  |
| 3105 | 日清紡ホールディングス      | 392,800    | 2,468.50   | 969,626,800    | 貸付有価証券<br>5,700株   |
| 4062 | イビデン             | 653,400    | 26,370.00  | 17,230,158,000 | 貸付有価証券<br>8,600株   |
| 4902 | コニカミノルタ          | 1,165,900  | 589.60     | 687,414,640    | 貸付有価証券<br>5,600株   |
| 6448 | ブラザー工業           | 647,700    | 3,763.00   | 2,437,295,100  | 貸付有価証券<br>10,000株  |
| 6479 | ミネベアミツミ          | 908,000    | 5,246.00   | 4,763,368,000  | 貸付有価証券<br>100株     |
| 6501 | 日立製作所            | 13,149,800 | 4,554.00   | 59,884,189,200 | 貸付有価証券<br>190,300株 |
| 6503 | 三菱電機             | 5,718,300  | 5,986.00   | 34,229,743,800 | 貸付有価証券<br>29,900株  |
| 6504 | 富士電機             | 375,100    | 14,290.00  | 5,360,179,000  | 貸付有価証券<br>4,600株   |
| 6506 | 安川電機             | 567,000    | 7,223.00   | 4,095,441,000  | 貸付有価証券<br>8,200株   |
| 6507 | シンフォニアテクノロジー     | 57,600     | 15,920.00  | 916,992,000    | 貸付有価証券<br>17,800株  |
| 6508 | 明電舎              | 96,800     | 10,310.00  | 998,008,000    | 貸付有価証券<br>700株     |
| 6516 | 山洋電気             | 60,200     | 7,130.00   | 429,226,000    |                    |
| 6517 | デンヨー             | 38,000     | 3,650.00   | 138,700,000    | 貸付有価証券<br>11,900株  |
| 6523 | PHCホールディングス      | 98,000     | 1,019.00   | 99,862,000     | 貸付有価証券<br>1,400株   |
| 6525 | KOKUSAI ELECTRIC | 598,300    | 10,150.00  | 6,072,745,000  | 貸付有価証券<br>5,300株   |
| 6526 | ソシオネクスト          | 452,200    | 2,697.50   | 1,219,809,500  | 貸付有価証券<br>7,500株   |
| 6588 | 東芝テック            | 66,800     | 2,911.00   | 194,454,800    | 貸付有価証券<br>1,200株   |

|      |                      |           |           |                |                   |
|------|----------------------|-----------|-----------|----------------|-------------------|
| 6590 | 芝浦メカトロニクス            | 162,000   | 4,825.00  | 781,650,000    | 貸付有価証券<br>51,000株 |
| 6592 | マブチモーター              | 503,800   | 1,603.50  | 807,843,300    |                   |
| 6615 | ユー・エム・シー・エレクトロニクス    | 32,800    | 226.00    | 7,412,800      | 貸付有価証券<br>9,700株  |
| 6616 | トレックス・セミコンダクター       | 20,100    | 2,585.00  | 51,958,500     |                   |
| 6617 | 東光高岳                 | 28,300    | 7,950.00  | 224,985,000    | 貸付有価証券<br>500株    |
| 6619 | ダブル・スコープ             | 187,500   | 176.00    | 33,000,000     |                   |
| 6622 | ダイヘン                 | 48,100    | 18,930.00 | 910,533,000    | 貸付有価証券<br>700株    |
| 6630 | ヤーマン                 | 101,500   | 721.00    | 73,181,500     | 貸付有価証券<br>30,000株 |
| 6632 | J V Cケンウッド           | 406,000   | 1,102.00  | 447,412,000    | 貸付有価証券<br>6,000株  |
| 6638 | ミマキエンジニアリング          | 43,300    | 1,815.00  | 78,589,500     |                   |
| 6644 | 大崎電気工業               | 99,800    | 1,463.00  | 146,007,400    | 貸付有価証券<br>31,200株 |
| 6645 | オムロン                 | 438,500   | 5,831.00  | 2,556,893,500  | 貸付有価証券<br>5,500株  |
| 6651 | 日東工業                 | 62,600    | 4,775.00  | 298,915,000    | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 6652 | I D E C              | 66,700    | 3,255.00  | 217,108,500    | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 6674 | ジーエス・ユアサ コーポレーション    | 213,600   | 7,129.00  | 1,522,754,400  | 貸付有価証券<br>3,400株  |
| 6676 | B U F F A L O        | 27,800    | 2,507.00  | 69,694,600     |                   |
| 6678 | テクノメディカ              | 10,200    | 1,947.00  | 19,859,400     |                   |
| 6699 | ダイヤモンドエレクトリックホールディング | 27,900    | 471.00    | 13,140,900     | 貸付有価証券<br>8,700株  |
| 6701 | 日本電気                 | 3,427,900 | 3,757.00  | 12,878,620,300 | 貸付有価証券<br>28,600株 |
| 6702 | 富士通                  | 4,804,000 | 3,187.00  | 15,310,348,000 |                   |
| 6703 | 沖電気工業                | 252,900   | 3,855.00  | 974,929,500    | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 6706 | 電気興業                 | 19,100    | 3,130.00  | 59,783,000     | 貸付有価証券<br>6,100株  |
| 6707 | サンケン電気               | 53,400    | 10,815.00 | 577,521,000    | 貸付有価証券<br>600株    |
| 6718 | アイホン                 | 27,300    | 2,658.00  | 72,563,400     | 貸付有価証券<br>8,600株  |
| 6723 | ルネサスエレクトロニクス         | 5,061,800 | 4,844.00  | 24,519,359,200 | 貸付有価証券<br>35,500株 |
| 6724 | セイコーエプソン             | 649,900   | 2,767.50  | 1,798,598,250  | 貸付有価証券<br>9,400株  |
| 6727 | ワコム                  | 313,100   | 800.00    | 250,480,000    | 貸付有価証券<br>4,900株  |
| 6728 | アルバック                | 133,600   | 10,415.00 | 1,391,444,000  | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 6730 | アクセル                 | 23,800    | 1,158.00  | 27,560,400     | 貸付有価証券<br>7,100株  |

|      |                 |            |           |                |                    |
|------|-----------------|------------|-----------|----------------|--------------------|
| 6737 | E I Z O         | 73,600     | 2,390.00  | 175,904,000    | 貸付有価証券<br>22,800株  |
| 6740 | ジャパンディスプレイ      | 3,000,100  | 55.00     | 165,005,500    | 貸付有価証券<br>886,300株 |
| 6741 | 日本信号            | 132,100    | 1,586.00  | 209,510,600    |                    |
| 6742 | 京三製作所           | 121,500    | 999.00    | 121,378,500    | 貸付有価証券<br>1,800株   |
| 6744 | 能美防災            | 70,500     | 4,135.00  | 291,517,500    | 貸付有価証券<br>1,100株   |
| 6745 | ホーチキ            | 122,500    | 1,936.00  | 237,160,000    | 貸付有価証券<br>37,700株  |
| 6750 | エレコム            | 124,800    | 1,779.00  | 222,019,200    | 貸付有価証券<br>38,700株  |
| 6752 | パナソニック ホールディングス | 6,167,500  | 4,610.00  | 28,432,175,000 | 貸付有価証券<br>88,400株  |
| 6753 | シャープ            | 628,600    | 601.00    | 377,788,600    | 貸付有価証券<br>4,400株   |
| 6754 | アンリツ            | 341,400    | 4,559.00  | 1,556,442,600  | 貸付有価証券<br>5,300株   |
| 6758 | ソニーグループ         | 17,829,900 | 3,197.00  | 57,002,190,300 |                    |
| 6762 | T D K           | 4,508,600  | 3,908.00  | 17,619,608,800 | 貸付有価証券<br>64,600株  |
| 6763 | 帝国通信工業          | 22,900     | 3,005.00  | 68,814,500     | 貸付有価証券<br>7,000株   |
| 6768 | タムラ製作所          | 208,000    | 976.00    | 203,008,000    | 貸付有価証券<br>3,000株   |
| 6770 | アルプスアルパイン       | 402,200    | 2,113.00  | 849,848,600    | 貸付有価証券<br>6,100株   |
| 6779 | 日本電波工業          | 62,600     | 3,985.00  | 249,461,000    |                    |
| 6785 | 鈴木              | 30,600     | 3,345.00  | 102,357,000    | 貸付有価証券<br>9,100株   |
| 6787 | メイコー            | 46,600     | 32,400.00 | 1,509,840,000  | 貸付有価証券<br>800株     |
| 6788 | 日本トリム           | 11,700     | 4,515.00  | 52,825,500     | 貸付有価証券<br>3,500株   |
| 6794 | フォスター電機         | 48,300     | 2,964.00  | 143,161,200    | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 6798 | SMK             | 12,500     | 3,210.00  | 40,125,000     | 貸付有価証券<br>3,900株   |
| 6800 | ヨコオ             | 46,100     | 6,350.00  | 292,735,000    | 貸付有価証券<br>700株     |
| 6804 | ホシデン            | 101,800    | 2,763.00  | 281,273,400    | 貸付有価証券<br>30,900株  |
| 6806 | ヒロセ電機           | 75,900     | 30,250.00 | 2,295,975,000  | 貸付有価証券<br>1,100株   |
| 6807 | 日本航空電子工業        | 122,300    | 2,328.00  | 284,714,400    | 貸付有価証券<br>2,000株   |
| 6809 | T O A           | 52,800     | 1,580.00  | 83,424,000     | 貸付有価証券<br>16,400株  |
| 6810 | マクセル            | 108,900    | 2,174.00  | 236,748,600    | 貸付有価証券<br>33,700株  |

|      |             |           |           |                |                   |
|------|-------------|-----------|-----------|----------------|-------------------|
| 6814 | 古野電気        | 67,800    | 6,130.00  | 415,614,000    | 貸付有価証券<br>20,200株 |
| 6817 | スミダコーポレーション | 89,700    | 1,430.00  | 128,271,000    | 貸付有価証券<br>27,800株 |
| 6820 | アイコム        | 20,100    | 3,035.00  | 61,003,500     | 貸付有価証券<br>5,900株  |
| 6823 | リオン         | 21,500    | 3,900.00  | 83,850,000     |                   |
| 6841 | 横河電機        | 546,800   | 5,579.00  | 3,050,597,200  | 貸付有価証券<br>8,200株  |
| 6844 | 新電元工業       | 22,000    | 4,180.00  | 91,960,000     | 貸付有価証券<br>300株    |
| 6845 | アズビル        | 1,255,700 | 1,717.50  | 2,156,664,750  | 貸付有価証券<br>19,500株 |
| 6849 | 日本光電工業      | 429,600   | 1,415.00  | 607,884,000    | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 6850 | チノー         | 43,000    | 1,671.00  | 71,853,000     | 貸付有価証券<br>12,700株 |
| 6855 | 日本電子材料      | 36,200    | 8,810.00  | 318,922,000    | 貸付有価証券<br>500株    |
| 6856 | 堀場製作所       | 98,000    | 28,580.00 | 2,800,840,000  | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 6857 | アドバンテスト     | 1,556,300 | 35,900.00 | 55,871,170,000 | 貸付有価証券<br>23,400株 |
| 6859 | エスベック       | 50,600    | 4,580.00  | 231,748,000    | 貸付有価証券<br>700株    |
| 6861 | キーエンス       | 517,100   | 77,370.00 | 40,008,027,000 | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 6866 | 日置電機        | 27,100    | 12,770.00 | 346,067,000    | 貸付有価証券<br>400株    |
| 6869 | シスメックス      | 1,338,400 | 1,432.00  | 1,916,588,800  | 貸付有価証券<br>19,200株 |
| 6871 | 日本マイクロニクス   | 85,100    | 17,650.00 | 1,502,015,000  | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 6875 | メガチップス      | 33,100    | 10,520.00 | 348,212,000    | 貸付有価証券<br>10,200株 |
| 6877 | OBARA GROUP | 24,200    | 6,100.00  | 147,620,000    | 貸付有価証券<br>7,600株  |
| 6905 | コーセル        | 63,700    | 1,515.00  | 96,505,500     | 貸付有価証券<br>19,800株 |
| 6908 | イリソ電子工業     | 42,600    | 2,922.00  | 124,477,200    |                   |
| 6914 | オプテックスグループ  | 87,500    | 4,330.00  | 378,875,000    | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 6915 | 千代田インテグレ    | 13,000    | 3,175.00  | 41,275,000     | 貸付有価証券<br>3,900株  |
| 6920 | レーザーテック     | 218,700   | 53,180.00 | 11,630,466,000 | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 6923 | スタンレー電気     | 219,200   | 3,562.00  | 780,790,400    | 貸付有価証券<br>3,900株  |
| 6925 | ウシオ電機       | 193,700   | 4,508.00  | 873,199,600    | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| 6929 | 日本セラミック     | 42,100    | 3,785.00  | 159,348,500    | 貸付有価証券<br>700株    |

|      |                     |           |           |                |                   |
|------|---------------------|-----------|-----------|----------------|-------------------|
| 6941 | 山一電機                | 50,600    | 10,880.00 | 550,528,000    | 貸付有価証券<br>500株    |
| 6947 | 図研                  | 43,000    | 4,470.00  | 192,210,000    | 貸付有価証券<br>700株    |
| 6951 | 日本電子                | 119,500   | 7,315.00  | 874,142,500    | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 6952 | カシオ計算機              | 407,900   | 1,933.50  | 788,674,650    | 貸付有価証券<br>700株    |
| 6954 | ファナック               | 2,468,400 | 7,357.00  | 18,160,018,800 | 貸付有価証券<br>35,400株 |
| 6958 | 日本シイエムケイ            | 165,400   | 695.00    | 114,953,000    | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 6961 | エンプラス               | 15,000    | 13,370.00 | 200,550,000    | 貸付有価証券<br>4,700株  |
| 6962 | 大真空                 | 74,500    | 967.00    | 72,041,500     | 貸付有価証券<br>8,200株  |
| 6963 | ローム                 | 1,014,500 | 5,660.00  | 5,742,070,000  | 貸付有価証券<br>13,500株 |
| 6965 | 浜松ホトニクス             | 802,200   | 2,739.50  | 2,197,626,900  |                   |
| 6966 | 三井ハイテック             | 267,000   | 1,044.00  | 278,748,000    |                   |
| 6971 | 京セラ                 | 3,211,500 | 3,558.00  | 11,426,517,000 | 貸付有価証券<br>46,100株 |
| 6976 | 太陽誘電                | 276,900   | 18,820.00 | 5,211,258,000  |                   |
| 6981 | 村田製作所               | 4,932,400 | 11,825.00 | 58,325,630,000 | 貸付有価証券<br>65,300株 |
| 6986 | 双葉電子工業              | 106,600   | 558.00    | 59,482,800     | 貸付有価証券<br>31,500株 |
| 6996 | ニチコン                | 135,300   | 4,515.00  | 610,879,500    |                   |
| 6997 | 日本ケミコン              | 71,600    | 5,980.00  | 428,168,000    | 貸付有価証券<br>600株    |
| 6999 | K O A               | 94,200    | 3,035.00  | 285,897,000    | 貸付有価証券<br>16,600株 |
| 7244 | 市光工業                | 111,800   | 508.00    | 56,794,400     | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 7276 | 小糸製作所               | 535,500   | 2,630.00  | 1,408,365,000  | 貸付有価証券<br>6,800株  |
| 7280 | ミツバ                 | 98,100    | 1,114.00  | 109,283,400    | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 7735 | S C R E E Nホールディングス | 368,700   | 17,625.00 | 6,498,337,500  | 貸付有価証券<br>6,200株  |
| 7751 | キャノン                | 2,320,200 | 4,258.00  | 9,879,411,600  | 貸付有価証券<br>800株    |
| 7752 | リコー                 | 1,211,300 | 1,466.50  | 1,776,371,450  | 貸付有価証券<br>19,000株 |
| 7965 | 象印マホービン             | 140,300   | 1,414.00  | 198,384,200    | 貸付有価証券<br>43,600株 |
| 8035 | 東京エレクトロン            | 1,085,600 | 75,340.00 | 81,789,104,000 |                   |
| 9880 | イノテック               | 34,400    | 4,285.00  | 147,404,000    |                   |
| 3116 | トヨタ紡織               | 253,900   | 2,120.00  | 538,268,000    | 貸付有価証券<br>3,200株  |

|      |             |            |           |                |                    |
|------|-------------|------------|-----------|----------------|--------------------|
| 543A | ARCHION     | 777,300    | 282.00    | 219,198,600    | 貸付有価証券<br>229,600株 |
| 5949 | ユニプレス       | 95,700     | 1,209.00  | 115,701,300    | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 6455 | モリタホールディングス | 79,000     | 2,422.00  | 191,338,000    | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 6584 | 三櫻工業        | 78,900     | 1,026.00  | 80,951,400     | 貸付有価証券<br>23,300株  |
| 6902 | デンソー        | 5,063,800  | 1,860.50  | 9,421,199,900  | 貸付有価証券<br>72,600株  |
| 6995 | 東海理化電機製作所   | 138,000    | 2,970.00  | 409,860,000    | 貸付有価証券<br>200株     |
| 7012 | 川崎重工業       | 1,947,400  | 2,941.50  | 5,728,277,100  |                    |
| 7014 | 名村造船所       | 161,100    | 3,640.00  | 586,404,000    | 貸付有価証券<br>2,200株   |
| 7102 | 日本車輛製造      | 19,900     | 3,120.00  | 62,088,000     |                    |
| 7201 | 日産自動車       | 7,896,400  | 302.00    | 2,384,712,800  |                    |
| 7202 | いすゞ自動車      | 1,331,200  | 2,168.50  | 2,886,707,200  | 貸付有価証券<br>21,800株  |
| 7203 | トヨタ自動車      | 27,476,200 | 2,700.50  | 74,199,478,100 |                    |
| 7211 | 三菱自動車工業     | 1,976,000  | 309.40    | 611,374,400    | 貸付有価証券<br>28,400株  |
| 7220 | 武蔵精密工業      | 114,100    | 3,970.00  | 452,977,000    | 貸付有価証券<br>1,900株   |
| 7222 | 日産車体        | 78,500     | 933.00    | 73,240,500     | 貸付有価証券<br>23,200株  |
| 7224 | 新明和工業       | 148,800    | 2,048.00  | 304,742,400    | 貸付有価証券<br>46,200株  |
| 7226 | 極東開発工業      | 85,400     | 2,111.00  | 180,279,400    | 貸付有価証券<br>26,300株  |
| 7231 | トピー工業       | 37,200     | 2,674.00  | 99,472,800     | 貸付有価証券<br>11,700株  |
| 7236 | ティラド        | 9,100      | 14,770.00 | 134,407,000    |                    |
| 7238 | 曙ブレーキ工業     | 317,500    | 107.00    | 33,972,500     | 貸付有価証券<br>94,000株  |
| 7239 | タチエス        | 95,400     | 2,137.00  | 203,869,800    | 貸付有価証券<br>1,400株   |
| 7240 | NOK         | 186,600    | 2,888.50  | 538,994,100    | 貸付有価証券<br>1,800株   |
| 7241 | フタバ産業       | 138,500    | 944.00    | 130,744,000    | 貸付有価証券<br>2,300株   |
| 7242 | カヤバ         | 87,800     | 3,825.00  | 335,835,000    | 貸付有価証券<br>26,000株  |
| 7245 | 大同メタル工業     | 101,000    | 1,747.00  | 176,447,000    | 貸付有価証券<br>31,300株  |
| 7246 | プレス工業       | 208,500    | 777.00    | 162,004,500    | 貸付有価証券<br>2,800株   |
| 7259 | アイシン        | 1,320,400  | 2,162.00  | 2,854,704,800  | 貸付有価証券<br>5,000株   |
| 7261 | マツダ         | 1,709,600  | 1,092.00  | 1,866,883,200  | 貸付有価証券<br>15,300株  |

|      |              |           |           |                |                   |
|------|--------------|-----------|-----------|----------------|-------------------|
| 7267 | 本田技研工業       | 9,637,700 | 1,414.00  | 13,627,707,800 | 貸付有価証券<br>94,100株 |
| 7269 | スズキ          | 3,797,200 | 1,936.50  | 7,353,277,800  | 貸付有価証券<br>59,900株 |
| 7270 | S U B A R U  | 1,525,100 | 2,401.50  | 3,662,527,650  | 貸付有価証券<br>22,400株 |
| 7272 | ヤマハ発動機       | 2,558,200 | 1,242.50  | 3,178,563,500  |                   |
| 7278 | エクセディ        | 84,500    | 5,790.00  | 489,255,000    | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 7282 | 豊田合成         | 159,100   | 5,111.00  | 813,160,100    | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 7283 | 愛三工業         | 85,800    | 1,904.00  | 163,363,200    | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 7294 | ヨロズ          | 48,400    | 828.00    | 40,075,200     | 貸付有価証券<br>14,300株 |
| 7296 | エフ・シー・シー     | 100,600   | 3,420.00  | 344,052,000    | 貸付有価証券<br>5,700株  |
| 7309 | シマノ          | 217,400   | 17,340.00 | 3,769,716,000  | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 7313 | テイ・エス テック    | 191,700   | 1,714.00  | 328,573,800    | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 268A | リガク・ホールディングス | 306,400   | 2,781.00  | 852,098,400    | 貸付有価証券<br>90,500株 |
| 368A | 北里コーポレーション   | 54,100    | 1,286.00  | 69,572,600     |                   |
| 4543 | テルモ          | 3,434,000 | 2,193.50  | 7,532,479,000  | 貸付有価証券<br>42,200株 |
| 6376 | 日機装          | 120,300   | 4,160.00  | 500,448,000    | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 7600 | 日本エム・ディ・エム   | 40,900    | 928.00    | 37,955,200     |                   |
| 7701 | 島津製作所        | 686,700   | 3,919.00  | 2,691,177,300  | 貸付有価証券<br>10,300株 |
| 7702 | J M S        | 47,800    | 446.00    | 21,318,800     | 貸付有価証券<br>14,100株 |
| 7715 | 長野計器         | 32,900    | 4,735.00  | 155,781,500    | 貸付有価証券<br>10,200株 |
| 7717 | ブイ・テクノロジー    | 25,300    | 8,910.00  | 225,423,000    | 貸付有価証券<br>400株    |
| 7721 | 東京計器         | 42,900    | 6,420.00  | 275,418,000    | 貸付有価証券<br>12,700株 |
| 7723 | 愛知時計電機       | 24,600    | 2,940.00  | 72,324,000     | 貸付有価証券<br>400株    |
| 7725 | インターアクション    | 26,700    | 1,856.00  | 49,555,200     | 貸付有価証券<br>7,900株  |
| 7729 | 東京精密         | 98,100    | 20,060.00 | 1,967,886,000  | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 7730 | マニー          | 227,500   | 1,705.00  | 387,887,500    | 貸付有価証券<br>28,700株 |
| 7731 | ニコン          | 644,800   | 2,269.50  | 1,463,373,600  | 貸付有価証券<br>10,100株 |
| 7733 | オリンパス        | 2,800,400 | 1,635.50  | 4,580,054,200  |                   |

|      |                  |           |           |                |                    |
|------|------------------|-----------|-----------|----------------|--------------------|
| 7734 | 理研計器             | 73,200    | 3,620.00  | 264,984,000    | 貸付有価証券<br>1,100株   |
| 7740 | タムロン             | 264,100   | 1,213.00  | 320,353,300    | 貸付有価証券<br>82,000株  |
| 7741 | HOYA             | 981,200   | 26,120.00 | 25,628,944,000 | 貸付有価証券<br>7,800株   |
| 7744 | ノーリツ銅機           | 147,200   | 2,044.00  | 300,876,800    |                    |
| 7745 | A & Dホロンホールディングス | 70,000    | 2,867.00  | 200,690,000    | 貸付有価証券<br>700株     |
| 7747 | 朝日インテック          | 615,400   | 3,622.00  | 2,228,978,800  | 貸付有価証券<br>3,400株   |
| 7762 | シチズン時計           | 427,900   | 2,546.00  | 1,089,433,400  | 貸付有価証券<br>106,200株 |
| 7780 | メニコン             | 192,900   | 1,700.00  | 327,930,000    | 貸付有価証券<br>59,900株  |
| 7979 | 松風               | 62,300    | 2,014.00  | 125,472,200    | 貸付有価証券<br>19,200株  |
| 8050 | セイコーグループ         | 144,000   | 8,140.00  | 1,172,160,000  | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 8086 | ニプロ              | 430,800   | 1,622.50  | 698,973,000    | 貸付有価証券<br>6,200株   |
| 1518 | 三井松島ホールディングス     | 88,400    | 1,504.00  | 132,953,600    | 貸付有価証券<br>26,200株  |
| 429A | テクセンドフォトマスク      | 192,000   | 4,455.00  | 855,360,000    |                    |
| 7818 | トランザクション         | 89,000    | 1,400.00  | 124,600,000    | 貸付有価証券<br>26,300株  |
| 7820 | ニホンフラッシュ         | 48,400    | 705.00    | 34,122,000     | 貸付有価証券<br>14,300株  |
| 7821 | 前田工繊             | 105,300   | 1,754.00  | 184,696,200    | 貸付有価証券<br>32,800株  |
| 7823 | アートネイチャー         | 46,500    | 836.00    | 38,874,000     | 貸付有価証券<br>13,800株  |
| 7826 | フルヤ金属            | 49,100    | 8,980.00  | 440,918,000    | 貸付有価証券<br>700株     |
| 7832 | バンダイナムコホールディングス  | 1,371,300 | 3,731.00  | 5,116,320,300  | 貸付有価証券<br>19,800株  |
| 7839 | SHOEI            | 121,300   | 1,802.00  | 218,582,600    | 貸付有価証券<br>2,000株   |
| 7840 | フランスベッドホールディングス  | 73,900    | 1,218.00  | 90,010,200     | 貸付有価証券<br>21,800株  |
| 7846 | パイロットコーポレーション    | 72,300    | 5,114.00  | 369,742,200    | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 7856 | 萩原工業             | 34,600    | 1,761.00  | 60,930,600     | 貸付有価証券<br>5,800株   |
| 7864 | フジシールインターナショナル   | 104,700   | 2,853.00  | 298,709,100    | 貸付有価証券<br>1,700株   |
| 7867 | タカラトミー           | 253,300   | 3,152.00  | 798,401,600    | 貸付有価証券<br>3,200株   |
| 7868 | 広済堂ホールディングス      | 190,600   | 535.00    | 101,971,000    | 貸付有価証券<br>49,700株  |
| 7893 | プロネクス            | 53,600    | 1,065.00  | 57,084,000     | 貸付有価証券<br>15,900株  |

|      |                  |           |          |                |                   |
|------|------------------|-----------|----------|----------------|-------------------|
| 7911 | TOPPANホールディングス   | 626,600   | 5,213.00 | 3,266,465,800  | 貸付有価証券<br>9,000株  |
| 7912 | 大日本印刷            | 1,115,200 | 2,819.50 | 3,144,306,400  | 貸付有価証券<br>12,500株 |
| 7914 | 共同印刷             | 52,200    | 1,550.00 | 80,910,000     | 貸付有価証券<br>15,400株 |
| 7915 | N I S S H A      | 92,800    | 1,414.00 | 131,219,200    | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 7921 | TAKARA & COMPANY | 30,500    | 3,060.00 | 93,330,000     | 貸付有価証券<br>9,500株  |
| 7936 | アシックス            | 1,987,500 | 4,524.00 | 8,991,450,000  | 貸付有価証券<br>26,100株 |
| 7937 | ツツミ              | 12,100    | 2,622.00 | 31,726,200     | 貸付有価証券<br>3,600株  |
| 7944 | ローランド            | 41,100    | 4,325.00 | 177,757,500    | 貸付有価証券<br>8,600株  |
| 7949 | 小松ウオール工業         | 38,100    | 2,520.00 | 96,012,000     | 貸付有価証券<br>11,800株 |
| 7951 | ヤマハ              | 805,400   | 1,147.50 | 924,196,500    | 貸付有価証券<br>12,600株 |
| 7952 | 河合楽器製作所          | 13,900    | 3,350.00 | 46,565,000     | 貸付有価証券<br>300株    |
| 7955 | クリナップ            | 56,300    | 875.00   | 49,262,500     | 貸付有価証券<br>17,500株 |
| 7956 | ビジョン             | 305,700   | 2,006.50 | 613,387,050    | 貸付有価証券<br>4,400株  |
| 7962 | キングジム            | 45,600    | 762.00   | 34,747,200     | 貸付有価証券<br>14,200株 |
| 7966 | リンテック            | 112,100   | 6,720.00 | 753,312,000    | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 7972 | イトーキ             | 113,500   | 2,571.00 | 291,808,500    | 貸付有価証券<br>20,300株 |
| 7974 | 任天堂              | 3,234,500 | 6,859.00 | 22,185,435,500 |                   |
| 7976 | 三菱鉛筆             | 69,600    | 2,602.00 | 181,099,200    | 貸付有価証券<br>21,700株 |
| 7981 | タカラスタンダード        | 110,200   | 3,135.00 | 345,477,000    | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 7984 | コクヨ              | 1,022,800 | 819.70   | 838,389,160    | 貸付有価証券<br>10,800株 |
| 7987 | ナカバヤシ            | 55,700    | 560.00   | 31,192,000     | 貸付有価証券<br>16,500株 |
| 7990 | グローブライド          | 48,500    | 2,308.00 | 111,938,000    | 貸付有価証券<br>800株    |
| 7994 | オカムラ             | 155,600   | 2,283.00 | 355,234,800    | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 8022 | 美津濃              | 138,700   | 3,480.00 | 482,676,000    | 貸付有価証券<br>43,300株 |
| 3150 | グリムス             | 18,400    | 2,433.00 | 44,767,200     | 貸付有価証券<br>200株    |
| 9501 | 東京電力ホールディングス     | 4,659,200 | 481.20   | 2,242,007,040  | 貸付有価証券<br>48,400株 |

|      |                |           |          |               |                   |
|------|----------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 9502 | 中部電力           | 1,904,600 | 3,037.00 | 5,784,270,200 | 貸付有価証券<br>19,400株 |
| 9503 | 関西電力           | 2,801,500 | 2,308.00 | 6,465,862,000 | 貸付有価証券<br>36,200株 |
| 9504 | 中国電力           | 898,000   | 892.60   | 801,554,800   |                   |
| 9505 | 北陸電力           | 528,500   | 866.60   | 457,998,100   | 貸付有価証券<br>7,600株  |
| 9506 | 東北電力           | 1,360,800 | 1,044.00 | 1,420,675,200 | 貸付有価証券<br>11,600株 |
| 9507 | 四国電力           | 481,300   | 1,484.00 | 714,249,200   | 貸付有価証券<br>6,900株  |
| 9508 | 九州電力           | 1,191,500 | 1,649.00 | 1,964,783,500 | 貸付有価証券<br>17,100株 |
| 9509 | 北海道電力          | 582,600   | 929.10   | 541,293,660   |                   |
| 9511 | 沖縄電力           | 132,000   | 887.00   | 117,084,000   |                   |
| 9513 | 電源開発           | 389,200   | 3,661.00 | 1,424,861,200 | 貸付有価証券<br>5,600株  |
| 9514 | エフオン           | 37,600    | 322.00   | 12,107,200    | 貸付有価証券<br>11,100株 |
| 9517 | イーレックス         | 105,800   | 722.00   | 76,387,600    |                   |
| 9519 | レノバ            | 141,100   | 883.00   | 124,591,300   | 貸付有価証券<br>43,900株 |
| 9531 | 東京瓦斯           | 841,600   | 6,068.00 | 5,106,828,800 | 貸付有価証券<br>11,700株 |
| 9532 | 大阪瓦斯           | 922,800   | 5,359.00 | 4,945,285,200 | 貸付有価証券<br>14,400株 |
| 9533 | 東邦瓦斯           | 707,900   | 1,179.50 | 834,968,050   |                   |
| 9534 | 北海道瓦斯          | 154,300   | 739.00   | 114,027,700   | 貸付有価証券<br>2,300株  |
| 9535 | 広島ガス           | 109,600   | 384.00   | 42,086,400    | 貸付有価証券<br>32,400株 |
| 9536 | 西部ガスホールディングス   | 59,300    | 2,211.00 | 131,112,300   | 貸付有価証券<br>14,600株 |
| 9543 | 静岡ガス           | 117,800   | 1,240.00 | 146,072,000   | 貸付有価証券<br>36,600株 |
| 9551 | メタウォーター        | 68,400    | 3,560.00 | 243,504,000   | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 2384 | S B S ホールディングス | 46,100    | 4,150.00 | 191,315,000   | 貸付有価証券<br>700株    |
| 9001 | 東武鉄道           | 533,800   | 2,884.00 | 1,539,479,200 | 貸付有価証券<br>7,800株  |
| 9003 | 相鉄ホールディングス     | 199,200   | 2,413.50 | 480,769,200   |                   |
| 9005 | 東急             | 1,328,500 | 1,650.50 | 2,192,689,250 | 貸付有価証券<br>600株    |
| 9006 | 京浜急行電鉄         | 586,300   | 1,445.50 | 847,496,650   | 貸付有価証券<br>9,200株  |
| 9007 | 小田急電鉄          | 783,500   | 1,657.00 | 1,298,259,500 | 貸付有価証券<br>12,300株 |
| 9008 | 京王電鉄           | 1,132,700 | 736.30   | 834,007,010   | 貸付有価証券<br>11,400株 |

|      |                     |           |          |               |                   |
|------|---------------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 9009 | 京成電鉄                | 899,800   | 1,117.50 | 1,005,526,500 | 貸付有価証券<br>6,200株  |
| 9010 | 富士急行                | 63,600    | 2,563.00 | 163,006,800   | 貸付有価証券<br>18,800株 |
| 9020 | 東日本旅客鉄道             | 2,850,400 | 3,343.00 | 9,528,887,200 | 貸付有価証券<br>40,900株 |
| 9021 | 西日本旅客鉄道             | 1,232,700 | 2,637.50 | 3,251,246,250 |                   |
| 9022 | 東海旅客鉄道              | 2,128,600 | 3,341.00 | 7,111,652,600 | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 9023 | 東京地下鉄               | 823,100   | 1,379.00 | 1,135,054,900 |                   |
| 9024 | 西武ホールディングス          | 531,900   | 3,018.00 | 1,605,274,200 | 貸付有価証券<br>8,100株  |
| 9025 | 鴻池運輸                | 88,100    | 2,670.00 | 235,227,000   | 貸付有価証券<br>20,200株 |
| 9031 | 西日本鉄道               | 149,600   | 2,838.50 | 424,639,600   | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 9037 | ハマキョウレックス           | 161,700   | 1,789.00 | 289,281,300   | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 9039 | サカイ引越センター           | 65,400    | 2,889.00 | 188,940,600   | 貸付有価証券<br>20,400株 |
| 9041 | 近鉄グループホールディングス      | 552,800   | 3,322.00 | 1,836,401,600 | 貸付有価証券<br>8,000株  |
| 9042 | 阪急阪神ホールディングス        | 680,500   | 4,129.00 | 2,809,784,500 | 貸付有価証券<br>9,900株  |
| 9044 | NANKA I             | 235,900   | 2,767.00 | 652,735,300   | 貸付有価証券<br>300株    |
| 9045 | 京阪ホールディングス          | 268,400   | 3,127.00 | 839,286,800   | 貸付有価証券<br>3,900株  |
| 9046 | 神戸電鉄                | 14,000    | 2,387.00 | 33,418,000    | 貸付有価証券<br>4,400株  |
| 9048 | 名古屋鉄道               | 570,300   | 1,796.50 | 1,024,543,950 |                   |
| 9052 | 山陽電気鉄道              | 38,800    | 1,914.00 | 74,263,200    | 貸付有価証券<br>11,100株 |
| 9064 | ヤマトホールディングス         | 627,100   | 1,812.00 | 1,136,305,200 | 貸付有価証券<br>8,000株  |
| 9065 | 山九                  | 112,500   | 8,598.00 | 967,275,000   |                   |
| 9068 | 丸全昭和運輸              | 31,900    | 7,230.00 | 230,637,000   | 貸付有価証券<br>9,900株  |
| 9069 | センコーグループホールディングス    | 373,500   | 1,900.00 | 709,650,000   | 貸付有価証券<br>4,000株  |
| 9072 | ニッコンホールディングス        | 224,900   | 6,055.00 | 1,361,769,500 | 貸付有価証券<br>4,300株  |
| 9075 | 福山通運                | 53,000    | 5,710.00 | 302,630,000   | 貸付有価証券<br>16,500株 |
| 9076 | セイノーホールディングス        | 253,900   | 2,586.50 | 656,712,350   | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 9081 | 神奈川中央交通             | 14,600    | 3,510.00 | 51,246,000    | 貸付有価証券<br>4,300株  |
| 9090 | A Z－C O M丸和ホールディングス | 160,000   | 766.00   | 122,560,000   |                   |
| 9142 | 九州旅客鉄道              | 388,600   | 3,446.00 | 1,339,115,600 | 貸付有価証券<br>5,700株  |

|      |                                       |           |          |               |                   |
|------|---------------------------------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 9143 | S Gホールディングス                           | 866,400   | 1,489.50 | 1,290,502,800 | 貸付有価証券<br>12,500株 |
| 9147 | N I P P O N   E X P R E S Sホール<br>ディン | 516,600   | 4,967.00 | 2,565,952,200 | 貸付有価証券<br>5,500株  |
| 9101 | 日本郵船                                  | 1,027,100 | 5,271.00 | 5,413,844,100 | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 9104 | 商船三井                                  | 982,300   | 5,255.00 | 5,161,986,500 |                   |
| 9107 | 川崎汽船                                  | 1,111,900 | 2,447.00 | 2,720,819,300 | 貸付有価証券<br>16,000株 |
| 9110 | N Sユナイテッド海運                           | 32,400    | 6,710.00 | 217,404,000   | 貸付有価証券<br>500株    |
| 9119 | 飯野海運                                  | 189,400   | 1,401.00 | 265,349,400   | 貸付有価証券<br>300株    |
| 9308 | 乾汽船                                   | 65,500    | 1,436.00 | 94,058,000    | 貸付有価証券<br>7,200株  |
| 9201 | 日本航空                                  | 1,182,900 | 2,816.00 | 3,331,046,400 | 貸付有価証券<br>6,000株  |
| 9202 | A N Aホールディングス                         | 1,404,100 | 2,992.00 | 4,201,067,200 | 貸付有価証券<br>20,200株 |
| 9301 | 三菱倉庫                                  | 560,000   | 1,492.00 | 835,520,000   | 貸付有価証券<br>7,400株  |
| 9302 | 三井倉庫ホールディングス                          | 159,400   | 3,491.00 | 556,465,400   | 貸付有価証券<br>300株    |
| 9303 | 住友倉庫                                  | 148,100   | 3,715.00 | 550,191,500   | 貸付有価証券<br>46,000株 |
| 9304 | 澁澤倉庫                                  | 82,400    | 1,577.00 | 129,944,800   | 貸付有価証券<br>7,700株  |
| 9310 | 日本トランスシティ                             | 128,400   | 1,121.00 | 143,936,400   | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 9319 | 中央倉庫                                  | 27,600    | 1,767.00 | 48,769,200    | 貸付有価証券<br>8,200株  |
| 9324 | 安田倉庫                                  | 35,200    | 2,343.00 | 82,473,600    | 貸付有価証券<br>600株    |
| 9364 | 上組                                    | 226,600   | 4,716.00 | 1,068,645,600 | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 9369 | キューソー流通システム                           | 29,400    | 3,130.00 | 92,022,000    |                   |
| 9381 | エーアイテイー                               | 32,400    | 2,228.00 | 72,187,200    | 貸付有価証券<br>9,600株  |
| 2121 | M I X I                               | 96,500    | 2,552.00 | 246,268,000   |                   |
| 2307 | クロスキャット                               | 29,600    | 919.00   | 27,202,400    | 貸付有価証券<br>8,800株  |
| 2317 | システナ                                  | 740,800   | 386.00   | 285,948,800   | 貸付有価証券<br>10,700株 |
| 2326 | デジタルアーツ                               | 27,300    | 3,570.00 | 97,461,000    | 貸付有価証券<br>8,600株  |
| 2327 | 日鉄ソリューションズ                            | 141,500   | 3,214.00 | 454,781,000   | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 2335 | キューブシステム                              | 30,400    | 1,025.00 | 31,160,000    | 貸付有価証券<br>9,000株  |
| 2359 | コア                                    | 22,900    | 2,005.00 | 45,914,500    | 貸付有価証券<br>6,800株  |

|      |                  |           |          |               |                   |
|------|------------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 2432 | ディー・エヌ・エー        | 212,500   | 2,358.00 | 501,075,000   |                   |
| 2477 | 手間いらず            | 6,300     | 2,214.00 | 13,948,200    | 貸付有価証券<br>1,900株  |
| 3031 | ラクーンホールディングス     | 41,100    | 565.00   | 23,221,500    | 貸付有価証券<br>12,100株 |
| 3040 | ソリトンシステムズ        | 26,700    | 1,930.00 | 51,531,000    | 貸付有価証券<br>7,900株  |
| 3371 | ソフトクリエイトホールディングス | 42,600    | 1,680.00 | 71,568,000    | 貸付有価証券<br>3,800株  |
| 3626 | T I S            | 529,800   | 3,029.00 | 1,604,764,200 | 貸付有価証券<br>3,800株  |
| 3632 | グリーンホールディングス     | 173,700   | 380.00   | 66,006,000    |                   |
| 3633 | GMOペパボ           | 6,300     | 1,613.00 | 10,161,900    | 貸付有価証券<br>1,900株  |
| 3635 | コーエーテクモホールディングス  | 324,800   | 1,503.50 | 488,336,800   |                   |
| 3636 | 三菱総合研究所          | 27,900    | 4,410.00 | 123,039,000   | 貸付有価証券<br>8,300株  |
| 3649 | ファインデックス         | 36,000    | 791.00   | 28,476,000    | 貸付有価証券<br>10,700株 |
| 3656 | K L a b          | 154,800   | 209.00   | 32,353,200    | 貸付有価証券<br>41,900株 |
| 3657 | ポールトゥウィンホールディングス | 73,700    | 318.00   | 23,436,600    | 貸付有価証券<br>21,800株 |
| 3659 | ネクソン             | 1,226,000 | 2,134.00 | 2,616,284,000 |                   |
| 3660 | アイスタイル           | 198,400   | 366.00   | 72,614,400    | 貸付有価証券<br>60,300株 |
| 3661 | エムアップホールディングス    | 127,000   | 630.00   | 80,010,000    | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 3662 | エイチームホールディングス    | 36,400    | 948.00   | 34,507,200    | 貸付有価証券<br>10,800株 |
| 3663 | セルシス             | 67,200    | 1,842.00 | 123,782,400   | 貸付有価証券<br>7,400株  |
| 3665 | エニグモ             | 57,700    | 375.00   | 21,637,500    | 貸付有価証券<br>17,000株 |
| 3668 | コロプラ             | 176,400   | 354.00   | 62,445,600    | 貸付有価証券<br>52,200株 |
| 3673 | ブロードリーフ          | 189,200   | 740.00   | 140,008,000   | 貸付有価証券<br>55,900株 |
| 3676 | デジタルハーツホールディングス  | 32,300    | 705.00   | 22,771,500    | 貸付有価証券<br>10,000株 |
| 3678 | メディアドゥ           | 17,600    | 1,286.00 | 22,633,600    | 貸付有価証券<br>5,200株  |
| 3679 | じげん              | 148,800   | 376.00   | 55,948,800    | 貸付有価証券<br>44,000株 |
| 3687 | フィックスターズ         | 71,500    | 2,688.00 | 192,192,000   | 貸付有価証券<br>21,100株 |
| 3694 | オプティム            | 52,800    | 403.00   | 21,278,400    | 貸付有価証券<br>16,400株 |
| 3696 | セレス              | 23,400    | 1,699.00 | 39,756,600    | 貸付有価証券<br>6,900株  |

|      |                       |         |          |             |                   |
|------|-----------------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| 3697 | SHIFT                 | 517,000 | 614.00   | 317,438,000 | 貸付有価証券<br>6,700株  |
| 3741 | セック                   | 15,800  | 3,245.00 | 51,271,000  | 貸付有価証券<br>5,100株  |
| 3762 | テクマトリックス              | 103,300 | 1,651.00 | 170,548,300 | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 3763 | プロシップ                 | 41,700  | 1,653.00 | 68,930,100  | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| 3765 | ガンホー・オンライン・エンターテイメント  | 120,300 | 2,209.00 | 265,742,700 | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 3769 | GMOペイメントゲートウェイ        | 118,400 | 8,277.00 | 979,996,800 | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 3771 | システムリサーチ              | 38,800  | 1,732.00 | 67,201,600  | 貸付有価証券<br>12,100株 |
| 3774 | インターネットイニシアティブ        | 283,700 | 3,070.00 | 870,959,000 | 貸付有価証券<br>4,100株  |
| 3778 | さくらインターネット            | 72,900  | 2,989.00 | 217,898,100 | 貸付有価証券<br>23,100株 |
| 3788 | GMOグローバルサイン・ホールディングス  | 15,800  | 1,932.00 | 30,525,600  | 貸付有価証券<br>4,800株  |
| 3817 | SRAホールディングス           | 29,500  | 4,280.00 | 126,260,000 | 貸付有価証券<br>9,200株  |
| 3834 | 朝日ネット                 | 55,700  | 603.00   | 33,587,100  | 貸付有価証券<br>16,500株 |
| 3835 | eBASE                 | 63,800  | 396.00   | 25,264,800  | 貸付有価証券<br>18,900株 |
| 3836 | アバントグループ              | 55,700  | 1,077.00 | 59,988,900  | 貸付有価証券<br>16,500株 |
| 3837 | アドソル日進                | 40,100  | 1,310.00 | 52,531,000  | 貸付有価証券<br>11,900株 |
| 3843 | フリービット                | 27,200  | 1,469.00 | 39,956,800  |                   |
| 3844 | コムチュア                 | 68,500  | 1,241.00 | 85,008,500  | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 3853 | アステリア                 | 40,600  | 1,178.00 | 47,826,800  | 貸付有価証券<br>12,000株 |
| 3854 | アイル                   | 33,900  | 2,133.00 | 72,308,700  | 貸付有価証券<br>10,100株 |
| 3901 | マークライnz               | 30,700  | 1,220.00 | 37,454,000  | 貸付有価証券<br>9,100株  |
| 3903 | gumi                  | 93,800  | 224.00   | 21,011,200  | 貸付有価証券<br>27,700株 |
| 3915 | テラスカイ                 | 17,500  | 2,464.00 | 43,120,000  | 貸付有価証券<br>5,500株  |
| 3916 | デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 53,900  | 802.00   | 43,227,800  | 貸付有価証券<br>16,000株 |
| 3921 | ネオジャパン                | 13,600  | 1,519.00 | 20,658,400  | 貸付有価証券<br>4,100株  |
| 3922 | PR TIMES              | 10,500  | 2,213.00 | 23,236,500  | 貸付有価証券<br>200株    |
| 3923 | ラクス                   | 479,500 | 890.50   | 426,994,750 | 貸付有価証券<br>7,000株  |

|      |                                 |           |          |               |                   |
|------|---------------------------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 3925 | ダブルスタンダード                       | 18,400    | 1,149.00 | 21,141,600    | 貸付有価証券<br>5,400株  |
| 3926 | オープンドア                          | 30,200    | 288.00   | 8,697,600     | 貸付有価証券<br>8,900株  |
| 3932 | アカツキ                            | 25,300    | 2,859.00 | 72,332,700    |                   |
| 3937 | U b i c o mホールディングス             | 16,600    | 930.00   | 15,438,000    | 貸付有価証券<br>4,900株  |
| 3939 | カナミックネットワーク                     | 65,100    | 476.00   | 30,987,600    | 貸付有価証券<br>19,300株 |
| 3962 | チェンジホールディングス                    | 99,900    | 940.00   | 93,906,000    | 貸付有価証券<br>29,500株 |
| 3964 | オークネット                          | 92,800    | 1,375.00 | 127,600,000   | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 3983 | オロ                              | 21,100    | 1,932.00 | 40,765,200    | 貸付有価証券<br>6,200株  |
| 3984 | ユーザーローカル                        | 22,000    | 1,655.00 | 36,410,000    | 貸付有価証券<br>6,500株  |
| 3993 | P K S H A   T e c h n o l o g y | 55,600    | 2,622.00 | 145,783,200   | 貸付有価証券<br>16,400株 |
| 3994 | マネーフォワード                        | 118,100   | 3,940.00 | 465,314,000   |                   |
| 4051 | GMOフィナンシャルゲート                   | 9,700     | 6,510.00 | 63,147,000    |                   |
| 4053 | S u n   A s t e r i s k         | 46,400    | 421.00   | 19,534,400    | 貸付有価証券<br>14,600株 |
| 4071 | プラスアルファ・コンサルティング                | 73,700    | 2,520.00 | 185,724,000   | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 4072 | 電算システムホールディングス                  | 23,000    | 2,819.00 | 64,837,000    | 貸付有価証券<br>6,800株  |
| 4180 | A p p i e r   G r o u p         | 198,600   | 733.00   | 145,573,800   | 貸付有価証券<br>58,700株 |
| 4194 | ビジョナル                           | 70,000    | 7,058.00 | 494,060,000   |                   |
| 4299 | ハイマックス                          | 14,400    | 1,171.00 | 16,862,400    | 貸付有価証券<br>4,200株  |
| 4307 | 野村総合研究所                         | 1,011,100 | 4,267.00 | 4,314,363,700 | 貸付有価証券<br>16,100株 |
| 4323 | 日本システム技術                        | 48,000    | 1,512.00 | 72,576,000    | 貸付有価証券<br>14,200株 |
| 4326 | インテージホールディングス                   | 39,100    | 1,700.00 | 66,470,000    | 貸付有価証券<br>12,200株 |
| 4344 | ソースネクスト                         | 268,900   | 101.00   | 27,158,900    | 貸付有価証券<br>82,800株 |
| 4373 | シンプレクス・ホールディングス                 | 412,400   | 916.00   | 377,758,400   | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 4382 | H E R O Z                       | 20,600    | 717.00   | 14,770,200    | 貸付有価証券<br>6,400株  |
| 4385 | メルカリ                            | 223,200   | 3,908.00 | 872,265,600   | 貸付有価証券<br>4,100株  |
| 4390 | I P S                           | 15,200    | 3,355.00 | 50,996,000    | 貸付有価証券<br>4,800株  |
| 4396 | システムサポートホールディングス                | 44,200    | 945.00   | 41,769,000    | 貸付有価証券<br>13,100株 |

|      |                         |           |          |               |                    |
|------|-------------------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 4413 | ボードルア                   | 37,300    | 2,457.00 | 91,646,100    | 貸付有価証券<br>11,000株  |
| 441A | N E                     | 50,600    | 221.00   | 11,182,600    | 貸付有価証券<br>14,900株  |
| 4420 | イーソル                    | 34,800    | 813.00   | 28,292,400    | 貸付有価証券<br>10,300株  |
| 4432 | ウイングアーク 1 s t           | 54,200    | 2,255.00 | 122,221,000   | 貸付有価証券<br>16,800株  |
| 4434 | サーバーワークス                | 10,700    | 1,904.00 | 20,372,800    | 貸付有価証券<br>3,200株   |
| 4443 | S a n s a n             | 171,500   | 1,428.00 | 244,902,000   | 貸付有価証券<br>50,800株  |
| 4449 | ギフトィ                    | 40,300    | 1,002.00 | 40,380,600    |                    |
| 4480 | メドレー                    | 63,300    | 1,997.00 | 126,410,100   | 貸付有価証券<br>19,700株  |
| 4481 | ベース                     | 21,800    | 2,854.00 | 62,217,200    | 貸付有価証券<br>6,900株   |
| 4483 | J M D C                 | 75,900    | 2,701.00 | 205,005,900   |                    |
| 4662 | フォーカスシステムズ              | 34,600    | 1,607.00 | 55,602,200    | 貸付有価証券<br>10,300株  |
| 4674 | クレスコ                    | 89,300    | 1,434.00 | 128,056,200   |                    |
| 4676 | フジ・メディア・ホールディングス        | 407,400   | 3,989.00 | 1,625,118,600 |                    |
| 4684 | オービック                   | 962,600   | 3,687.00 | 3,549,106,200 | 貸付有価証券<br>13,800株  |
| 4686 | ジャストシステム                | 74,500    | 3,540.00 | 263,730,000   | 貸付有価証券<br>1,100株   |
| 4687 | T D C ソフト               | 97,100    | 847.00   | 82,243,700    | 貸付有価証券<br>30,000株  |
| 4689 | L I N E ヤフー             | 7,983,900 | 409.70   | 3,271,003,830 | 貸付有価証券<br>118,900株 |
| 4704 | トレンドマイクロ                | 299,600   | 5,698.00 | 1,707,120,800 | 貸付有価証券<br>1,100株   |
| 4709 | I D ホールディングス            | 66,600    | 1,050.00 | 69,930,000    | 貸付有価証券<br>14,700株  |
| 4716 | 日本オラクル                  | 99,200    | 8,223.00 | 815,721,600   |                    |
| 4719 | アルファシステムズ               | 16,300    | 3,400.00 | 55,420,000    | 貸付有価証券<br>4,800株   |
| 4722 | フューチャー                  | 110,600   | 1,453.00 | 160,701,800   | 貸付有価証券<br>34,300株  |
| 4725 | C A C   H o l d i n g s | 31,800    | 1,760.00 | 55,968,000    | 貸付有価証券<br>9,400株   |
| 4733 | オービックビジネスコンサルタント        | 87,400    | 5,723.00 | 500,190,200   | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 4743 | アイティフォー                 | 53,900    | 1,590.00 | 85,701,000    | 貸付有価証券<br>900株     |
| 4746 | 東計電算                    | 14,500    | 4,380.00 | 63,510,000    | 貸付有価証券<br>300株     |
| 4768 | 大塚商会                    | 587,600   | 2,713.50 | 1,594,452,600 | 貸付有価証券<br>8,500株   |
| 4776 | サイボウズ                   | 71,400    | 2,165.00 | 154,581,000   | 貸付有価証券<br>1,100株   |

|      |                  |             |          |                |                      |
|------|------------------|-------------|----------|----------------|----------------------|
| 4812 | 電通総研             | 189,000     | 1,993.00 | 376,677,000    |                      |
| 4819 | デジタルガレージ         | 73,900      | 1,727.00 | 127,625,300    | 貸付有価証券<br>22,500株    |
| 4820 | ＥＭシステムズ          | 68,100      | 488.00   | 33,232,800     | 貸付有価証券<br>21,100株    |
| 4825 | ウェザーニューズ         | 73,300      | 1,981.00 | 145,207,300    | 貸付有価証券<br>21,600株    |
| 4826 | ＣＩＪ              | 125,200     | 497.00   | 62,224,400     | 貸付有価証券<br>37,000株    |
| 4828 | ビジネスエンジニアリング     | 60,900      | 958.00   | 58,342,200     | 貸付有価証券<br>18,000株    |
| 4839 | ＷＯＷＯＷ            | 39,000      | 983.00   | 38,337,000     | 貸付有価証券<br>11,500株    |
| 4845 | スカラ              | 48,100      | 333.00   | 16,017,300     | 貸付有価証券<br>14,200株    |
| 5032 | ＡＮＹＣＯＬＯＲ         | 82,700      | 2,054.00 | 169,865,800    | 貸付有価証券<br>25,500株    |
| 5036 | 日本ビジネスシステムズ      | 56,100      | 1,388.00 | 77,866,800     |                      |
| 545A | トランヴィア           | 30,600      | 875.00   | 26,775,000     | 貸付有価証券<br>9,100株     |
| 6199 | セラク              | 15,900      | 1,112.00 | 17,680,800     | 貸付有価証券<br>5,000株     |
| 7527 | システムソフト          | 213,200     | 47.00    | 10,020,400     | 貸付有価証券<br>63,100株    |
| 7595 | アルゴグラフィックス       | 185,600     | 1,184.00 | 219,750,400    | 貸付有価証券<br>2,800株     |
| 7844 | マーベラス            | 96,200      | 425.00   | 40,885,000     | 貸付有価証券<br>28,500株    |
| 7860 | エイベックス           | 88,700      | 1,183.00 | 104,932,100    | 貸付有価証券<br>24,200株    |
| 8056 | ＢＩＰＲＯＧＹ          | 172,100     | 4,138.00 | 712,149,800    |                      |
| 8157 | 都築電気             | 33,000      | 3,955.00 | 130,515,000    | 貸付有価証券<br>6,900株     |
| 9401 | ＴＢＳホールディングス      | 256,000     | 5,991.00 | 1,533,696,000  | 貸付有価証券<br>3,700株     |
| 9404 | 日本テレビホールディングス    | 454,400     | 2,698.50 | 1,226,198,400  | 貸付有価証券<br>6,600株     |
| 9405 | 朝日放送グループホールディングス | 64,700      | 760.00   | 49,172,000     | 貸付有価証券<br>19,100株    |
| 9409 | テレビ朝日ホールディングス    | 125,900     | 3,070.00 | 386,513,000    |                      |
| 9412 | スカパーＪＳＡＴ         | 345,200     | 2,592.00 | 894,758,400    | 貸付有価証券<br>5,800株     |
| 9413 | テレビ東京ホールディングス    | 32,000      | 3,470.00 | 111,040,000    | 貸付有価証券<br>10,000株    |
| 9416 | ビジョン             | 108,300     | 975.00   | 105,592,500    |                      |
| 9418 | Ｕ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ  | 174,300     | 1,570.00 | 273,651,000    | 貸付有価証券<br>2,500株     |
| 9424 | 日本通信             | 419,200     | 107.00   | 44,854,400     | 貸付有価証券<br>124,100株   |
| 9432 | ＮＴＴ              | 142,334,700 | 143.80   | 20,467,729,860 | 貸付有価証券<br>2,208,700株 |

|      |                      |            |           |                |                    |
|------|----------------------|------------|-----------|----------------|--------------------|
| 9433 | K D D I              | 7,285,000  | 2,668.50  | 19,440,022,500 | 貸付有価証券<br>104,400株 |
| 9434 | ソフトバンク               | 83,471,000 | 203.30    | 16,969,654,300 | 貸付有価証券<br>329,300株 |
| 9435 | 光通信                  | 51,000     | 35,400.00 | 1,805,400,000  | 貸付有価証券<br>900株     |
| 9438 | エムティーアイ              | 35,000     | 530.00    | 18,550,000     | 貸付有価証券<br>11,000株  |
| 9449 | GMOインターネットグループ       | 166,000    | 3,227.00  | 535,682,000    | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 9450 | ファイバーゲート             | 23,900     | 745.00    | 17,805,500     | 貸付有価証券<br>7,200株   |
| 9468 | K A D O K A W A      | 288,000    | 3,361.00  | 967,968,000    | 貸付有価証券<br>1,700株   |
| 9470 | 学研ホールディングス           | 86,300     | 1,009.00  | 87,076,700     | 貸付有価証券<br>26,900株  |
| 9474 | ゼンリン                 | 77,500     | 849.00    | 65,797,500     | 貸付有価証券<br>22,900株  |
| 9601 | 松竹                   | 29,600     | 10,220.00 | 302,512,000    | 貸付有価証券<br>9,300株   |
| 9602 | 東宝                   | 1,314,300  | 1,278.00  | 1,679,675,400  | 貸付有価証券<br>22,000株  |
| 9605 | 東映                   | 85,600     | 5,680.00  | 486,208,000    | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 9629 | ピー・シー・エー             | 34,000     | 1,253.00  | 42,602,000     | 貸付有価証券<br>10,100株  |
| 9658 | ビジネスブレイン太田昭和         | 55,600     | 978.00    | 54,376,800     |                    |
| 9682 | D T S                | 412,000    | 967.00    | 398,404,000    | 貸付有価証券<br>5,200株   |
| 9684 | スクウェア・エニックス・ホールディングス | 852,600    | 2,362.50  | 2,014,267,500  | 貸付有価証券<br>11,400株  |
| 9692 | シーイーシー               | 61,200     | 2,063.00  | 126,255,600    | 貸付有価証券<br>900株     |
| 9697 | カプコン                 | 1,030,200  | 2,889.00  | 2,976,247,800  | 貸付有価証券<br>14,800株  |
| 9702 | アイ・エス・ビー             | 24,400     | 2,290.00  | 55,876,000     | 貸付有価証券<br>7,200株   |
| 9739 | N S W                | 23,000     | 2,506.00  | 57,638,000     |                    |
| 9742 | アイネス                 | 40,400     | 2,088.00  | 84,355,200     | 貸付有価証券<br>12,600株  |
| 9746 | T K C                | 87,400     | 3,310.00  | 289,294,000    | 貸付有価証券<br>25,900株  |
| 9759 | N S D                | 182,800    | 2,412.50  | 441,005,000    | 貸付有価証券<br>2,900株   |
| 9766 | コナミグループ              | 221,900    | 17,380.00 | 3,856,622,000  | 貸付有価証券<br>2,800株   |
| 9790 | 福井コンピュータホールディングス     | 28,000     | 3,045.00  | 85,260,000     | 貸付有価証券<br>8,900株   |
| 9889 | J B C Cホールディングス      | 137,400    | 1,195.00  | 164,193,000    | 貸付有価証券<br>42,700株  |
| 9928 | ミロク情報サービス            | 43,700     | 1,727.00  | 75,469,900     | 貸付有価証券<br>12,900株  |

|      |                     |           |           |                |                   |
|------|---------------------|-----------|-----------|----------------|-------------------|
| 9984 | ソフトバンクグループ          | 9,936,100 | 7,118.00  | 70,725,159,800 |                   |
| 167A | リョーサン菱洋ホールディングス     | 104,400   | 2,671.00  | 278,852,400    | 貸付有価証券<br>32,100株 |
| 2676 | 高千穂交易               | 43,300    | 2,164.00  | 93,701,200     | 貸付有価証券<br>12,800株 |
| 2733 | あらた                 | 83,600    | 2,416.00  | 201,977,600    | 貸付有価証券<br>25,900株 |
| 2737 | トーメンデバイス            | 7,900     | 18,610.00 | 147,019,000    | 貸付有価証券<br>200株    |
| 2760 | 東京エレクトロン デバイス       | 54,500    | 3,940.00  | 214,730,000    | 貸付有価証券<br>16,900株 |
| 2767 | 円谷フィールズホールディングス     | 101,200   | 1,358.00  | 137,429,600    |                   |
| 2768 | 双日                  | 527,700   | 5,235.00  | 2,762,509,500  | 貸付有価証券<br>8,100株  |
| 2784 | アルフレッサ ホールディングス     | 517,700   | 2,173.00  | 1,124,962,100  | 貸付有価証券<br>6,900株  |
| 2874 | 横浜冷凍                | 125,900   | 1,965.00  | 247,393,500    | 貸付有価証券<br>39,300株 |
| 3023 | ラサ商事                | 28,600    | 1,787.00  | 51,108,200     | 貸付有価証券<br>9,000株  |
| 3036 | アルコニックス             | 84,200    | 2,394.00  | 201,574,800    | 貸付有価証券<br>25,100株 |
| 3038 | 神戸物産                | 475,900   | 2,564.00  | 1,220,207,600  | 貸付有価証券<br>6,900株  |
| 3076 | あい ホールディングス         | 109,400   | 2,748.00  | 300,631,200    | 貸付有価証券<br>17,400株 |
| 3107 | ダイワボウホールディングス       | 205,200   | 3,385.00  | 694,602,000    | 貸付有価証券<br>3,200株  |
| 3132 | マクニカホールディングス        | 380,700   | 3,329.00  | 1,267,350,300  | 貸付有価証券<br>6,000株  |
| 3139 | ラクト・ジャパン            | 23,300    | 3,230.00  | 75,259,000     | 貸付有価証券<br>7,300株  |
| 3151 | バイタルケーエスケー・ホールディングス | 75,200    | 1,533.00  | 115,281,600    | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 3153 | 八洲電機                | 41,000    | 2,833.00  | 116,153,000    | 貸付有価証券<br>12,100株 |
| 3154 | メディアスホールディングス       | 35,500    | 843.00    | 29,926,500     | 貸付有価証券<br>11,100株 |
| 3156 | レスター                | 46,500    | 4,540.00  | 211,110,000    |                   |
| 3167 | TOKAIホールディングス       | 293,100   | 1,136.00  | 332,961,600    | 貸付有価証券<br>4,300株  |
| 3176 | 三洋貿易                | 67,300    | 1,555.00  | 104,651,500    | 貸付有価証券<br>19,900株 |
| 3180 | ビューティガレージ           | 17,300    | 1,388.00  | 24,012,400     | 貸付有価証券<br>5,100株  |
| 3183 | ウイン・パートナーズ          | 39,800    | 1,223.00  | 48,675,400     | 貸付有価証券<br>11,800株 |
| 3360 | シップヘルスケアホールディングス    | 200,600   | 2,099.50  | 421,159,700    | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| 3388 | 明治電機工業              | 27,100    | 2,094.00  | 56,747,400     | 貸付有価証券<br>8,000株  |

|      |                        |         |          |               |                   |
|------|------------------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 3543 | コメダホールディングス            | 134,200 | 2,737.00 | 367,305,400   | 貸付有価証券<br>35,600株 |
| 3565 | アセンテック                 | 67,600  | 375.00   | 25,350,000    |                   |
| 546A | M I R A I N I ホールディングス | 82,300  | 1,800.00 | 148,140,000   |                   |
| 7128 | ユニソルホールディングス           | 47,000  | 2,114.00 | 99,358,000    | 貸付有価証券<br>14,600株 |
| 7130 | ヤマエグループホールディングス        | 53,700  | 2,790.00 | 149,823,000   | 貸付有価証券<br>900株    |
| 7414 | 小野建                    | 58,300  | 1,321.00 | 77,014,300    | 貸付有価証券<br>18,100株 |
| 7433 | 伯東                     | 32,700  | 4,540.00 | 148,458,000   |                   |
| 7438 | コンドーテック                | 45,800  | 1,490.00 | 68,242,000    | 貸付有価証券<br>13,600株 |
| 7447 | ナガイレーベン                | 59,400  | 1,632.00 | 96,940,800    | 貸付有価証券<br>18,600株 |
| 7456 | 松田産業                   | 41,600  | 5,730.00 | 238,368,000   | 貸付有価証券<br>600株    |
| 7458 | 第一興商                   | 180,900 | 1,642.00 | 297,037,800   | 貸付有価証券<br>3,100株  |
| 7459 | メディパルホールディングス          | 584,400 | 2,612.50 | 1,526,745,000 | 貸付有価証券<br>8,500株  |
| 7466 | S P K                  | 44,500  | 1,271.00 | 56,559,500    | 貸付有価証券<br>13,200株 |
| 7476 | アズワン                   | 174,000 | 2,210.50 | 384,627,000   | 貸付有価証券<br>2,300株  |
| 7480 | スズデン                   | 28,200  | 2,259.00 | 63,703,800    |                   |
| 7482 | シモジマ                   | 41,100  | 1,330.00 | 54,663,000    | 貸付有価証券<br>9,800株  |
| 7483 | ドウシシャ                  | 65,000  | 2,836.00 | 184,340,000   | 貸付有価証券<br>20,000株 |
| 7504 | 高速                     | 36,500  | 3,255.00 | 118,807,500   | 貸付有価証券<br>11,300株 |
| 7510 | たけびし                   | 20,900  | 2,341.00 | 48,926,900    |                   |
| 7525 | リックス                   | 13,800  | 3,465.00 | 47,817,000    | 貸付有価証券<br>4,100株  |
| 7537 | 丸文                     | 48,800  | 1,717.00 | 83,789,600    | 貸付有価証券<br>15,100株 |
| 7552 | ハピネット                  | 74,400  | 2,839.00 | 211,221,600   | 貸付有価証券<br>23,400株 |
| 7570 | 橋本総業ホールディングス           | 18,500  | 1,377.00 | 25,474,500    | 貸付有価証券<br>5,900株  |
| 7575 | 日本ライフライン               | 137,800 | 1,261.00 | 173,765,800   | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 7590 | タカショー                  | 44,200  | 399.00   | 17,635,800    | 貸付有価証券<br>13,100株 |
| 7599 | I D O M                | 165,300 | 1,359.00 | 224,642,700   | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| 7607 | 進和                     | 32,000  | 3,175.00 | 101,600,000   | 貸付有価証券<br>10,000株 |
| 7609 | ダイトロン                  | 45,200  | 3,815.00 | 172,438,000   | 貸付有価証券<br>800株    |

|      |                 |            |          |                |                    |
|------|-----------------|------------|----------|----------------|--------------------|
| 7613 | シークス            | 87,700     | 1,347.00 | 118,131,900    |                    |
| 7628 | オーハシテクニカ        | 49,800     | 1,095.00 | 54,531,000     | 貸付有価証券<br>14,700株  |
| 7637 | 白銅              | 15,300     | 3,495.00 | 53,473,500     | 貸付有価証券<br>4,500株   |
| 8001 | 伊藤忠商事           | 18,380,000 | 1,814.00 | 33,341,320,000 | 貸付有価証券<br>57,300株  |
| 8002 | 丸紅              | 4,173,000  | 4,607.00 | 19,225,011,000 | 貸付有価証券<br>64,400株  |
| 8012 | 長瀬産業            | 934,700    | 1,207.00 | 1,128,182,900  | 貸付有価証券<br>13,600株  |
| 8014 | 蝶理              | 29,300     | 3,820.00 | 111,926,000    | 貸付有価証券<br>500株     |
| 8015 | 豊田通商            | 1,642,400  | 6,000.00 | 9,854,400,000  | 貸付有価証券<br>3,900株   |
| 8018 | 三共生興            | 71,100     | 793.00   | 56,382,300     | 貸付有価証券<br>22,100株  |
| 8020 | 兼松              | 457,300    | 2,060.00 | 942,038,000    | 貸付有価証券<br>6,100株   |
| 8031 | 三井物産            | 7,751,700  | 4,446.00 | 34,464,058,200 | 貸付有価証券<br>112,700株 |
| 8032 | 日本紙パルプ商事        | 290,400    | 1,069.00 | 310,437,600    | 貸付有価証券<br>89,700株  |
| 8037 | カメイ             | 51,000     | 3,425.00 | 174,675,000    | 貸付有価証券<br>15,100株  |
| 8043 | スターゼン           | 124,500    | 1,194.00 | 148,653,000    | 貸付有価証券<br>38,600株  |
| 8051 | 山善              | 165,800    | 1,688.00 | 279,870,400    | 貸付有価証券<br>2,700株   |
| 8052 | 椿本興業            | 37,700     | 2,676.00 | 100,885,200    | 貸付有価証券<br>11,700株  |
| 8053 | 住友商事            | 3,233,000  | 6,130.00 | 19,818,290,000 | 貸付有価証券<br>35,500株  |
| 8057 | 内田洋行            | 110,800    | 1,948.00 | 215,838,400    | 貸付有価証券<br>1,500株   |
| 8058 | 三菱商事            | 10,040,600 | 4,400.00 | 44,178,640,000 | 貸付有価証券<br>20,200株  |
| 8059 | 第一実業            | 50,700     | 2,990.00 | 151,593,000    | 貸付有価証券<br>15,800株  |
| 8060 | キヤノンマーケティングジャパン | 257,600    | 3,327.00 | 857,035,200    | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 8061 | 西華産業            | 78,600     | 2,755.00 | 216,543,000    | 貸付有価証券<br>24,400株  |
| 8065 | 佐藤商事            | 37,900     | 2,941.00 | 111,463,900    | 貸付有価証券<br>11,800株  |
| 8070 | 東京産業            | 55,400     | 807.00   | 44,707,800     |                    |
| 8074 | Y U A S A       | 47,000     | 5,130.00 | 241,110,000    | 貸付有価証券<br>14,200株  |
| 8075 | 神鋼商事            | 41,100     | 2,392.00 | 98,311,200     | 貸付有価証券<br>12,800株  |
| 8078 | 阪和興業            | 450,000    | 1,674.00 | 753,300,000    | 貸付有価証券<br>6,500株   |

|      |                   |           |          |               |                   |
|------|-------------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 8079 | 正栄食品工業            | 36,400    | 4,085.00 | 148,694,000   | 貸付有価証券<br>600株    |
| 8081 | カナデン              | 43,500    | 2,517.00 | 109,489,500   | 貸付有価証券<br>13,500株 |
| 8084 | RYODEN            | 41,800    | 3,885.00 | 162,393,000   | 貸付有価証券<br>13,000株 |
| 8088 | 岩谷産業              | 543,300   | 1,885.00 | 1,024,120,500 | 貸付有価証券<br>7,800株  |
| 8093 | 極東貿易              | 30,500    | 1,683.00 | 51,331,500    | 貸付有価証券<br>9,200株  |
| 8095 | アステナホールディングス      | 103,300   | 510.00   | 52,683,000    | 貸付有価証券<br>30,600株 |
| 8097 | 三愛オブリ             | 121,800   | 2,063.00 | 251,273,400   | 貸付有価証券<br>37,900株 |
| 8098 | 稲畑産業              | 124,600   | 3,900.00 | 485,940,000   | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 8101 | G S I クレオス        | 31,700    | 2,355.00 | 74,653,500    | 貸付有価証券<br>4,200株  |
| 8103 | 明和産業              | 78,000    | 868.00   | 67,704,000    | 貸付有価証券<br>24,300株 |
| 8125 | ワキタ               | 90,500    | 1,676.00 | 151,678,000   | 貸付有価証券<br>28,000株 |
| 8129 | 東邦ホールディングス        | 155,300   | 3,828.00 | 594,488,400   | 貸付有価証券<br>2,100株  |
| 8130 | サンゲツ              | 137,300   | 2,921.00 | 401,053,300   | 貸付有価証券<br>42,600株 |
| 8131 | ミツウロコグループホールディングス | 66,200    | 1,900.00 | 125,780,000   | 貸付有価証券<br>20,600株 |
| 8132 | シナネンホールディングス      | 10,700    | 7,260.00 | 77,682,000    | 貸付有価証券<br>3,200株  |
| 8133 | 伊藤忠エネクス           | 135,500   | 1,997.00 | 270,593,500   | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 8136 | サンリオ              | 2,715,100 | 1,005.50 | 2,730,033,050 | 貸付有価証券<br>32,000株 |
| 8137 | サンワテクノス           | 31,000    | 3,700.00 | 114,700,000   | 貸付有価証券<br>9,200株  |
| 8141 | 新光商事              | 65,900    | 1,574.00 | 103,726,600   |                   |
| 8142 | トーヨー              | 63,900    | 1,347.00 | 86,073,300    | 貸付有価証券<br>1,200株  |
| 8150 | 三信電気              | 31,500    | 2,730.00 | 85,995,000    | 貸付有価証券<br>9,700株  |
| 8151 | 東陽テクニカ            | 45,400    | 2,000.00 | 90,800,000    | 貸付有価証券<br>14,200株 |
| 8153 | モスフードサービス         | 80,400    | 3,550.00 | 285,420,000   | 貸付有価証券<br>25,000株 |
| 8154 | 加賀電子              | 101,400   | 4,325.00 | 438,555,000   | 貸付有価証券<br>9,100株  |
| 8158 | ソーダニッカ            | 53,300    | 1,113.00 | 59,322,900    | 貸付有価証券<br>15,800株 |
| 8159 | 立花エレテック           | 32,600    | 3,235.00 | 105,461,000   | 貸付有価証券<br>10,200株 |

|      |                   |         |          |               |                   |
|------|-------------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 8275 | フォーバル             | 21,400  | 1,005.00 | 21,507,000    | 貸付有価証券<br>6,500株  |
| 8283 | P A L T A C       | 83,900  | 6,638.00 | 556,928,200   |                   |
| 8285 | 三谷産業              | 95,500  | 702.00   | 67,041,000    | 貸付有価証券<br>28,200株 |
| 9273 | コア商事ホールディングス      | 48,800  | 748.00   | 36,502,400    |                   |
| 9274 | K P Pグループホールディングス | 143,000 | 1,007.00 | 144,001,000   | 貸付有価証券<br>42,300株 |
| 9305 | ヤマタネ              | 43,900  | 2,025.00 | 88,897,500    | 貸付有価証券<br>13,000株 |
| 9824 | 泉州電業              | 34,800  | 7,170.00 | 249,516,000   | 貸付有価証券<br>500株    |
| 9830 | トラスコ中山            | 114,800 | 2,200.00 | 252,560,000   | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 9832 | オートバックスセブン        | 190,300 | 1,449.00 | 275,744,700   | 貸付有価証券<br>10,600株 |
| 9837 | モリト               | 38,900  | 1,754.00 | 68,230,600    |                   |
| 9869 | 加藤産業              | 67,600  | 5,800.00 | 392,080,000   | 貸付有価証券<br>20,000株 |
| 9882 | イエローハット           | 133,000 | 1,763.00 | 234,479,000   | 貸付有価証券<br>2,500株  |
| 9896 | J Kホールディングス       | 36,000  | 1,440.00 | 51,840,000    | 貸付有価証券<br>10,600株 |
| 9902 | 日伝                | 30,400  | 2,531.00 | 76,942,400    | 貸付有価証券<br>9,500株  |
| 9932 | 杉本商事              | 44,100  | 1,167.00 | 51,464,700    | 貸付有価証券<br>13,000株 |
| 9934 | 因幡電機産業            | 285,600 | 2,692.00 | 768,835,200   | 貸付有価証券<br>4,600株  |
| 9960 | 東テク               | 60,800  | 3,980.00 | 241,984,000   | 貸付有価証券<br>800株    |
| 9962 | ミスミグループ本社         | 771,800 | 3,767.00 | 2,907,370,600 | 貸付有価証券<br>11,900株 |
| 9987 | スズケン              | 181,300 | 4,970.00 | 901,061,000   | 貸付有価証券<br>2,400株  |
| 9991 | ジェコス              | 39,200  | 1,505.00 | 58,996,000    | 貸付有価証券<br>11,600株 |
| 262A | インターメスティック        | 23,700  | 2,007.00 | 47,565,900    |                   |
| 2659 | サンエー              | 123,600 | 3,145.00 | 388,722,000   |                   |
| 2664 | カワチ薬品             | 42,800  | 3,510.00 | 150,228,000   | 貸付有価証券<br>13,400株 |
| 2670 | エービーシー・マート        | 287,200 | 2,808.00 | 806,457,600   | 貸付有価証券<br>3,500株  |
| 2674 | ハードオフコーポレーション     | 21,600  | 2,649.00 | 57,218,400    |                   |
| 2678 | アスクル              | 104,100 | 1,214.00 | 126,377,400   | 貸付有価証券<br>30,800株 |
| 2681 | ゲオホールディングス        | 61,500  | 2,070.00 | 127,305,000   | 貸付有価証券<br>18,600株 |
| 2685 | アンドエスティHD         | 75,500  | 3,335.00 | 251,792,500   | 貸付有価証券<br>2,100株  |

|      |                   |         |          |               |                   |
|------|-------------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 2695 | くら寿司              | 128,000 | 1,522.00 | 194,816,000   | 貸付有価証券<br>37,800株 |
| 2698 | キャンドウ             | 19,400  | 3,365.00 | 65,281,000    | 貸付有価証券<br>5,700株  |
| 2726 | パルグループホールディングス    | 214,600 | 1,462.00 | 313,745,200   | 貸付有価証券<br>3,600株  |
| 2730 | エディオン             | 259,800 | 2,272.00 | 590,265,600   | 貸付有価証券<br>3,500株  |
| 2734 | サーラコーポレーション       | 114,900 | 1,048.00 | 120,415,200   |                   |
| 2742 | ハローズ              | 24,900  | 3,615.00 | 90,013,500    | 貸付有価証券<br>7,800株  |
| 2752 | フジオフードグループ本社      | 89,200  | 1,162.00 | 103,650,400   | 貸付有価証券<br>26,300株 |
| 2753 | あみやき亭             | 39,700  | 1,334.00 | 52,959,800    | 貸付有価証券<br>6,900株  |
| 2791 | 大黒天物産             | 19,600  | 4,025.00 | 78,890,000    | 貸付有価証券<br>5,800株  |
| 2792 | ハニーズホールディングス      | 48,500  | 1,356.00 | 65,766,000    | 貸付有価証券<br>700株    |
| 3028 | アルペン              | 52,600  | 2,077.00 | 109,250,200   | 貸付有価証券<br>15,900株 |
| 3034 | クオールホールディングス      | 67,700  | 1,820.00 | 123,214,000   | 貸付有価証券<br>20,000株 |
| 3046 | ジンスホールディングス       | 41,700  | 7,890.00 | 329,013,000   | 貸付有価証券<br>200株    |
| 3048 | ビックカメラ            | 327,300 | 1,629.50 | 533,335,350   |                   |
| 3050 | DCMホールディングス       | 283,200 | 1,483.00 | 419,985,600   | 貸付有価証券<br>34,100株 |
| 3053 | ペッパーフードサービス       | 190,000 | 197.00   | 37,430,000    | 貸付有価証券<br>6,700株  |
| 3064 | Monotaro          | 775,200 | 1,760.50 | 1,364,739,600 | 貸付有価証券<br>11,200株 |
| 3086 | J. フロント リテイリング    | 627,600 | 3,212.00 | 2,015,851,200 | 貸付有価証券<br>6,000株  |
| 3087 | ドトール・日レスホールディングス  | 97,000  | 2,668.00 | 258,796,000   | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 3088 | マツキヨココカラ&カンパニー    | 951,600 | 2,369.00 | 2,254,340,400 | 貸付有価証券<br>13,700株 |
| 3091 | ブロンコビリー           | 32,100  | 4,670.00 | 149,907,000   | 貸付有価証券<br>9,500株  |
| 3092 | ZOZO              | 862,100 | 1,122.00 | 967,276,200   | 貸付有価証券<br>17,300株 |
| 3093 | トレジャー・ファクトリー      | 37,600  | 2,012.00 | 75,651,200    |                   |
| 3097 | 物語コーポレーション        | 106,100 | 4,675.00 | 496,017,500   | 貸付有価証券<br>33,000株 |
| 3099 | 三越伊勢丹ホールディングス     | 852,300 | 4,132.00 | 3,521,703,600 | 貸付有価証券<br>11,600株 |
| 3134 | Hamee             | 25,200  | 258.00   | 6,501,600     | 貸付有価証券<br>7,500株  |
| 3148 | クリエイティブSDホールディングス | 77,500  | 3,220.00 | 249,550,000   | 貸付有価証券<br>1,200株  |

|      |                      |           |          |                |                    |
|------|----------------------|-----------|----------|----------------|--------------------|
| 3179 | シュッピン                | 57,800    | 1,063.00 | 61,441,400     | 貸付有価証券<br>17,100株  |
| 3182 | オイシックス・ラ・大地          | 78,500    | 1,470.00 | 115,395,000    | 貸付有価証券<br>23,200株  |
| 3186 | ネクステージ               | 125,100   | 3,905.00 | 488,515,500    | 貸付有価証券<br>1,800株   |
| 3191 | ジョイフル本田              | 160,300   | 2,193.00 | 351,537,900    | 貸付有価証券<br>2,200株   |
| 3193 | エターナルホスピタリティグループ     | 22,500    | 2,660.00 | 59,850,000     | 貸付有価証券<br>1,000株   |
| 3196 | ホットランドホールディングス       | 49,900    | 1,590.00 | 79,341,000     | 貸付有価証券<br>12,400株  |
| 3197 | すかいらくホールディングス        | 747,500   | 2,808.00 | 2,098,980,000  | 貸付有価証券<br>5,900株   |
| 3198 | S F Pホールディングス        | 30,900    | 2,264.00 | 69,957,600     | 貸付有価証券<br>9,000株   |
| 3199 | 綿半ホールディングス           | 42,400    | 1,404.00 | 59,529,600     | 貸付有価証券<br>12,500株  |
| 3221 | ヨシックスホールディングス        | 16,000    | 3,200.00 | 51,200,000     | 貸付有価証券<br>4,700株   |
| 3222 | ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 269,400   | 792.00   | 213,364,800    | 貸付有価証券<br>83,000株  |
| 3333 | あさひ                  | 45,600    | 1,265.00 | 57,684,000     | 貸付有価証券<br>14,200株  |
| 3349 | コスモス薬品               | 92,800    | 6,000.00 | 556,800,000    | 貸付有価証券<br>1,600株   |
| 3382 | セブン&アイ・ホールディングス      | 6,041,000 | 1,910.50 | 11,541,330,500 | 貸付有価証券<br>37,800株  |
| 3387 | クリエイト・レストランツ・ホールディング | 822,700   | 707.00   | 581,648,900    | 貸付有価証券<br>254,800株 |
| 3391 | ツルハホールディングス          | 855,000   | 1,996.00 | 1,706,580,000  | 貸付有価証券<br>11,700株  |
| 3395 | サンマルクホールディングス        | 48,800    | 2,464.00 | 120,243,200    | 貸付有価証券<br>15,200株  |
| 3397 | トリドールホールディングス        | 154,400   | 3,764.00 | 581,161,600    | 貸付有価証券<br>2,300株   |
| 3415 | TOKYO BASE           | 76,500    | 341.00   | 26,086,500     | 貸付有価証券<br>22,600株  |
| 3539 | JMホールディングス           | 88,600    | 1,212.00 | 107,383,200    | 貸付有価証券<br>27,400株  |
| 3547 | ユニシアホールディングス         | 16,400    | 1,468.00 | 24,075,200     | 貸付有価証券<br>4,800株   |
| 3548 | パロックジャパンリミテッド        | 63,800    | 721.00   | 45,999,800     | 貸付有価証券<br>18,800株  |
| 3549 | クスリのアオキホールディングス      | 129,400   | 3,561.00 | 460,793,400    |                    |
| 3561 | 力の源ホールディングス          | 41,000    | 1,527.00 | 62,607,000     | 貸付有価証券<br>12,700株  |
| 3563 | FOOD & LIFE COMPANIE | 314,100   | 9,883.00 | 3,104,250,300  | 貸付有価証券<br>3,100株   |
| 417A | ブルーゾーンホールディングス       | 323,900   | 1,736.50 | 562,452,350    |                    |
| 4350 | メディカルシステムネットワーク      | 53,300    | 465.00   | 24,784,500     |                    |

|      |                                            |           |          |               |                   |
|------|--------------------------------------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 5889 | J a p a n   E y e w e a r   H o l<br>d i n | 23,600    | 2,185.00 | 51,566,000    |                   |
| 7419 | ノジマ                                        | 535,300   | 1,342.00 | 718,372,600   | 貸付有価証券<br>7,800株  |
| 7421 | カッパ・クリエイト                                  | 86,000    | 1,413.00 | 121,518,000   | 貸付有価証券<br>26,700株 |
| 7453 | 良品計画                                       | 1,193,900 | 3,527.00 | 4,210,885,300 | 貸付有価証券<br>9,700株  |
| 7463 | アドヴァングループ                                  | 33,500    | 890.00   | 29,815,000    | 貸付有価証券<br>9,900株  |
| 7475 | アルビス                                       | 17,900    | 2,452.00 | 43,890,800    | 貸付有価証券<br>5,300株  |
| 7508 | G－7ホールディングス                                | 59,600    | 1,343.00 | 80,042,800    | 貸付有価証券<br>10,400株 |
| 7512 | イオン北海道                                     | 161,700   | 820.00   | 132,594,000   | 貸付有価証券<br>47,800株 |
| 7513 | コジマ                                        | 105,400   | 1,292.00 | 136,176,800   | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 7516 | コーナン商事                                     | 60,300    | 4,005.00 | 241,501,500   |                   |
| 7520 | エコス                                        | 20,300    | 2,312.00 | 46,933,600    | 貸付有価証券<br>6,000株  |
| 7522 | ワタミ                                        | 66,000    | 920.00   | 60,720,000    | 貸付有価証券<br>19,500株 |
| 7532 | パン・パシフィック・インターナシ<br>ョナルホ                   | 5,527,100 | 820.70   | 4,536,090,970 | 貸付有価証券<br>79,500株 |
| 7545 | 西松屋チェーン                                    | 121,100   | 1,882.00 | 227,910,200   | 貸付有価証券<br>37,600株 |
| 7550 | ゼンショーホールディングス                              | 279,600   | 8,064.00 | 2,254,694,400 | 貸付有価証券<br>4,500株  |
| 7554 | 幸楽苑                                        | 52,300    | 1,086.00 | 56,797,800    |                   |
| 7581 | サイゼリヤ                                      | 80,800    | 5,400.00 | 436,320,000   | 貸付有価証券<br>25,000株 |
| 7593 | V Tホールディングス                                | 213,200   | 447.00   | 95,300,400    | 貸付有価証券<br>66,200株 |
| 7596 | 魚力                                         | 19,100    | 2,211.00 | 42,230,100    | 貸付有価証券<br>5,600株  |
| 7606 | ユナイテッドアローズ                                 | 58,400    | 2,388.00 | 139,459,200   | 貸付有価証券<br>700株    |
| 7611 | ハイデイ日高                                     | 88,500    | 2,528.00 | 223,728,000   | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 7616 | コロワイド                                      | 308,600   | 1,782.50 | 550,079,500   |                   |
| 7630 | 壱番屋                                        | 216,000   | 866.00   | 187,056,000   | 貸付有価証券<br>63,800株 |
| 7649 | スギホールディングス                                 | 293,800   | 3,081.00 | 905,197,800   | 貸付有価証券<br>4,300株  |
| 7679 | 薬王堂ホールディングス                                | 30,500    | 1,611.00 | 49,135,500    |                   |
| 7683 | ダブルエー                                      | 22,100    | 1,425.00 | 31,492,500    |                   |
| 8005 | スクロール                                      | 93,700    | 1,642.00 | 153,855,400   | 貸付有価証券<br>28,900株 |
| 8008 | ヨンドシーホールディングス                              | 51,700    | 1,911.00 | 98,798,700    | 貸付有価証券<br>16,100株 |

|      |                  |           |          |               |                    |
|------|------------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 8160 | 木曽路              | 82,800    | 2,313.00 | 191,516,400   | 貸付有価証券<br>24,400株  |
| 8163 | S R Sホールディングス    | 90,200    | 1,220.00 | 110,044,000   | 貸付有価証券<br>26,600株  |
| 8165 | 千趣会              | 110,700   | 109.00   | 12,066,300    | 貸付有価証券<br>32,700株  |
| 8167 | リテールパートナーズ       | 81,100    | 1,342.00 | 108,836,200   | 貸付有価証券<br>17,700株  |
| 8173 | J o s h i n      | 59,500    | 3,920.00 | 233,240,000   | 貸付有価証券<br>800株     |
| 8174 | 日本瓦斯             | 261,700   | 2,818.50 | 737,601,450   | 貸付有価証券<br>3,800株   |
| 8179 | ロイヤルホールディングス     | 212,000   | 1,217.00 | 258,004,000   | 貸付有価証券<br>62,600株  |
| 8185 | チヨダ              | 53,100    | 960.00   | 50,976,000    | 貸付有価証券<br>16,400株  |
| 8194 | ライフコーポレーション      | 105,000   | 2,569.00 | 269,745,000   |                    |
| 8200 | リンガーハット          | 75,600    | 2,138.00 | 161,632,800   | 貸付有価証券<br>22,300株  |
| 8203 | Mr M a x H D     | 45,900    | 786.00   | 36,077,400    |                    |
| 8214 | A O K Iホールディングス  | 117,200   | 1,619.00 | 189,746,800   | 貸付有価証券<br>36,400株  |
| 8217 | オークワ             | 73,000    | 771.00   | 56,283,000    |                    |
| 8218 | コメリ              | 72,800    | 3,520.00 | 256,256,000   | 貸付有価証券<br>22,600株  |
| 8219 | 青山商事             | 350,700   | 682.00   | 239,177,400   | 貸付有価証券<br>108,200株 |
| 8227 | しまむら             | 385,300   | 3,263.00 | 1,257,233,900 | 貸付有価証券<br>5,700株   |
| 8233 | 高島屋              | 766,900   | 2,602.00 | 1,995,473,800 |                    |
| 8237 | 松屋               | 103,000   | 1,643.00 | 169,229,000   | 貸付有価証券<br>400株     |
| 8242 | エイチ・ツー・オー リテイリング | 266,200   | 2,869.00 | 763,727,800   | 貸付有価証券<br>3,900株   |
| 8244 | 近鉄百貨店            | 31,300    | 1,788.00 | 55,964,400    | 貸付有価証券<br>9,800株   |
| 8252 | 丸井グループ           | 319,500   | 2,787.00 | 890,446,500   |                    |
| 8255 | アクシアル リテイリング     | 149,200   | 1,088.00 | 162,329,600   |                    |
| 8267 | イオン              | 6,456,100 | 1,300.00 | 8,392,930,000 | 貸付有価証券<br>10,500株  |
| 8273 | イズミ              | 290,900   | 942.00   | 274,027,800   | 貸付有価証券<br>3,600株   |
| 8276 | 平和堂              | 89,700    | 2,561.00 | 229,721,700   |                    |
| 8278 | フジ               | 83,900    | 1,937.00 | 162,514,300   |                    |
| 8281 | ゼビオホールディングス      | 64,800    | 1,044.00 | 67,651,200    | 貸付有価証券<br>20,300株  |
| 8282 | ケーズホールディングス      | 357,200   | 1,918.00 | 685,109,600   | 貸付有価証券<br>4,000株   |
| 9262 | シルバーライフ          | 14,800    | 639.00   | 9,457,200     | 貸付有価証券<br>4,400株   |

|      |                     |           |           |                |                   |
|------|---------------------|-----------|-----------|----------------|-------------------|
| 9267 | Genky DrugStores    | 48,000    | 3,375.00  | 162,000,000    | 貸付有価証券<br>14,900株 |
| 9278 | ブックオフグループホールディングス   | 39,700    | 1,936.00  | 76,859,200     | 貸付有価証券<br>12,300株 |
| 9279 | ギフトホールディングス         | 31,000    | 4,065.00  | 126,015,000    |                   |
| 9627 | アインホールディングス         | 61,600    | 5,410.00  | 333,256,000    | 貸付有価証券<br>800株    |
| 9828 | Genki Global Dining | 30,900    | 3,055.00  | 94,399,500     | 貸付有価証券<br>9,100株  |
| 9831 | ヤマダホールディングス         | 1,681,900 | 661.50    | 1,112,576,850  |                   |
| 9842 | アークランズ              | 162,700   | 1,896.00  | 308,479,200    | 貸付有価証券<br>5,500株  |
| 9843 | ニトリホールディングス         | 884,800   | 2,397.00  | 2,120,865,600  | 貸付有価証券<br>14,500株 |
| 9850 | グルメ杵屋               | 44,300    | 940.00    | 41,642,000     | 貸付有価証券<br>13,800株 |
| 9856 | ケーユーホールディングス        | 38,400    | 1,142.00  | 43,852,800     | 貸付有価証券<br>11,400株 |
| 9861 | 吉野家ホールディングス         | 201,400   | 3,055.00  | 615,277,000    | 貸付有価証券<br>3,100株  |
| 9887 | 松屋フーズホールディングス       | 27,700    | 4,605.00  | 127,558,500    | 貸付有価証券<br>8,200株  |
| 9900 | サガミホールディングス         | 87,900    | 1,609.00  | 141,431,100    | 貸付有価証券<br>27,300株 |
| 9936 | 王将フードサービス           | 112,800   | 2,783.00  | 313,922,400    | 貸付有価証券<br>34,800株 |
| 9946 | ミニストップ              | 39,700    | 1,778.00  | 70,586,600     |                   |
| 9948 | アークス                | 91,900    | 3,340.00  | 306,946,000    | 貸付有価証券<br>28,600株 |
| 9956 | バローホールディングス         | 104,300   | 3,775.00  | 393,732,500    | 貸付有価証券<br>1,500株  |
| 9974 | ベルク                 | 24,200    | 6,290.00  | 152,218,000    | 貸付有価証券<br>400株    |
| 9979 | 大庄                  | 32,800    | 1,077.00  | 35,325,600     | 貸付有価証券<br>9,700株  |
| 9983 | ファーストリテイリング         | 369,000   | 84,300.00 | 31,106,700,000 |                   |
| 9989 | サンドラッグ              | 161,500   | 3,792.00  | 612,408,000    | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| 9990 | サックスパー ホールディングス     | 46,200    | 735.00    | 33,957,000     | 貸付有価証券<br>14,500株 |
| 9997 | ベルーナ                | 131,600   | 943.00    | 124,098,800    | 貸付有価証券<br>1,900株  |
| 5830 | いよぎんホールディングス        | 666,300   | 3,100.00  | 2,065,530,000  | 貸付有価証券<br>9,600株  |
| 5831 | しずおかフィナンシャルグループ     | 1,121,300 | 2,991.00  | 3,353,808,300  | 貸付有価証券<br>16,100株 |
| 5832 | ちゅうぎんフィナンシャルグループ    | 428,600   | 3,068.00  | 1,314,944,800  | 貸付有価証券<br>6,200株  |
| 5838 | 楽天銀行                | 269,800   | 5,000.00  | 1,349,000,000  | 貸付有価証券<br>3,400株  |

|      |                    |            |           |                 |                    |
|------|--------------------|------------|-----------|-----------------|--------------------|
| 5844 | 京都フィナンシャルグループ      | 699,000    | 4,532.00  | 3,167,868,000   | 貸付有価証券<br>9,200株   |
| 7167 | めぶきフィナンシャルグループ     | 2,379,700  | 1,380.50  | 3,285,175,850   | 貸付有価証券<br>35,600株  |
| 7173 | 東京きらぼしフィナンシャルグループ  | 65,200     | 13,910.00 | 906,932,000     | 貸付有価証券<br>1,000株   |
| 7180 | 九州フィナンシャルグループ      | 985,200    | 1,426.00  | 1,404,895,200   | 貸付有価証券<br>5,800株   |
| 7182 | ゆうちょ銀行             | 5,529,300  | 3,050.00  | 16,864,365,000  | 貸付有価証券<br>59,500株  |
| 7184 | 富山第一銀行             | 161,600    | 2,427.00  | 392,203,200     | 貸付有価証券<br>50,200株  |
| 7186 | 横浜フィナンシャルグループ      | 2,654,800  | 1,709.50  | 4,538,380,600   | 貸付有価証券<br>22,200株  |
| 7189 | 西日本フィナンシャルホールディングス | 311,200    | 4,164.00  | 1,295,836,800   | 貸付有価証券<br>4,500株   |
| 7322 | 三十三フィナンシャルグループ     | 197,300    | 1,668.00  | 329,096,400     | 貸付有価証券<br>61,200株  |
| 7327 | 第四北越フィナンシャルグループ    | 479,500    | 2,107.00  | 1,010,306,500   | 貸付有価証券<br>11,300株  |
| 7337 | ひろぎんホールディングス       | 708,200    | 2,074.00  | 1,468,806,800   | 貸付有価証券<br>10,200株  |
| 7350 | おきなわフィナンシャルグループ    | 43,400     | 6,250.00  | 271,250,000     | 貸付有価証券<br>600株     |
| 7380 | 十六フィナンシャルグループ      | 357,300    | 2,241.00  | 800,709,300     | 貸付有価証券<br>111,300株 |
| 7381 | C C I グループ         | 531,300    | 978.00    | 519,611,400     | 貸付有価証券<br>157,200株 |
| 7384 | プロクレアホールディングス      | 62,300     | 3,485.00  | 217,115,500     | 貸付有価証券<br>900株     |
| 7389 | あいちフィナンシャルグループ     | 522,200    | 1,354.00  | 707,058,800     | 貸付有価証券<br>161,500株 |
| 8303 | S B I 新生銀行         | 865,400    | 1,395.00  | 1,207,233,000   | 貸付有価証券<br>500株     |
| 8304 | あおぞら銀行             | 324,200    | 2,727.50  | 884,255,500     | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 8306 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ  | 32,113,700 | 3,233.00  | 103,823,592,100 |                    |
| 8308 | りそなホールディングス        | 6,243,100  | 2,107.00  | 13,154,211,700  |                    |
| 8309 | 三井住友トラストグループ       | 1,755,900  | 5,979.00  | 10,498,526,100  | 貸付有価証券<br>25,700株  |
| 8316 | 三井住友フィナンシャルグループ    | 11,096,900 | 6,340.00  | 70,354,346,000  | 貸付有価証券<br>150,600株 |
| 8331 | 千葉銀行               | 1,499,000  | 2,437.00  | 3,653,063,000   | 貸付有価証券<br>12,800株  |
| 8334 | 群馬銀行               | 918,200    | 2,318.50  | 2,128,846,700   | 貸付有価証券<br>12,400株  |
| 8336 | 武蔵野銀行              | 213,100    | 2,464.00  | 525,078,400     | 貸付有価証券<br>61,200株  |
| 8337 | 千葉興業銀行             | 96,200     | 2,350.00  | 226,070,000     |                    |
| 8338 | 筑波銀行               | 223,400    | 624.00    | 139,401,600     |                    |

|      |                 |           |          |                |                   |
|------|-----------------|-----------|----------|----------------|-------------------|
| 8341 | 七十七銀行           | 488,900   | 3,337.00 | 1,631,459,300  | 貸付有価証券<br>7,200株  |
| 8343 | 秋田銀行            | 34,100    | 6,570.00 | 224,037,000    | 貸付有価証券<br>500株    |
| 8344 | 山形銀行            | 65,400    | 3,285.00 | 214,839,000    | 貸付有価証券<br>900株    |
| 8345 | 岩手銀行            | 128,700   | 1,974.00 | 254,053,800    | 貸付有価証券<br>35,100株 |
| 8346 | 東邦銀行            | 585,700   | 765.00   | 448,060,500    |                   |
| 8354 | ふくおかフィナンシャルグループ | 406,400   | 6,783.00 | 2,756,611,200  | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 8358 | スルガ銀行           | 342,900   | 2,362.00 | 809,929,800    | 貸付有価証券<br>30,800株 |
| 8359 | 八十二長野銀行         | 1,049,800 | 2,355.50 | 2,472,803,900  | 貸付有価証券<br>16,500株 |
| 8360 | 山梨中央銀行          | 61,800    | 6,070.00 | 375,126,000    | 貸付有価証券<br>12,000株 |
| 8361 | 大垣共立銀行          | 103,700   | 7,110.00 | 737,307,000    | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 8362 | 福井銀行            | 49,000    | 5,200.00 | 254,800,000    | 貸付有価証券<br>700株    |
| 8364 | 清水銀行            | 20,300    | 2,345.00 | 47,603,500     |                   |
| 8366 | 滋賀銀行            | 348,600   | 2,333.00 | 813,283,800    | 貸付有価証券<br>6,000株  |
| 8367 | 南都銀行            | 383,000   | 1,732.00 | 663,356,000    | 貸付有価証券<br>71,300株 |
| 8368 | 百五銀行            | 478,900   | 1,914.00 | 916,614,600    | 貸付有価証券<br>6,900株  |
| 8370 | 紀陽銀行            | 169,100   | 4,430.00 | 749,113,000    | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| 8377 | ほくほくフィナンシャルグループ | 304,300   | 6,568.00 | 1,998,642,400  | 貸付有価証券<br>4,200株  |
| 8381 | 山陰合同銀行          | 318,600   | 2,216.00 | 706,017,600    | 貸付有価証券<br>4,600株  |
| 8386 | 百十四銀行           | 199,200   | 2,516.00 | 501,187,200    | 貸付有価証券<br>33,700株 |
| 8387 | 四国銀行            | 79,900    | 2,876.00 | 229,792,400    | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 8388 | 阿波銀行            | 75,400    | 6,900.00 | 520,260,000    | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 8392 | 大分銀行            | 159,200   | 2,273.00 | 361,861,600    | 貸付有価証券<br>49,600株 |
| 8393 | 宮崎銀行            | 149,000   | 2,076.00 | 309,324,000    | 貸付有価証券<br>15,900株 |
| 8395 | 佐賀銀行            | 31,900    | 5,200.00 | 165,880,000    | 貸付有価証券<br>500株    |
| 8399 | 琉球銀行            | 108,300   | 2,551.00 | 276,273,300    | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 8410 | セブン銀行           | 1,595,600 | 278.00   | 443,576,800    | 貸付有価証券<br>26,200株 |
| 8411 | みずほフィナンシャルグループ  | 7,082,400 | 7,725.00 | 54,711,540,000 |                   |

|      |                      |           |          |                |                    |
|------|----------------------|-----------|----------|----------------|--------------------|
| 8418 | 山口フィナンシャルグループ        | 499,100   | 2,878.00 | 1,436,409,800  | 貸付有価証券<br>7,200株   |
| 8522 | 名古屋銀行                | 95,400    | 5,890.00 | 561,906,000    | 貸付有価証券<br>1,500株   |
| 8524 | 北洋銀行                 | 657,700   | 1,095.00 | 720,181,500    | 貸付有価証券<br>9,500株   |
| 8541 | 愛媛銀行                 | 74,300    | 2,011.00 | 149,417,300    | 貸付有価証券<br>1,100株   |
| 8544 | 京葉銀行                 | 219,900   | 2,463.00 | 541,613,700    | 貸付有価証券<br>3,300株   |
| 8550 | 栃木銀行                 | 275,400   | 918.00   | 252,817,200    | 貸付有価証券<br>84,900株  |
| 8551 | 北日本銀行                | 15,900    | 5,210.00 | 82,839,000     | 貸付有価証券<br>3,700株   |
| 8558 | 東和銀行                 | 96,800    | 1,439.00 | 139,295,200    | 貸付有価証券<br>30,000株  |
| 8600 | トモニホールディングス          | 486,300   | 864.00   | 420,163,200    | 貸付有価証券<br>7,000株   |
| 8713 | フィデアホールディングス         | 52,600    | 1,916.00 | 100,781,600    | 貸付有価証券<br>16,400株  |
| 8714 | 池田泉州ホールディングス         | 706,100   | 965.00   | 681,386,500    | 貸付有価証券<br>10,200株  |
| 7148 | F P G                | 178,200   | 1,496.00 | 266,587,200    | 貸付有価証券<br>55,100株  |
| 7172 | ジャパンインベストメントアドバイザー   | 82,600    | 2,061.00 | 170,238,600    | 貸付有価証券<br>24,400株  |
| 8473 | S B I ホールディングス       | 1,789,000 | 2,737.50 | 4,897,387,500  |                    |
| 8595 | ジャフコ グループ            | 136,300   | 2,317.00 | 315,807,100    | 貸付有価証券<br>2,200株   |
| 8601 | 大和証券グループ本社           | 3,640,000 | 1,589.50 | 5,785,780,000  |                    |
| 8604 | 野村ホールディングス           | 8,357,600 | 1,413.50 | 11,813,467,600 | 貸付有価証券<br>12,200株  |
| 8609 | 岡三証券グループ             | 402,200   | 955.00   | 384,101,000    | 貸付有価証券<br>124,800株 |
| 8613 | 丸三証券                 | 169,400   | 1,059.00 | 179,394,600    | 貸付有価証券<br>52,500株  |
| 8614 | 東洋証券                 | 157,100   | 611.00   | 95,988,100     | 貸付有価証券<br>48,300株  |
| 8616 | 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 602,500   | 754.00   | 454,285,000    |                    |
| 8622 | 水戸証券                 | 139,700   | 659.00   | 92,062,300     | 貸付有価証券<br>43,400株  |
| 8624 | いちよし証券               | 95,300    | 1,370.00 | 130,561,000    | 貸付有価証券<br>29,700株  |
| 8628 | 松井証券                 | 350,800   | 962.00   | 337,469,600    | 貸付有価証券<br>5,100株   |
| 8698 | マネックスグループ            | 535,000   | 611.00   | 326,885,000    | 貸付有価証券<br>7,100株   |
| 8706 | 極東証券                 | 69,700    | 1,542.00 | 107,477,400    | 貸付有価証券<br>21,600株  |
| 8707 | 岩井コスモホールディングス        | 53,200    | 3,995.00 | 212,534,000    | 貸付有価証券<br>900株     |

|      |                              |            |          |                |                    |
|------|------------------------------|------------|----------|----------------|--------------------|
| 8708 | アイザワ証券グループ                   | 53,500     | 1,469.00 | 78,591,500     | 貸付有価証券<br>16,700株  |
| 8739 | スパークス・グループ                   | 56,200     | 2,156.00 | 121,167,200    |                    |
| 7157 | ライフネット生命保険                   | 108,700    | 1,480.00 | 160,876,000    | 貸付有価証券<br>5,600株   |
| 7181 | かんぽ生命保険                      | 1,724,800  | 1,473.50 | 2,541,492,800  | 貸付有価証券<br>24,900株  |
| 7388 | F P パートナー                    | 22,500     | 2,044.00 | 45,990,000     | 貸付有価証券<br>7,200株   |
| 8630 | SOMPOホールディングス                | 2,528,000  | 6,105.00 | 15,433,440,000 | 貸付有価証券<br>16,900株  |
| 8715 | アニコム ホールディングス                | 159,300    | 1,176.00 | 187,336,800    | 貸付有価証券<br>2,300株   |
| 8725 | MS & A D インシュアランスグループ<br>ホール | 3,173,300  | 4,252.00 | 13,492,871,600 | 貸付有価証券<br>4,900株   |
| 8729 | ソニーフィナンシャルグループ               | 16,883,600 | 137.50   | 2,321,495,000  |                    |
| 8750 | 第一ライフグループ                    | 9,799,400  | 1,705.50 | 16,712,876,700 | 貸付有価証券<br>22,700株  |
| 8766 | 東京海上ホールディングス                 | 5,233,400  | 6,850.00 | 35,848,790,000 | 貸付有価証券<br>13,400株  |
| 8795 | T & Dホールディングス                | 1,131,900  | 4,690.00 | 5,308,611,000  | 貸付有価証券<br>7,300株   |
| 8798 | アドバンスクリエイト                   | 43,500     | 119.00   | 5,176,500      | 貸付有価証券<br>12,800株  |
| 471A | N S グループ                     | 90,700     | 1,437.00 | 130,335,900    |                    |
| 547A | ムニノバホールディングス                 | 843,000    | 436.00   | 367,548,000    |                    |
| 7164 | 全国保証                         | 292,900    | 2,951.00 | 864,347,900    | 貸付有価証券<br>3,900株   |
| 7187 | ジェイリース                       | 38,300     | 1,303.00 | 49,904,900     | 貸付有価証券<br>11,300株  |
| 7198 | S B I アルヒ                    | 51,900     | 772.00   | 40,066,800     | 貸付有価証券<br>15,300株  |
| 7199 | プレミアグループ                     | 86,600     | 1,975.00 | 171,035,000    | 貸付有価証券<br>1,300株   |
| 7383 | ネットプロテクションズホールディン<br>グス      | 153,800    | 338.00   | 51,984,400     | 貸付有価証券<br>47,900株  |
| 8253 | クレディセゾン                      | 286,700    | 4,260.00 | 1,221,342,000  | 貸付有価証券<br>4,200株   |
| 8424 | 芙蓉総合リース                      | 140,500    | 4,194.00 | 589,257,000    | 貸付有価証券<br>2,100株   |
| 8425 | みずほリース                       | 382,400    | 1,244.00 | 475,705,600    | 貸付有価証券<br>113,200株 |
| 8439 | 東京センチュリー                     | 380,500    | 2,494.00 | 948,967,000    | 貸付有価証券<br>5,500株   |
| 8511 | 日本証券金融                       | 176,500    | 2,293.00 | 404,714,500    | 貸付有価証券<br>54,900株  |
| 8566 | リコーリース                       | 48,300     | 6,090.00 | 294,147,000    | 貸付有価証券<br>1,000株   |
| 8570 | イオンフィナンシャルサービス               | 300,800    | 1,465.50 | 440,822,400    | 貸付有価証券<br>4,200株   |

|      |                  |           |          |                |                    |
|------|------------------|-----------|----------|----------------|--------------------|
| 8572 | アコム              | 908,400   | 445.50   | 404,692,200    | 貸付有価証券<br>11,300株  |
| 8584 | ジャックス            | 61,000    | 3,425.00 | 208,925,000    | 貸付有価証券<br>900株     |
| 8585 | オリエントコーポレーション    | 199,300   | 825.00   | 164,422,500    | 貸付有価証券<br>2,700株   |
| 8591 | オリックス            | 3,041,800 | 6,169.00 | 18,764,864,200 |                    |
| 8593 | 三菱ＨＣキャピタル        | 2,551,800 | 1,302.50 | 3,323,719,500  | 貸付有価証券<br>11,200株  |
| 8697 | 日本取引所グループ        | 2,792,000 | 2,028.00 | 5,662,176,000  | 貸付有価証券<br>43,400株  |
| 8771 | イー・ギャランティ        | 78,900    | 1,689.00 | 133,262,100    | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 8793 | NECキャピタルソリューション  | 25,000    | 4,030.00 | 100,750,000    | 貸付有価証券<br>7,800株   |
| 1435 | robot home       | 140,900   | 163.00   | 22,966,700     | 貸付有価証券<br>41,600株  |
| 1878 | 大東建託             | 865,900   | 3,005.00 | 2,602,029,500  |                    |
| 2337 | いちご              | 402,500   | 425.00   | 171,062,500    | 貸付有価証券<br>125,300株 |
| 2353 | 日本駐車場開発          | 606,100   | 245.00   | 148,494,500    | 貸付有価証券<br>188,100株 |
| 2975 | スター・マイカ・ホールディングス | 53,700    | 1,554.00 | 83,449,800     |                    |
| 2980 | SREホールディングス      | 25,100    | 2,360.00 | 59,236,000     | 貸付有価証券<br>7,700株   |
| 3003 | ヒューリック           | 1,484,200 | 1,700.00 | 2,523,140,000  | 貸付有価証券<br>10,700株  |
| 3231 | 野村不動産ホールディングス    | 1,419,400 | 913.30   | 1,296,338,020  | 貸付有価証券<br>22,900株  |
| 3232 | 三重交通グループホールディングス | 124,400   | 522.00   | 64,936,800     | 貸付有価証券<br>38,400株  |
| 3245 | ディア・ライフ          | 99,800    | 990.00   | 98,802,000     | 貸付有価証券<br>30,700株  |
| 3252 | 地主               | 41,700    | 2,871.00 | 119,720,700    | 貸付有価証券<br>600株     |
| 3276 | JPMC             | 27,400    | 1,308.00 | 35,839,200     |                    |
| 3284 | フージャースホールディングス   | 88,800    | 1,170.00 | 103,896,000    | 貸付有価証券<br>27,500株  |
| 3288 | オープンハウスグループ      | 157,900   | 8,399.00 | 1,326,202,100  | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 3289 | 東急不動産ホールディングス    | 1,391,300 | 1,269.50 | 1,766,255,350  | 貸付有価証券<br>5,300株   |
| 3291 | 飯田グループホールディングス   | 433,500   | 2,166.50 | 939,177,750    | 貸付有価証券<br>5,700株   |
| 3457 | And Doホールディングス   | 27,000    | 1,039.00 | 28,053,000     | 貸付有価証券<br>500株     |
| 3465 | ケイアイスター不動産       | 42,900    | 3,765.00 | 161,518,500    | 貸付有価証券<br>13,500株  |
| 3475 | グッドコムアセット        | 53,100    | 1,401.00 | 74,393,100     | 貸付有価証券<br>15,700株  |

|      |                       |           |          |                |                    |
|------|-----------------------|-----------|----------|----------------|--------------------|
| 3480 | ジェイ・エス・ビー             | 21,200    | 8,980.00 | 190,376,000    | 貸付有価証券<br>100株     |
| 3482 | ロードスターキャピタル           | 29,000    | 2,807.00 | 81,403,000     |                    |
| 3496 | アズーム                  | 11,900    | 4,060.00 | 48,314,000     |                    |
| 3498 | 霞ヶ関キャピタル              | 52,300    | 6,750.00 | 353,025,000    |                    |
| 4666 | パーク 2 4               | 363,700   | 2,057.50 | 748,312,750    | 貸付有価証券<br>5,300株   |
| 4809 | パラカ                   | 18,200    | 2,007.00 | 36,527,400     |                    |
| 6620 | 宮越ホールディングス            | 23,200    | 757.00   | 17,562,400     | 貸付有価証券<br>7,500株   |
| 8801 | 三井不動産                 | 7,457,400 | 1,475.00 | 10,999,665,000 |                    |
| 8802 | 三菱地所                  | 3,058,500 | 3,984.00 | 12,185,064,000 | 貸付有価証券<br>3,300株   |
| 8803 | 平和不動産                 | 96,100    | 2,366.00 | 227,372,600    | 貸付有価証券<br>2,400株   |
| 8804 | 東京建物                  | 482,400   | 3,291.00 | 1,587,578,400  |                    |
| 8818 | 京阪神ビルディング             | 75,500    | 2,145.00 | 161,947,500    | 貸付有価証券<br>22,300株  |
| 8830 | 住友不動産                 | 1,447,300 | 3,493.00 | 5,055,418,900  | 貸付有価証券<br>3,800株   |
| 8841 | テーオーシー                | 90,700    | 972.00   | 88,160,400     | 貸付有価証券<br>26,800株  |
| 8848 | レオパレス 2 1             | 452,500   | 634.00   | 286,885,000    |                    |
| 8850 | スターツコーポレーション          | 93,900    | 4,515.00 | 423,958,500    | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 8860 | フジ住宅                  | 64,100    | 731.00   | 46,857,100     | 貸付有価証券<br>18,900株  |
| 8864 | 空港施設                  | 70,400    | 918.00   | 64,627,200     | 貸付有価証券<br>20,800株  |
| 8869 | 明和地所                  | 40,800    | 777.00   | 31,701,600     | 貸付有価証券<br>12,100株  |
| 8871 | ゴールドクレスト              | 27,700    | 3,215.00 | 89,055,500     | 貸付有価証券<br>500株     |
| 8877 | エスリード                 | 23,900    | 4,800.00 | 114,720,000    | 貸付有価証券<br>7,500株   |
| 8881 | 日神グループホールディングス        | 81,700    | 630.00   | 51,471,000     | 貸付有価証券<br>24,200株  |
| 8892 | エスコン                  | 114,300   | 1,055.00 | 120,586,500    | 貸付有価証券<br>2,000株   |
| 8897 | M I R A R T Hホールディングス | 325,400   | 404.00   | 131,461,600    | 貸付有価証券<br>4,300株   |
| 8918 | ランド                   | 3,285,200 | 10.00    | 32,852,000     | 貸付有価証券<br>970,500株 |
| 8919 | カチタス                  | 136,800   | 3,330.00 | 455,544,000    | 貸付有価証券<br>42,500株  |
| 8923 | トーセイ                  | 150,600   | 1,666.00 | 250,899,600    | 貸付有価証券<br>44,600株  |
| 8934 | サンフロンティア不動産           | 79,800    | 2,365.00 | 188,727,000    |                    |
| 8935 | F J ネクストホールディングス      | 46,900    | 1,721.00 | 80,714,900     | 貸付有価証券<br>11,300株  |

|      |                   |           |          |               |                    |
|------|-------------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 8999 | グランディハウス          | 47,700    | 502.00   | 23,945,400    | 貸付有価証券<br>14,100株  |
| 9706 | 日本空港ビルデング         | 180,000   | 4,875.00 | 877,500,000   | 貸付有価証券<br>2,600株   |
| 2120 | L I F U L L       | 182,100   | 190.00   | 34,599,000    |                    |
| 2124 | ジェイエイシーリクルートメント   | 192,000   | 840.00   | 161,280,000   | 貸付有価証券<br>59,600株  |
| 2127 | 日本M&Aセンターホールディングス | 846,600   | 623.80   | 528,109,080   | 貸付有価証券<br>11,200株  |
| 212A | フィットイージー          | 16,100    | 2,659.00 | 42,809,900    |                    |
| 2130 | メンバーズ             | 18,200    | 1,058.00 | 19,255,600    | 貸付有価証券<br>5,400株   |
| 2146 | UTグループ            | 1,045,800 | 172.00   | 179,877,600   | 貸付有価証券<br>324,500株 |
| 2148 | アイティメディア          | 28,600    | 1,146.00 | 32,775,600    | 貸付有価証券<br>8,900株   |
| 2153 | E・Jホールディングス       | 39,100    | 1,580.00 | 61,778,000    | 貸付有価証券<br>10,900株  |
| 2154 | オープンアップグループ       | 158,000   | 1,884.00 | 297,672,000   | 貸付有価証券<br>2,600株   |
| 2157 | コシダカホールディングス      | 146,500   | 921.00   | 134,926,500   | 貸付有価証券<br>2,100株   |
| 2168 | パソナグループ           | 54,400    | 1,460.00 | 79,424,000    | 貸付有価証券<br>900株     |
| 2170 | リンクアンドモチベーション     | 126,400   | 522.00   | 65,980,800    |                    |
| 2175 | エス・エム・エス          | 203,100   | 2,068.00 | 420,010,800   | 貸付有価証券<br>3,000株   |
| 2181 | パーソルホールディングス      | 4,844,200 | 240.60   | 1,165,514,520 | 貸付有価証券<br>35,300株  |
| 2193 | クックパッド            | 76,200    | 113.00   | 8,610,600     | 貸付有価証券<br>22,500株  |
| 2301 | 学情                | 24,100    | 1,557.00 | 37,523,700    | 貸付有価証券<br>7,100株   |
| 2305 | スタジオアリス           | 26,600    | 1,796.00 | 47,773,600    | 貸付有価証券<br>8,300株   |
| 2325 | N J S             | 15,500    | 4,735.00 | 73,392,500    | 貸付有価証券<br>3,500株   |
| 2331 | A L S O K         | 887,500   | 1,062.50 | 942,968,750   | 貸付有価証券<br>12,800株  |
| 2371 | カカクコム             | 344,800   | 3,305.00 | 1,139,564,000 |                    |
| 2378 | ルネサンス             | 41,300    | 999.00   | 41,258,700    | 貸付有価証券<br>12,200株  |
| 2379 | ディップ              | 93,000    | 1,729.00 | 160,797,000   | 貸付有価証券<br>27,500株  |
| 2395 | 新日本科学             | 56,300    | 1,098.00 | 61,817,400    |                    |
| 2413 | エムスリー             | 1,050,100 | 1,744.00 | 1,831,374,400 | 貸付有価証券<br>15,000株  |
| 2429 | ワールドホールディングス      | 24,400    | 2,441.00 | 59,560,400    | 貸付有価証券<br>7,200株   |
| 2433 | 博報堂DYホールディングス     | 633,000   | 1,108.00 | 701,364,000   | 貸付有価証券<br>2,700株   |

|      |                          |           |          |               |                   |
|------|--------------------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 2440 | ぐるなび                     | 99,000    | 116.00   | 11,484,000    | 貸付有価証券<br>29,200株 |
| 2445 | タカミヤ                     | 72,000    | 389.00   | 28,008,000    | 貸付有価証券<br>21,300株 |
| 2461 | ファンコミュニケーションズ            | 76,900    | 411.00   | 31,605,900    | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 2462 | ライク                      | 27,700    | 1,437.00 | 39,804,900    | 貸付有価証券<br>8,600株  |
| 2471 | エスプール                    | 137,400   | 253.00   | 34,762,200    | 貸付有価証券<br>40,600株 |
| 2475 | WDBホールディングス              | 23,300    | 1,730.00 | 40,309,000    | 貸付有価証券<br>6,900株  |
| 2489 | アドウェイズ                   | 56,800    | 281.00   | 15,960,800    | 貸付有価証券<br>16,800株 |
| 2491 | バリューコマース                 | 46,600    | 464.00   | 21,622,400    | 貸付有価証券<br>13,800株 |
| 2492 | インフォマート                  | 501,400   | 366.00   | 183,512,400   | 貸付有価証券<br>7,200株  |
| 2749 | J Pホールディングス              | 135,800   | 565.00   | 76,727,000    | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 277A | グロービング                   | 16,700    | 2,000.00 | 33,400,000    |                   |
| 4286 | CLホールディングス               | 15,600    | 1,058.00 | 16,504,800    | 貸付有価証券<br>4,600株  |
| 4290 | プレステージ・インターナショナル         | 196,600   | 634.00   | 124,644,400   |                   |
| 4301 | アミューズ                    | 28,800    | 1,793.00 | 51,638,400    | 貸付有価証券<br>9,000株  |
| 4310 | ドリームインキュベータ              | 16,600    | 2,574.00 | 42,728,400    | 貸付有価証券<br>5,100株  |
| 4318 | クイック                     | 131,200   | 703.00   | 92,233,600    | 貸付有価証券<br>40,600株 |
| 4324 | 電通グループ                   | 513,700   | 3,035.00 | 1,559,079,500 | 貸付有価証券<br>7,400株  |
| 4331 | テイクアンドギヴ・ニーズ             | 25,400    | 660.00   | 16,764,000    | 貸付有価証券<br>7,500株  |
| 4337 | ぴあ                       | 24,200    | 2,376.00 | 57,499,200    | 貸付有価証券<br>7,200株  |
| 4343 | イオンファンタジー                | 22,900    | 2,467.00 | 56,494,300    | 貸付有価証券<br>6,800株  |
| 4345 | シーティーエス                  | 64,900    | 821.00   | 53,282,900    | 貸付有価証券<br>19,200株 |
| 4433 | ヒト・コミュニケーションズ・ホール<br>ディン | 17,300    | 825.00   | 14,272,500    | 貸付有価証券<br>5,300株  |
| 4544 | H. U. グループホールディングス       | 166,700   | 3,198.00 | 533,106,600   |                   |
| 4641 | アルプス技研                   | 44,100    | 2,300.00 | 101,430,000   | 貸付有価証券<br>13,100株 |
| 4651 | サニックスホールディングス            | 66,200    | 226.00   | 14,961,200    | 貸付有価証券<br>19,600株 |
| 4658 | 日本空調サービス                 | 57,100    | 1,583.00 | 90,389,300    | 貸付有価証券<br>900株    |
| 4661 | オリエンタルランド                | 3,132,000 | 2,393.00 | 7,494,876,000 | 貸付有価証券<br>44,900株 |

|      |                    |           |          |               |                   |
|------|--------------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 4665 | ダスキン               | 120,600   | 4,277.00 | 515,806,200   | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 4668 | 明光ネットワークジャパン       | 64,800    | 682.00   | 44,193,600    | 貸付有価証券<br>19,200株 |
| 4671 | ファルコホールディングス       | 20,600    | 2,547.00 | 52,468,200    | 貸付有価証券<br>6,100株  |
| 4680 | ラウンドワン             | 503,000   | 1,173.00 | 590,019,000   | 貸付有価証券<br>7,200株  |
| 4681 | リゾートトラスト           | 503,400   | 1,753.50 | 882,711,900   | 貸付有価証券<br>6,100株  |
| 4694 | ビー・エム・エル           | 70,900    | 3,635.00 | 257,721,500   | 貸付有価証券<br>9,100株  |
| 4714 | リソー教育グループ          | 166,000   | 193.00   | 32,038,000    | 貸付有価証券<br>49,100株 |
| 4718 | 早稲田アカデミー           | 25,700    | 2,288.00 | 58,801,600    | 貸付有価証券<br>7,800株  |
| 4732 | ユー・エス・エス           | 1,007,800 | 1,906.50 | 1,921,370,700 | 貸付有価証券<br>14,500株 |
| 4751 | サイバーエージェント         | 1,176,200 | 1,293.50 | 1,521,414,700 | 貸付有価証券<br>15,500株 |
| 4755 | 楽天グループ             | 4,203,000 | 699.10   | 2,938,317,300 | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 4763 | クリーク・アンド・リバー社      | 31,100    | 1,278.00 | 39,745,800    | 貸付有価証券<br>9,600株  |
| 4765 | SBIグローバルアセットマネジメント | 99,400    | 561.00   | 55,763,400    | 貸付有価証券<br>30,900株 |
| 4767 | テー・オー・ダブリュー        | 104,100   | 327.00   | 34,040,700    | 貸付有価証券<br>30,800株 |
| 4784 | GMOインターネット         | 14,400    | 447.00   | 6,436,800     | 貸付有価証券<br>3,800株  |
| 4792 | 山田コンサルティンググループ     | 23,100    | 1,627.00 | 37,583,700    | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 4801 | セントラルスポーツ          | 22,200    | 2,360.00 | 52,392,000    | 貸付有価証券<br>6,700株  |
| 4848 | フルキャストホールディングス     | 40,800    | 1,513.00 | 61,730,400    | 貸付有価証券<br>12,300株 |
| 4849 | エン                 | 86,500    | 1,106.00 | 95,669,000    |                   |
| 6027 | 弁護士ドットコム           | 26,500    | 2,009.00 | 53,238,500    |                   |
| 6035 | アイ・アールジャパンホールディングス | 27,600    | 706.00   | 19,485,600    | 貸付有価証券<br>8,300株  |
| 6036 | KeePer技研           | 32,800    | 2,780.00 | 91,184,000    | 貸付有価証券<br>10,200株 |
| 6047 | Gunosy             | 42,200    | 438.00   | 18,483,600    | 貸付有価証券<br>13,200株 |
| 6050 | イー・ガーディアン          | 16,100    | 1,660.00 | 26,726,000    | 貸付有価証券<br>4,800株  |
| 6055 | ジャパンマテリアル          | 162,600   | 2,718.00 | 441,946,800   | 貸付有価証券<br>2,400株  |
| 6058 | ベクトル               | 72,500    | 1,679.00 | 121,727,500   | 貸付有価証券<br>22,600株 |
| 6062 | チャーム・ケア・コーポレーション   | 44,300    | 1,323.00 | 58,608,900    |                   |

|      |                       |           |           |                |                   |
|------|-----------------------|-----------|-----------|----------------|-------------------|
| 6070 | キャリアリンク               | 19,500    | 2,175.00  | 42,412,500     | 貸付有価証券<br>5,800株  |
| 6071 | I B J                 | 40,600    | 760.00    | 30,856,000     | 貸付有価証券<br>500株    |
| 6073 | アサンテ                  | 26,300    | 1,395.00  | 36,688,500     | 貸付有価証券<br>8,200株  |
| 6078 | バリューHR                | 47,700    | 1,411.00  | 67,304,700     | 貸付有価証券<br>14,600株 |
| 6080 | M&Aキャピタルパートナーズ        | 43,000    | 3,390.00  | 145,770,000    | 貸付有価証券<br>700株    |
| 6082 | ライドオンエクスプレスホールディングス   | 21,100    | 982.00    | 20,720,200     | 貸付有価証券<br>6,200株  |
| 6088 | シグマクシス・ホールディングス       | 149,600   | 518.00    | 77,492,800     |                   |
| 6089 | ウィルグループ               | 49,200    | 1,013.00  | 49,839,600     | 貸付有価証券<br>14,500株 |
| 6098 | リクルートホールディングス         | 3,699,900 | 11,240.00 | 41,586,876,000 |                   |
| 6099 | エラン                   | 46,900    | 740.00    | 34,706,000     |                   |
| 6178 | 日本郵政                  | 4,370,700 | 2,183.50  | 9,543,423,450  | 貸付有価証券<br>29,900株 |
| 6183 | ベルシステム24ホールディングス      | 72,000    | 1,320.00  | 95,040,000     | 貸付有価証券<br>900株    |
| 6184 | 鎌倉新書                  | 52,900    | 461.00    | 24,386,900     | 貸付有価証券<br>15,600株 |
| 6191 | エアトリ                  | 48,400    | 754.00    | 36,493,600     | 貸付有価証券<br>14,300株 |
| 6194 | アトラエ                  | 43,100    | 692.00    | 29,825,200     | 貸付有価証券<br>12,800株 |
| 6196 | ストライクグループ             | 89,100    | 1,247.00  | 111,107,700    | 貸付有価証券<br>27,500株 |
| 6197 | ソラスト                  | 36,600    | 1,109.00  | 40,589,400     |                   |
| 6200 | インソース                 | 131,800   | 573.00    | 75,521,400     | 貸付有価証券<br>40,700株 |
| 6532 | ベイカレント                | 390,500   | 5,506.00  | 2,150,093,000  | 貸付有価証券<br>3,300株  |
| 6533 | Orchestra Holdings    | 11,600    | 1,200.00  | 13,920,000     | 貸付有価証券<br>3,600株  |
| 6535 | アイモバイル                | 78,700    | 487.00    | 38,326,900     | 貸付有価証券<br>23,300株 |
| 6539 | MS-Japan              | 33,800    | 932.00    | 31,501,600     | 貸付有価証券<br>10,000株 |
| 6544 | ジャパンエレベーターサービスホールディング | 449,200   | 1,669.00  | 749,714,800    | 貸付有価証券<br>6,000株  |
| 6560 | エル・ティー・エス             | 7,300     | 1,686.00  | 12,307,800     | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 6564 | ミダックホールディングス          | 26,800    | 1,911.00  | 51,214,800     | 貸付有価証券<br>7,900株  |
| 6571 | キュービーネットホールディングス      | 26,100    | 1,242.00  | 32,416,200     | 貸付有価証券<br>7,700株  |
| 6572 | オープングループ              | 73,400    | 198.00    | 14,533,200     | 貸付有価証券<br>21,700株 |
| 7033 | マネジメントソリューションズ        | 29,300    | 1,320.00  | 38,676,000     |                   |

|      |                  |         |          |             |                   |
|------|------------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| 7034 | プロレド・パートナーズ      | 13,000  | 337.00   | 4,381,000   | 貸付有価証券<br>3,800株  |
| 7038 | フロンティア・マネジメント    | 20,600  | 612.00   | 12,607,200  | 貸付有価証券<br>6,100株  |
| 7071 | アンビスホールディングス     | 113,800 | 330.00   | 37,554,000  | 貸付有価証券<br>33,600株 |
| 7085 | カーブスホールディングス     | 145,100 | 918.00   | 133,201,800 | 貸付有価証券<br>2,100株  |
| 7095 | Macbee Planet    | 22,700  | 1,057.00 | 23,993,900  | 貸付有価証券<br>6,700株  |
| 7354 | ダイレクトマーケティングミックス | 55,300  | 311.00   | 17,198,300  | 貸付有価証券<br>16,400株 |
| 7358 | ポピンズ             | 7,900   | 1,398.00 | 11,044,200  | 貸付有価証券<br>200株    |
| 7366 | LITALICO         | 48,300  | 1,561.00 | 75,396,300  | 貸付有価証券<br>700株    |
| 8876 | リログループ           | 236,600 | 1,835.00 | 434,161,000 |                   |
| 8920 | 東祥               | 44,400  | 736.00   | 32,678,400  | 貸付有価証券<br>13,100株 |
| 9216 | ビーウィズ            | 22,100  | 1,485.00 | 32,818,500  | 貸付有価証券<br>4,300株  |
| 9229 | サンウェルズ           | 40,800  | 116.00   | 4,732,800   | 貸付有価証券<br>12,500株 |
| 9247 | TREホールディングス      | 122,000 | 2,158.00 | 263,276,000 | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 9248 | 人・夢・技術グループ       | 20,000  | 1,546.00 | 30,920,000  | 貸付有価証券<br>5,900株  |
| 9332 | NISSOホールディングス    | 46,000  | 575.00   | 26,450,000  | 貸付有価証券<br>700株    |
| 9336 | 大栄環境             | 115,800 | 3,645.00 | 422,091,000 | 貸付有価証券<br>21,100株 |
| 9341 | GENOVA           | 31,000  | 585.00   | 18,135,000  | 貸付有価証券<br>9,200株  |
| 9347 | 日本管財ホールディングス     | 55,700  | 2,628.00 | 146,379,600 | 貸付有価証券<br>14,500株 |
| 9552 | クオントツ総研ホールディングス  | 62,700  | 839.00   | 52,605,300  | 貸付有価証券<br>18,500株 |
| 9603 | エイチ・アイ・エス        | 154,400 | 941.00   | 145,290,400 | 貸付有価証券<br>48,000株 |
| 9612 | ラックランド           | 24,100  | 1,185.00 | 28,558,500  | 貸付有価証券<br>7,100株  |
| 9616 | 共立メンテナンス         | 211,600 | 2,990.50 | 632,789,800 |                   |
| 9619 | イチネンホールディングス     | 50,500  | 2,190.00 | 110,595,000 | 貸付有価証券<br>13,900株 |
| 9621 | 建設技術研究所          | 54,700  | 2,792.00 | 152,722,400 | 貸付有価証券<br>17,000株 |
| 9622 | スペース             | 38,600  | 1,423.00 | 54,927,800  | 貸付有価証券<br>11,400株 |
| 9628 | 燦ホールディングス        | 44,500  | 1,321.00 | 58,784,500  |                   |
| 9632 | スバル興業            | 18,000  | 3,465.00 | 62,370,000  |                   |

|      |                   |               |          |                   |                   |
|------|-------------------|---------------|----------|-------------------|-------------------|
| 9644 | タナベコンサルティンググループ   | 44,400        | 725.00   | 32,190,000        | 貸付有価証券<br>13,100株 |
| 9663 | ナガワ               | 14,200        | 4,980.00 | 70,716,000        | 貸付有価証券<br>4,200株  |
| 9672 | 東京都競馬             | 38,000        | 4,850.00 | 184,300,000       | 貸付有価証券<br>11,800株 |
| 9678 | カナモト              | 74,900        | 5,320.00 | 398,468,000       | 貸付有価証券<br>19,000株 |
| 9699 | ニシオホールディングス       | 43,900        | 3,880.00 | 170,332,000       | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| 9715 | トランス・コスモス         | 67,800        | 3,625.00 | 245,775,000       | 貸付有価証券<br>21,100株 |
| 9716 | 乃村工藝社             | 231,700       | 1,074.00 | 248,845,800       | 貸付有価証券<br>3,400株  |
| 9722 | 藤田観光              | 106,200       | 1,831.00 | 194,452,200       | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 9726 | KNT－CTホールディングス    | 26,400        | 1,831.00 | 48,338,400        | 貸付有価証券<br>7,800株  |
| 9729 | トーカイ              | 38,400        | 2,320.00 | 89,088,000        | 貸付有価証券<br>700株    |
| 9735 | セコム               | 992,000       | 6,374.00 | 6,323,008,000     | 貸付有価証券<br>12,200株 |
| 9740 | セントラル警備保障         | 25,800        | 2,552.00 | 65,841,600        |                   |
| 9743 | 丹青社               | 112,300       | 1,325.00 | 148,797,500       | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 9744 | メイテックグループホールディングス | 196,000       | 3,058.00 | 599,368,000       | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| 9755 | 応用地質              | 47,000        | 2,822.00 | 132,634,000       | 貸付有価証券<br>14,600株 |
| 9757 | 船井総研ホールディングス      | 212,600       | 1,075.00 | 228,545,000       | 貸付有価証券<br>66,100株 |
| 9769 | 学究社               | 21,200        | 2,509.00 | 53,190,800        | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| 9788 | ナック               | 54,100        | 497.00   | 26,887,700        | 貸付有価証券<br>15,200株 |
| 9793 | ダイセキ              | 102,100       | 3,920.00 | 400,232,000       | 貸付有価証券<br>1,900株  |
| 9795 | ステップ              | 19,300        | 2,195.00 | 42,363,500        | 貸付有価証券<br>5,700株  |
| 合 計  |                   | 1,071,794,900 |          | 2,904,384,046,700 |                   |

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

## 外国株式インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

[2026年 6月25日現在]

|                               | [2026年 6月25日現在]    |
|-------------------------------|--------------------|
| 1. 期首                         | 2025年 6月26日        |
| 期首元本額                         | 1,121,503,179,778円 |
| 期中追加設定元本額                     | 418,742,554,405円   |
| 期中一部解約元本額                     | 54,562,930,965円    |
| 元本の内訳※                        |                    |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）        | 123,004,788円       |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）      | 767,338,826円       |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）        | 890,771,747円       |
| MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信      | 4,106,837,536円     |
| MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信    | 9,804,709,940円     |
| 三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）   | 847,408,324円       |
| 三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金） | 6,171,884,373円     |

|                                   | [2026年 6月25日現在]  |
|-----------------------------------|------------------|
| 三菱UFJ プライムバランス (成長型) (確定拠出年金)     | 8,741,212,440円   |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)        | 25,729,233円      |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型)           | 74,017,319円      |
| eMAXIS 先進国株式インデックス (除く日本)         | 14,219,253,328円  |
| eMAXIS バランス (8資産均等型)              | 818,593,175円     |
| eMAXIS バランス (波乗り型)                | 32,981,056円      |
| 三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)     | 1,550,262,622円   |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金) | 152,657,460円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金) | 278,935,746円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金) | 296,469,530円     |
| eMAXIS Slim 先進国株式インデックス (除く日本)    | 125,717,556,130円 |
| 海外株式セレクション (ラップ向け)                | 3,137,280,390円   |
| eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)         | 6,266,905,670円   |
| つみたて先進国株式                         | 56,737,441,527円  |
| つみたて8資産均等バランス                     | 3,165,413,576円   |
| つみたて4資産均等バランス                     | 1,351,220,821円   |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s             | 2,105,534円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s             | 3,415,829円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s             | 7,263,223円       |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金) | 156,429,076円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金) | 272,355,001円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金) | 194,505,723円     |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式15)             | 74,776,311円      |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式40)             | 580,202,842円     |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式65)             | 1,976,327,685円   |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本)          | 98,434,114,669円  |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)        | 1,723,301,756円   |
| 三菱UFJ DC年金インデックス (先進国株式)          | 6,366,815,570円   |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カントリー)     | 988,486,047,748円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金) | 198,905,070円     |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式25)             | 32,848,186円      |
| つみたて全世界株式                         | 16,835,894,448円  |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金) | 123,533,752円     |
| ラップ向けインデックスf 先進国株式                | 2,967,898,020円   |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式80)             | 162,208,659円     |
| ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)         | 617,224,786円     |
| ラップ向けダイナミックアロケーションファンド            | 29,774,637円      |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド             | 7,945,578円       |
| アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)          | 48,080,953円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金) | 28,104,393円      |
| eMAXIS/PayPay証券 全世界バランス           | 112,976,467円     |
| eMAXIS Slim 先進国株式 (含む日本) <オール先進国> | 841,132,897円     |
| 三菱UFJ 資産配分最適化バランス (R1)            | 9,357,269円       |
| 三菱UFJ 資産配分最適化バランス (R2)            | 102,345,842円     |
| 三菱UFJ 資産配分最適化バランス (R3)            | 712,820,646円     |
| 三菱UFJ 資産配分最適化バランス (R4)            | 589,072,224円     |
| 三菱UFJ 資産配分最適化バランス (R5)            | 258,485,522円     |
| 三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド            | 32,093,822,952円  |
| eMAXIS 全世界株式インデックス (除く日本)         | 9,159,086,593円   |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)        | 183,352,098円     |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)        | 528,332,206円     |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)       | 67,906,628円      |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)   | 481,730,769円     |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)        | 53,199,132円      |
| eMAXIS バランス (4資産均等型)              | 423,319,737円     |

|                                            | [2026年 6月25日現在] |
|--------------------------------------------|-----------------|
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）                  | 71,709,061円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）                  | 134,335,227円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）                 | 664,421,031円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）                    | 595,887,286円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）                   | 1,413,777,033円  |
| 三菱UFJ 外国株式ファンドVA（適格機関投資家限定）                | 484,615,522円    |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）              | 2,775,500円      |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）              | 1,558,432,479円  |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）            | 11,407,709円     |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）            | 334,696,727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）             | 6,631,140,466円  |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）            | 42,147円         |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）              | 258,623,701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）            | 3,644,532,744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）    | 787,406,177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）   | 105,088,670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）      | 117,624,438円    |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）                 | 63,264,842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）          | 1,110,065,855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）    | 53,142,004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）           | 7,213,642,696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）        | 63,757,253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） | 4,038,780,024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）  | 27,492,446円     |
| 海外株式インデックスファンドS                            | 25,250,657,554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）                 | 2,048,483,756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）                | 1,332,531,171円  |
| グローバルバランスオープンV（適格機関投資家限定）                  | 26,256,321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）          | 1,276,944,215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）        | 4,150,547,730円  |
| パッシブバランスファンド（2%コース）（適格機関投資家転売制限付）          | 1,373,543円      |
| パッシブバランスファンド（5%コース）（適格機関投資家転売制限付）          | 17,192,115円     |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンド                       | 2,911,941,391円  |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA                 | 425,828円        |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA               | 1,092,236円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA                 | 312,270円        |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA                 | 1,341,381円      |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA                     | 14,684,796円     |
| 三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）                 | 338,616円        |
| 三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）                 | 2,414,616円      |
| 三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）                 | 353,205円        |
| 三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）                 | 4,373,445円      |
| 三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド                   | 8,172,616,759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）        | 50,206,639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）      | 232,581,439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）        | 270,001,545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）        | 304,565,621円    |

|           |                    |
|-----------|--------------------|
|           | [2026年 6月25日現在]    |
| 合計        | 1,485,682,803,218円 |
| 2. 受益権の総数 | 1,485,682,803,218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 2025年 6月26日<br>至 2026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。<br>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。<br>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。<br>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。<br>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。<br>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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                         | [2026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<br>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。<br>（２）デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。<br>（３）上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。                                                                                                                                     |

（有価証券に関する注記）

### 売買目的有価証券

| 種類   | [2026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   | 45,216,271,102     |
| 投資証券 | 1,213,683,669      |
| 合計   | 46,429,954,771     |

（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

[2026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<br>買建 | 195,135,339,871 | — | 191,465,256,410 | △3,670,083,461 |
|------|----------------|-----------------|---|-----------------|----------------|
| 合計   |                | 195,135,339,871 | — | 191,465,256,410 | △3,670,083,461 |

（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

[2026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<br>の取引 | 為替予約取引<br>買建 |                |       |                |           |
|               | アメリカドル       | 10,420,559,071 | —     | 10,423,774,105 | 3,215,034 |
|               | カナダドル        | 396,267,546    | —     | 395,999,315    | △268,231  |
|               | オーストラリアドル    | 263,418,581    | —     | 263,225,093    | △193,488  |
|               | イギリスポンド      | 550,469,588    | —     | 550,100,355    | △369,233  |
|               | スイスフラン       | 359,162,037    | —     | 358,877,065    | △284,972  |
|               | 香港ドル         | 70,041,978     | —     | 70,039,602     | △2,376    |
|               | シンガポールドル     | 70,052,457     | —     | 70,091,235     | 38,778    |
|               | スウェーデンクローネ   | 80,172,703     | —     | 80,173,670     | 967       |
|               | デンマーククローネ    | 84,672,932     | —     | 84,665,353     | △7,579    |
|               | ユーロ          | 849,731,063    | —     | 849,536,304    | △194,759  |
| 合計            |              | 13,144,547,956 | —     | 13,146,482,097 | 1,934,141 |

（注）時価の算定方法

- 1 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
  - ①為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。
  - ②当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
    - （イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
    - （ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

|              | [2026年 6月25日現在] |
|--------------|-----------------|
| 1口当たり純資産額    | 10.4874円        |
| (1万口当たり純資産額) | (104,874円)      |

## 附属明細表

第１ 有価証券明細表  
(1)株式

(単位：円)

| 通貨     | 銘柄                           | 株式数       | 評価額    |                | 備考 |
|--------|------------------------------|-----------|--------|----------------|----|
|        |                              |           | 単価     | 金額             |    |
| アメリカドル | BAKER HUGHES CO              | 1,134,707 | 56.38  | 63,974,780.66  |    |
|        | CHENIERE ENERGY INC          | 236,701   | 230.86 | 54,644,792.86  |    |
|        | CHEVRON CORP                 | 2,129,883 | 171.45 | 365,168,440.35 |    |
|        | CONOCOPHILLIPS               | 1,399,107 | 106.92 | 149,592,520.44 |    |
|        | DEVON ENERGY CORP            | 1,283,570 | 42.74  | 54,859,781.80  |    |
|        | DIAMONDBACK ENERGY INC       | 220,137   | 183.48 | 40,390,736.76  |    |
|        | EOG RESOURCES INC            | 609,782   | 134.45 | 81,985,189.90  |    |
|        | EQT CORP                     | 672,958   | 51.48  | 34,643,877.84  |    |
|        | EXPAND ENERGY CORP           | 267,690   | 88.60  | 23,717,334.00  |    |
|        | EXXON MOBIL CORP             | 4,797,882 | 136.90 | 656,830,045.80 |    |
|        | HALLIBURTON CO               | 968,437   | 33.90  | 32,830,014.30  |    |
|        | KINDER MORGAN INC            | 2,172,999 | 32.59  | 70,818,037.41  |    |
|        | MARATHON PETROLEUM CORP      | 336,291   | 246.51 | 82,899,094.41  |    |
|        | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 856,399   | 51.09  | 43,753,424.91  |    |
|        | ONEOK INC                    | 728,411   | 87.31  | 63,597,564.41  |    |
|        | PHILLIPS 66                  | 466,734   | 168.64 | 78,710,021.76  |    |
|        | SLB LTD                      | 1,736,226 | 46.61  | 80,925,493.86  |    |
|        | TARGA RESOURCES CORP         | 239,147   | 266.32 | 63,689,629.04  |    |
|        | TECHNIPFMC PLC               | 466,286   | 64.29  | 29,977,526.94  |    |
|        | TEXAS PACIFIC LAND CORP      | 66,769    | 377.56 | 25,209,303.64  |    |
|        | VALERO ENERGY CORP           | 341,615   | 242.43 | 82,817,724.45  |    |
|        | WILLIAMS COS INC             | 1,415,452 | 75.87  | 107,390,343.24 |    |
|        | AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 243,216   | 278.73 | 67,791,595.68  |    |
|        | AMCOR PLC                    | 549,736   | 41.71  | 22,929,488.56  |    |
|        | AMRIZE LTD                   | 563,448   | 54.53  | 30,724,819.44  |    |
|        | AVERY DENNISON CORP          | 91,979    | 163.15 | 15,006,373.85  |    |
|        | BALL CORP                    | 290,439   | 60.98  | 17,710,970.22  |    |
|        | CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   | 177,058   | 103.09 | 18,252,909.22  |    |
|        | COEUR MINING INC             | 1,164,888 | 15.47  | 18,020,817.36  |    |
|        | CORTEVA INC                  | 763,334   | 80.09  | 61,135,420.06  |    |
|        | CRH PLC                      | 775,521   | 112.02 | 86,873,862.42  |    |
|        | DOW INC                      | 837,112   | 29.38  | 24,594,350.56  |    |
|        | DUPONT DE NEMOURS INC        | 158,808   | 137.82 | 21,886,918.56  |    |
|        | ECOLAB INC                   | 291,787   | 276.29 | 80,617,830.23  |    |
|        | FREEMPORT-MCMORAN INC        | 1,654,684 | 61.84  | 102,325,658.56 |    |
|        | INTERNATIONAL PAPER CO       | 585,811   | 38.30  | 22,436,561.30  |    |
|        | INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 298,300   | 75.83  | 22,620,089.00  |    |
|        | LINDE PLC                    | 534,958   | 515.73 | 275,893,889.34 |    |

|                             |           |          |                |
|-----------------------------|-----------|----------|----------------|
| LYONDELLBASELL INDU-CL A    | 297,491   | 56.12    | 16,695,194.92  |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS   | 69,083    | 616.62   | 42,597,959.46  |
| NEWMONT CORP                | 1,240,254 | 94.04    | 116,633,486.16 |
| NUCOR CORP                  | 255,457   | 240.52   | 61,442,517.64  |
| PACKAGING CORP OF AMERICA   | 103,035   | 237.85   | 24,506,874.75  |
| PPG INDUSTRIES INC          | 254,126   | 120.98   | 30,744,163.48  |
| RELIANCE INC                | 59,590    | 396.86   | 23,648,887.40  |
| RPM INTERNATIONAL INC       | 150,362   | 109.70   | 16,494,711.40  |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE     | 269,000   | 333.13   | 89,611,970.00  |
| SMURFIT WESTROCK PLC        | 607,242   | 46.56    | 28,273,187.52  |
| STEEL DYNAMICS INC          | 156,581   | 241.43   | 37,803,350.83  |
| VULCAN MATERIALS CO         | 149,403   | 307.29   | 45,910,047.87  |
| 3M CO                       | 608,830   | 165.91   | 101,010,985.30 |
| AERCAP HOLDINGS NV          | 189,352   | 147.89   | 28,003,267.28  |
| ALLEGION PLC                | 105,125   | 134.00   | 14,086,750.00  |
| AMETEK INC                  | 260,652   | 235.38   | 61,352,267.76  |
| AXON ENTERPRISE INC         | 87,043    | 456.73   | 39,755,149.39  |
| BLOOM ENERGY CORP- A        | 312,652   | 326.19   | 101,983,955.88 |
| BOEING CO/THE               | 863,240   | 220.25   | 190,128,610.00 |
| CARLISLE COS INC            | 46,753    | 378.53   | 17,697,413.09  |
| CARRIER GLOBAL CORP         | 857,880   | 74.06    | 63,534,592.80  |
| CATERPILLAR INC             | 537,423   | 994.45   | 534,440,302.35 |
| CNH INDUSTRIAL NV           | 1,027,420 | 10.31    | 10,592,700.20  |
| COMFORT SYSTEMS USA INC     | 41,143    | 1,954.47 | 80,412,759.21  |
| CUMMINS INC                 | 160,325   | 694.87   | 111,405,032.75 |
| CURTISS-WRIGHT CORP         | 42,700    | 762.92   | 32,576,684.00  |
| DEERE & CO                  | 280,939   | 600.75   | 168,774,104.25 |
| DOVER CORP                  | 157,925   | 224.31   | 35,424,156.75  |
| EATON CORP PLC              | 448,649   | 404.59   | 181,518,898.91 |
| EMCOR GROUP INC             | 51,024    | 847.17   | 43,226,002.08  |
| EMERSON ELECTRIC CO         | 649,872   | 141.44   | 91,917,895.68  |
| FASTENAL CO                 | 1,313,937 | 46.26    | 60,782,725.62  |
| FERGUSON ENTERPRISES INC    | 222,145   | 236.68   | 52,577,278.60  |
| FORTIVE CORP                | 321,392   | 60.39    | 19,408,862.88  |
| FTAI AVIATION LTD           | 116,807   | 272.14   | 31,787,856.98  |
| GE AEROSPACE                | 1,206,862 | 365.88   | 441,566,668.56 |
| GE VERNOVA INC              | 311,364   | 1,057.65 | 329,314,134.60 |
| GENERAL DYNAMICS CORP       | 266,678   | 344.32   | 91,822,568.96  |
| GRACO INC                   | 189,157   | 75.00    | 14,186,775.00  |
| HEICO CORP                  | 51,854    | 335.30   | 17,386,646.20  |
| HEICO CORP-CLASS A          | 87,352    | 245.97   | 21,485,971.44  |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 734,742   | 227.42   | 167,095,025.64 |

|                              |           |          |                |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| HOWMET AEROSPACE INC         | 464,499   | 276.06   | 128,229,593.94 |
| HUBBELL INC                  | 62,307    | 518.18   | 32,286,241.26  |
| IDEX CORP                    | 85,848    | 222.16   | 19,071,991.68  |
| ILLINOIS TOOL WORKS          | 315,255   | 263.68   | 83,126,438.40  |
| INGERSOLL-RAND INC           | 460,267   | 78.32    | 36,048,111.44  |
| JARDINE MATHESON HOLDINGS    | 176,400   | 62.31    | 10,991,484.00  |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 710,083   | 142.81   | 101,406,953.23 |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC    | 213,610   | 287.27   | 61,363,744.70  |
| LENNOX INTERNATIONAL INC     | 35,654    | 551.75   | 19,672,094.50  |
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 238,443   | 491.64   | 117,228,116.52 |
| MASCO CORP                   | 236,140   | 78.05    | 18,430,727.00  |
| MASTEC INC                   | 68,891    | 393.14   | 27,083,807.74  |
| NORDSON CORP                 | 59,652    | 296.11   | 17,663,553.72  |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 157,053   | 503.01   | 78,999,229.53  |
| OTIS WORLDWIDE CORP          | 445,623   | 72.63    | 32,365,598.49  |
| PACCAR INC                   | 601,775   | 117.03   | 70,425,728.25  |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 146,132   | 961.09   | 140,446,003.88 |
| PENTAIR PLC                  | 188,147   | 74.81    | 14,075,277.07  |
| QUANTA SERVICES INC          | 172,752   | 701.88   | 121,251,173.76 |
| ROCKET LAB CORP              | 592,737   | 85.41    | 50,625,667.17  |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 129,318   | 460.37   | 59,534,127.66  |
| RTX CORP                     | 1,555,845 | 185.06   | 287,924,675.70 |
| SNAP-ON INC                  | 61,228    | 392.14   | 24,009,947.92  |
| TEXTRON INC                  | 200,109   | 86.54    | 17,317,432.86  |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC       | 256,680   | 483.15   | 124,014,942.00 |
| TRANSDIGM GROUP INC          | 65,554    | 1,322.67 | 86,706,309.18  |
| UNITED RENTALS INC           | 73,097    | 1,083.72 | 79,216,680.84  |
| VERTIV HOLDINGS CO-A         | 417,011   | 316.43   | 131,954,790.73 |
| WABTEC CORP                  | 193,513   | 272.48   | 52,728,422.24  |
| WATSCO INC                   | 39,370    | 400.98   | 15,786,582.60  |
| WW GRAINGER INC              | 49,917    | 1,342.57 | 67,017,066.69  |
| XYLEM INC                    | 286,163   | 112.04   | 32,061,702.52  |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING    | 469,259   | 219.85   | 103,168,937.44 |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 139,322   | 140.10   | 19,519,012.20  |
| CINTAS CORP                  | 389,868   | 170.93   | 66,640,137.24  |
| COPART INC                   | 1,037,990 | 30.40    | 31,554,896.00  |
| EQUIFAX INC                  | 140,994   | 157.61   | 22,222,064.34  |
| JACOBS SOLUTIONS INC         | 141,347   | 122.04   | 17,249,987.88  |
| LEIDOS HOLDINGS INC          | 132,287   | 104.32   | 13,800,179.84  |
| PAYCHEX INC                  | 367,576   | 96.30    | 35,397,568.80  |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 231,242   | 213.58   | 49,388,666.36  |
| ROLLINS INC                  | 346,047   | 44.54    | 15,412,933.38  |

|                              |           |          |                  |
|------------------------------|-----------|----------|------------------|
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS   | 246,428   | 65.97    | 16,256,855.16    |
| TRANSUNION                   | 211,347   | 68.00    | 14,371,596.00    |
| VERALTO CORP                 | 288,851   | 86.32    | 24,933,618.32    |
| VERISK ANALYTICS INC         | 148,023   | 180.06   | 26,653,021.38    |
| WASTE CONNECTIONS INC        | 294,273   | 166.45   | 48,981,740.85    |
| WASTE MANAGEMENT INC         | 466,614   | 223.26   | 104,176,241.64   |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC  | 136,315   | 177.28   | 24,165,923.20    |
| CSX CORP                     | 2,157,270 | 46.06    | 99,363,856.20    |
| DELTA AIR LINES INC          | 180,311   | 90.65    | 16,345,192.15    |
| EXPEDITORS INTL WASH INC     | 157,725   | 160.16   | 25,261,236.00    |
| FEDEX CORP                   | 256,543   | 316.83   | 81,280,518.69    |
| FEDEX FREIGHT HOLDING CO     | 123,400   | 160.45   | 19,799,530.00    |
| GRAB HOLDINGS LTD - CL A     | 2,626,031 | 3.49     | 9,164,848.19     |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC  | 88,726    | 269.06   | 23,872,617.56    |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 257,382   | 303.82   | 78,197,799.24    |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE    | 214,698   | 219.04   | 47,027,449.92    |
| UBER TECHNOLOGIES INC        | 2,061,142 | 73.85    | 152,215,336.70   |
| UNION PACIFIC CORP           | 686,087   | 259.96   | 178,355,176.52   |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | 97,297    | 130.54   | 12,701,150.38    |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B   | 862,245   | 106.14   | 91,518,684.30    |
| XPO INC                      | 129,132   | 196.83   | 25,417,051.56    |
| APTIV PLC                    | 246,800   | 60.42    | 14,911,656.00    |
| FORD MOTOR CO                | 4,472,124 | 13.84    | 61,894,196.16    |
| GENERAL MOTORS CO            | 1,047,814 | 78.95    | 82,724,915.30    |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A      | 929,309   | 14.64    | 13,605,083.76    |
| TESLA INC                    | 3,248,291 | 375.53   | 1,219,830,719.23 |
| DECKERS OUTDOOR CORP         | 161,769   | 105.70   | 17,098,983.30    |
| DR HORTON INC                | 296,780   | 166.51   | 49,416,837.80    |
| GARMIN LTD                   | 190,128   | 240.02   | 45,634,522.56    |
| LENNAR CORP-A                | 236,643   | 92.95    | 21,995,966.85    |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 112,912   | 113.09   | 12,769,218.08    |
| NIKE INC -CL B               | 1,383,249 | 41.82    | 57,847,473.18    |
| NVR INC                      | 3,116     | 6,764.83 | 21,079,210.28    |
| PULTEGROUP INC               | 220,146   | 135.71   | 29,876,013.66    |
| SHARKNINJA INC               | 96,461    | 140.19   | 13,522,867.59    |
| TAPESTRY INC                 | 236,755   | 149.75   | 35,454,061.25    |
| AIRBNB INC-CLASS A           | 492,301   | 144.40   | 71,088,264.40    |
| BOOKING HOLDINGS INC         | 906,149   | 181.25   | 164,239,506.25   |
| CARNIVAL CORP LTD            | 1,467,892 | 28.91    | 42,436,757.72    |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 1,521,743 | 31.69    | 48,224,035.67    |
| COMPASS GROUP PLC            | 1,935,166 | 32.45    | 62,796,136.70    |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 132,139   | 213.45   | 28,205,069.55    |

|                              |            |          |                  |
|------------------------------|------------|----------|------------------|
| DOMINO'S PIZZA INC           | 34,841     | 287.62   | 10,020,968.42    |
| DOORDASH INC - A             | 421,570    | 177.93   | 75,009,950.10    |
| EXPEDIA GROUP INC            | 135,342    | 262.15   | 35,479,905.30    |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI | 157,691    | 98.51    | 15,534,140.41    |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 265,608    | 343.42   | 91,215,099.36    |
| HYATT HOTELS CORP - CL A     | 45,594     | 197.32   | 8,996,608.08     |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 165,914    | 171.70   | 28,487,433.80    |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 335,603    | 47.76    | 16,028,399.28    |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 253,572    | 383.56   | 97,260,076.32    |
| MCDONALD'S CORP              | 819,205    | 273.88   | 224,363,865.40   |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 293,126    | 320.95   | 94,078,789.70    |
| STARBUCKS CORP               | 1,306,168  | 103.53   | 135,227,573.04   |
| YUM! BRANDS INC              | 316,397    | 153.02   | 48,415,068.94    |
| ALPHABET INC-CL A            | 6,718,096  | 345.29   | 2,319,691,367.84 |
| ALPHABET INC-CL C            | 5,334,069  | 345.04   | 1,840,467,167.76 |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 92,517     | 131.42   | 12,158,584.14    |
| ECHOSTAR CORP-A              | 152,822    | 99.86    | 15,260,804.92    |
| ELECTRONIC ARTS INC          | 257,748    | 204.52   | 52,714,620.96    |
| FOX CORP - CLASS A           | 232,239    | 49.80    | 11,565,502.20    |
| FOX CORP - CLASS B           | 159,949    | 45.37    | 7,256,886.13     |
| LIBERTY MEDIA CORP-FORMULA-C | 248,409    | 90.03    | 22,364,262.27    |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN | 184,855    | 171.47   | 31,697,086.85    |
| META PLATFORMS INC-CLASS A   | 2,534,481  | 557.67   | 1,413,404,019.27 |
| NETFLIX INC                  | 4,862,987  | 71.84    | 349,356,986.08   |
| NEWS CORP - CLASS A          | 437,930    | 25.23    | 11,048,973.90    |
| OMNICOM GROUP                | 319,385    | 73.66    | 23,525,899.10    |
| REDDIT INC-CL A              | 128,890    | 160.72   | 20,715,200.80    |
| ROBLOX CORP -CLASS A         | 670,312    | 47.94    | 32,134,757.28    |
| SPOTIFY TECHNOLOGY SA        | 170,760    | 455.01   | 77,697,507.60    |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE | 204,655    | 235.77   | 48,251,509.35    |
| WALT DISNEY CO/THE           | 2,046,924  | 101.12   | 206,984,954.88   |
| WARNER BROS DISCOVERY INC    | 2,682,071  | 27.20    | 72,952,331.20    |
| AMAZON.COM INC               | 11,169,165 | 234.27   | 2,616,600,284.55 |
| AUTOZONE INC                 | 19,189     | 3,087.77 | 59,251,218.53    |
| BEST BUY CO INC              | 233,356    | 77.63    | 18,115,426.28    |
| BURLINGTON STORES INC        | 72,738     | 337.79   | 24,570,169.02    |
| CARVANA CO                   | 741,564    | 67.91    | 50,359,611.24    |
| DICK'S SPORTING GOODS INC    | 68,591     | 236.93   | 16,251,265.63    |
| EBAY INC                     | 489,062    | 109.45   | 53,527,835.90    |
| GENUINE PARTS CO             | 167,169    | 110.73   | 18,510,623.37    |
| HOME DEPOT INC               | 1,150,942  | 342.86   | 394,611,974.12   |
| LOWE'S COS INC               | 648,960    | 221.45   | 143,712,192.00   |

|                              |           |          |                |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| MERCADOLIBRE INC             | 52,968    | 1,659.57 | 87,904,103.76  |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 956,715   | 87.82    | 84,018,711.30  |
| ROSS STORES INC              | 361,908   | 228.59   | 82,728,549.72  |
| SEA LTD-ADR                  | 428,747   | 92.75    | 39,766,284.25  |
| TJX COMPANIES INC            | 1,280,487 | 165.17   | 211,498,037.79 |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY       | 616,798   | 30.06    | 18,540,947.88  |
| ULTA BEAUTY INC              | 48,826    | 478.93   | 23,384,236.18  |
| WILLIAMS-SONOMA INC          | 137,012   | 235.66   | 32,288,247.92  |
| CASEY'S GENERAL STORES INC   | 43,589    | 801.35   | 34,930,045.15  |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 512,077   | 961.09   | 492,152,083.93 |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 246,259   | 119.17   | 29,346,685.03  |
| DOLLAR TREE INC              | 212,859   | 119.35   | 25,404,721.65  |
| KROGER CO                    | 642,950   | 58.48    | 37,599,716.00  |
| SYSCO CORP                   | 548,269   | 80.59    | 44,184,998.71  |
| TARGET CORP                  | 517,790   | 141.20   | 73,111,948.00  |
| WALMART INC                  | 5,061,087 | 119.00   | 602,269,353.00 |
| ALTRIA GROUP INC             | 1,929,694 | 72.07    | 139,073,046.58 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    | 548,508   | 75.08    | 41,181,980.64  |
| BUNGE GLOBAL SA              | 151,550   | 108.99   | 16,517,434.50  |
| COCA-COLA CO/THE             | 4,465,459 | 80.60    | 359,915,995.40 |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE | 226,746   | 98.80    | 22,402,504.80  |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 160,513   | 143.02   | 22,956,569.26  |
| GENERAL MILLS INC            | 628,112   | 34.80    | 21,858,297.60  |
| HERSHEY CO/THE               | 170,303   | 183.04   | 31,172,261.12  |
| KEURIG DR PEPPER INC         | 1,470,824 | 31.40    | 46,183,873.60  |
| KRAFT HEINZ CO/THE           | 981,856   | 22.94    | 22,523,776.64  |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 303,421   | 47.60    | 14,442,839.60  |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 1,485,929 | 61.74    | 91,741,256.46  |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 822,757   | 94.70    | 77,915,087.90  |
| PEPSICO INC                  | 1,576,742 | 142.27   | 224,323,084.34 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 1,798,953 | 178.78   | 321,616,817.34 |
| TYSON FOODS INC-CL A         | 335,115   | 57.81    | 19,372,998.15  |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 267,308   | 98.67    | 26,375,280.36  |
| CLOROX COMPANY               | 144,628   | 95.38    | 13,794,618.64  |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 882,574   | 91.88    | 81,090,899.12  |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 286,810   | 83.27    | 23,882,668.70  |
| KENVUE INC                   | 2,202,709 | 18.80    | 41,410,929.20  |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 388,945   | 106.73   | 41,512,099.85  |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 2,680,298 | 152.04   | 407,512,507.92 |
| ABBOTT LABORATORIES          | 2,014,398 | 90.49    | 182,282,875.02 |
| BECTON DICKINSON AND CO      | 326,975   | 147.77   | 48,317,095.75  |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       | 1,702,476 | 44.46    | 75,692,082.96  |

|                              |           |          |                  |
|------------------------------|-----------|----------|------------------|
| CARDINAL HEALTH INC          | 274,641   | 233.01   | 63,994,099.41    |
| CENCORA INC                  | 213,170   | 284.47   | 60,640,469.90    |
| CENTENE CORP                 | 561,451   | 62.97    | 35,354,569.47    |
| COOPER COS INC/THE           | 229,967   | 68.83    | 15,828,628.61    |
| CVS HEALTH CORP              | 1,478,340 | 101.87   | 150,598,495.80   |
| DEXCOM INC                   | 437,643   | 69.75    | 30,525,599.25    |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP    | 657,850   | 89.66    | 58,982,831.00    |
| ELEVANCE HEALTH INC          | 251,659   | 384.00   | 96,637,056.00    |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGY     | 525,179   | 64.88    | 34,073,613.52    |
| HCA HEALTHCARE INC           | 179,046   | 387.76   | 69,426,876.96    |
| HUMANA INC                   | 136,478   | 361.64   | 49,355,903.92    |
| IDEXX LABORATORIES INC       | 90,639    | 549.16   | 49,775,313.24    |
| INSULET CORP                 | 83,253    | 148.88   | 12,394,706.64    |
| INTUITIVE SURGICAL INC       | 411,311   | 401.83   | 165,277,099.13   |
| LABCORP HOLDINGS INC         | 95,753    | 265.18   | 25,391,780.54    |
| MCKESSON CORP                | 140,399   | 766.55   | 107,622,853.45   |
| MEDLINE INC-CL A             | 420,000   | 36.05    | 15,141,000.00    |
| MEDTRONIC PLC                | 1,487,869 | 80.13    | 119,222,942.97   |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 125,855   | 203.11   | 25,562,409.05    |
| RESMED INC                   | 164,586   | 196.50   | 32,341,149.00    |
| STERIS PLC                   | 113,753   | 207.17   | 23,566,209.01    |
| STRYKER CORP                 | 400,001   | 313.68   | 125,472,313.68   |
| THE CIGNA GROUP              | 302,134   | 279.46   | 84,434,367.64    |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 1,049,213 | 405.80   | 425,770,635.40   |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    | 166,254   | 161.35   | 26,825,082.90    |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 226,068   | 90.56    | 20,472,718.08    |
| ABBVIE INC                   | 2,041,634 | 234.89   | 479,559,410.26   |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 328,253   | 131.63   | 43,207,942.39    |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 150,747   | 294.06   | 44,328,662.82    |
| AMGEN INC                    | 623,065   | 351.43   | 218,963,732.95   |
| BIOGEN INC                   | 169,485   | 199.59   | 33,827,511.15    |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 2,359,716 | 55.00    | 129,784,380.00   |
| DANAHER CORP                 | 737,849   | 188.87   | 139,357,540.63   |
| ELI LILLY & CO               | 926,909   | 1,117.26 | 1,035,598,349.34 |
| GILEAD SCIENCES INC          | 1,434,297 | 125.16   | 179,516,612.52   |
| ILLUMINA INC                 | 168,639   | 175.09   | 29,527,002.51    |
| INCYTE CORP                  | 196,596   | 108.46   | 21,322,802.16    |
| INSMED INC                   | 246,332   | 103.46   | 25,485,508.72    |
| IQVIA HOLDINGS INC           | 190,661   | 185.62   | 35,390,494.82    |
| JOHNSON & JOHNSON            | 2,778,986 | 241.00   | 669,735,626.00   |
| MERCK & CO. INC.             | 2,855,316 | 120.60   | 344,351,109.60   |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 23,427    | 1,203.18 | 28,186,897.86    |

|                              |           |          |                  |
|------------------------------|-----------|----------|------------------|
| NATERA INC                   | 151,828   | 259.97   | 39,470,725.16    |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC   | 108,276   | 166.06   | 17,980,312.56    |
| PFIZER INC                   | 6,562,646 | 24.04    | 157,766,009.84   |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 118,778   | 623.43   | 74,049,768.54    |
| REVOLUTION MEDICINES INC     | 182,189   | 169.77   | 30,930,226.53    |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A     | 460,227   | 54.28    | 24,981,121.56    |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   | 1,342,520 | 34.22    | 45,941,034.40    |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 429,690   | 492.20   | 211,493,418.00   |
| UNITED THERAPEUTICS CORP     | 46,108    | 549.90   | 25,354,789.20    |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 294,474   | 475.20   | 139,934,044.80   |
| WATERS CORP                  | 112,708   | 369.18   | 41,609,539.44    |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 81,067    | 340.41   | 27,596,017.47    |
| ZOETIS INC                   | 492,584   | 78.17    | 38,505,291.28    |
| BANK OF AMERICA CORP         | 7,834,717 | 57.73    | 452,298,212.41   |
| CITIGROUP INC                | 1,970,641 | 143.59   | 282,964,341.19   |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 500,992   | 69.46    | 34,798,904.32    |
| FIFTH THIRD BANCORP          | 1,051,771 | 54.96    | 57,805,334.16    |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A   | 8,665     | 2,117.29 | 18,346,317.85    |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC    | 2,403,129 | 17.58    | 42,247,007.82    |
| JPMORGAN CHASE & CO          | 3,094,961 | 333.45   | 1,032,014,745.45 |
| KEYCORP                      | 1,061,465 | 23.12    | 24,541,070.80    |
| M & T BANK CORP              | 172,445   | 233.26   | 40,224,520.70    |
| PINNACLE FINANCIAL PARTNERS  | 170,133   | 97.02    | 16,506,303.66    |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 464,829   | 239.92   | 111,521,773.68   |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 980,087   | 29.49    | 28,902,765.63    |
| TRUIST FINANCIAL CORP        | 1,417,430 | 49.79    | 70,573,839.70    |
| US BANCORP                   | 1,794,938 | 60.11    | 107,893,723.18   |
| WELLS FARGO & CO             | 3,537,659 | 84.30    | 298,224,653.70   |
| AFFIRM HOLDINGS INC          | 318,626   | 77.66    | 24,744,495.16    |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 613,460   | 342.56   | 210,146,857.60   |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 103,000   | 460.95   | 47,477,850.00    |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 845,472   | 22.31    | 18,862,480.32    |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 487,576   | 122.60   | 59,776,817.60    |
| ARES MANAGEMENT CORP - A     | 246,323   | 113.87   | 28,048,800.01    |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 795,106   | 143.56   | 114,145,417.36   |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 1,604,219 | 494.81   | 793,783,603.39   |
| BLACKROCK INC                | 170,661   | 982.60   | 167,691,498.60   |
| BLACKSTONE INC               | 850,984   | 112.99   | 96,152,682.16    |
| BLOCK INC                    | 597,771   | 75.68    | 45,239,309.28    |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 693,478   | 200.48   | 139,028,469.44   |
| CARLYLE GROUP INC/THE        | 300,182   | 41.06    | 12,325,472.92    |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC      | 119,414   | 249.59   | 29,804,540.26    |

|                              |           |          |                |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| CME GROUP INC                | 416,494   | 231.68   | 96,493,329.92  |
| COINBASE GLOBAL INC -CLASS A | 244,772   | 150.11   | 36,742,724.92  |
| COREBRIDGE FINANCIAL INC     | 301,188   | 27.98    | 8,427,240.24   |
| CORPAY INC                   | 71,074    | 344.26   | 24,467,935.24  |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV  | 581,456   | 38.66    | 22,479,088.96  |
| FISERV INC                   | 614,973   | 48.19    | 29,635,548.87  |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR        | 58,878    | 98.30    | 5,787,707.40   |
| GLOBAL PAYMENTS INC          | 277,041   | 67.08    | 18,583,910.28  |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      | 340,777   | 1,076.91 | 366,986,159.07 |
| INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A | 483,070   | 92.79    | 44,824,065.30  |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 650,453   | 130.02   | 84,571,899.06  |
| KKR & CO INC                 | 729,171   | 91.51    | 66,726,438.21  |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC   | 93,044    | 282.15   | 26,252,364.60  |
| MASTERCARD INC - A           | 944,184   | 494.41   | 466,814,011.44 |
| MOODY'S CORP                 | 172,592   | 449.79   | 77,630,155.68  |
| MORGAN STANLEY               | 1,368,401 | 219.86   | 300,856,643.86 |
| MSCI INC                     | 81,942    | 577.29   | 47,304,297.18  |
| NASDAQ INC                   | 524,947   | 81.61    | 42,840,924.67  |
| NORTHERN TRUST CORP          | 204,236   | 173.93   | 35,522,767.48  |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 981,921   | 42.48    | 41,712,004.08  |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | 209,202   | 154.79   | 32,382,377.58  |
| ROBINHOOD MARKETS INC - A    | 870,478   | 97.19    | 84,601,756.82  |
| ROCKET COS INC-CLASS A       | 986,009   | 14.73    | 14,523,912.57  |
| S&P GLOBAL INC               | 347,826   | 402.35   | 139,947,791.10 |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 1,908,731 | 91.39    | 174,438,926.09 |
| SOFI TECHNOLOGIES INC        | 1,473,848 | 17.31    | 25,512,308.88  |
| STATE STREET CORP            | 317,271   | 168.87   | 53,577,553.77  |
| SYNCHRONY FINANCIAL          | 393,816   | 76.32    | 30,056,037.12  |
| T ROWE PRICE GROUP INC       | 253,900   | 105.20   | 26,710,280.00  |
| TOAST INC-CLASS A            | 553,736   | 26.02    | 14,408,210.72  |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | 126,976   | 96.05    | 12,196,044.80  |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 1,939,533 | 332.23   | 644,371,048.59 |
| AFLAC INC                    | 532,448   | 117.75   | 62,695,752.00  |
| ALLSTATE CORP                | 296,156   | 233.54   | 69,164,272.24  |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 623,368   | 76.14    | 47,463,239.52  |
| AON PLC-CLASS A              | 237,128   | 325.48   | 77,180,421.44  |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       | 398,272   | 94.92    | 37,803,978.24  |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      | 294,483   | 220.76   | 65,010,067.08  |
| BROWN & BROWN INC            | 321,421   | 61.80    | 19,863,817.80  |
| CHUBB LTD                    | 404,820   | 335.15   | 135,675,423.00 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    | 176,052   | 178.45   | 31,416,479.40  |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A  | 27,458    | 229.53   | 6,302,434.74   |

|                              |           |          |                  |
|------------------------------|-----------|----------|------------------|
| EVEREST GROUP LTD            | 44,411    | 345.74   | 15,354,659.14    |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL  | 290,693   | 46.34    | 13,470,713.62    |
| HARTFORD INSURANCE GROUP INC | 324,318   | 132.32   | 42,913,757.76    |
| LOEWS CORP                   | 203,213   | 111.92   | 22,743,598.96    |
| MARKEL GROUP INC             | 14,202    | 1,900.36 | 26,988,912.72    |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 555,855   | 165.96   | 92,249,695.80    |
| METLIFE INC                  | 632,330   | 84.60    | 53,495,118.00    |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 248,236   | 106.70   | 26,486,781.20    |
| PROGRESSIVE CORP             | 677,365   | 220.50   | 149,358,982.50   |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 397,641   | 106.26   | 42,253,332.66    |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 243,115   | 320.74   | 77,976,705.10    |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 110,465   | 261.50   | 28,886,597.50    |
| WR BERKLEY CORP              | 245,212   | 70.05    | 17,177,100.60    |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 705,455   | 129.15   | 91,109,513.25    |
| ADOBE INC                    | 461,711   | 196.57   | 90,758,531.27    |
| APLOVIN CORP-CLASS A         | 263,012   | 464.96   | 122,290,059.52   |
| ATLASSIAN CORP-CL A          | 200,489   | 81.55    | 16,349,877.95    |
| AUTODESK INC                 | 241,946   | 192.61   | 46,601,219.06    |
| CADENCE DESIGN SYS INC       | 319,480   | 372.40   | 118,974,352.00   |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    | 94,046    | 124.68   | 11,725,655.28    |
| CIRCLE INTERNET GROUP INC    | 167,180   | 70.98    | 11,866,436.40    |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A     | 360,472   | 223.48   | 80,558,282.56    |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 552,448   | 41.44    | 22,893,445.12    |
| COREWEAVE INC-CL A           | 316,608   | 100.88   | 31,939,415.04    |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 285,405   | 673.02   | 192,083,273.10   |
| DATADOG INC - CLASS A        | 362,423   | 222.65   | 80,693,480.95    |
| FAIR ISAAC CORP              | 26,722    | 1,140.34 | 30,472,165.48    |
| FORTINET INC                 | 727,844   | 145.28   | 105,741,176.32   |
| GEN DIGITAL INC              | 634,196   | 23.56    | 14,941,657.76    |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP  | 1,083,188 | 262.96   | 284,835,116.48   |
| INTUIT INC                   | 321,377   | 262.23   | 84,276,297.59    |
| IREN LTD                     | 367,981   | 50.30    | 18,509,444.30    |
| MICROSOFT CORP               | 8,139,973 | 365.46   | 2,974,834,532.58 |
| MONGODB INC                  | 89,477    | 302.44   | 27,061,423.88    |
| NEBIUS GROUP NV              | 232,536   | 259.66   | 60,380,297.76    |
| OKTA INC                     | 192,824   | 118.58   | 22,865,069.92    |
| ORACLE CORP                  | 1,992,700 | 157.53   | 313,910,031.00   |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A  | 2,515,271 | 113.50   | 285,483,258.50   |
| PALO ALTO NETWORKS INC       | 937,113   | 285.26   | 267,320,854.38   |
| PTC INC                      | 139,508   | 112.93   | 15,754,638.44    |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       | 116,910   | 331.60   | 38,767,356.00    |
| SALESFORCE INC               | 916,449   | 152.76   | 139,996,749.24   |

|                             |            |        |                  |
|-----------------------------|------------|--------|------------------|
| SAMSARA INC-CL A            | 380,547    | 31.24  | 11,888,288.28    |
| SERVICENOW INC              | 1,214,729  | 93.80  | 113,941,580.20   |
| SNOWFLAKE INC               | 381,317    | 225.95 | 86,158,576.15    |
| STRATEGY INC                | 305,210    | 94.13  | 28,729,417.30    |
| SYNOPSYS INC                | 210,848    | 463.93 | 97,818,712.64    |
| TRIMBLE INC                 | 260,030    | 50.14  | 13,037,904.20    |
| TWILIO INC - A              | 166,387    | 188.34 | 31,337,327.58    |
| TYLER TECHNOLOGIES INC      | 51,867     | 286.03 | 14,835,518.01    |
| VERISIGN INC                | 94,796     | 252.08 | 23,896,175.68    |
| WORKDAY INC-CLASS A         | 246,095    | 118.09 | 29,061,358.55    |
| ZOOM COMMUNICATIONS INC     | 272,666    | 85.47  | 23,304,763.02    |
| ZSCALER INC                 | 123,779    | 127.27 | 15,753,353.33    |
| AMPHENOL CORP-CL A          | 1,420,826  | 162.78 | 231,282,056.28   |
| APPLE INC                   | 16,940,148 | 293.08 | 4,964,818,575.84 |
| ARISTA NETWORKS INC         | 1,234,756  | 161.74 | 199,709,435.44   |
| CDW CORP/DE                 | 149,952    | 130.22 | 19,526,749.44    |
| CIENA CORP                  | 161,328    | 463.51 | 74,777,141.28    |
| CISCO SYSTEMS INC           | 4,561,484  | 119.73 | 546,146,479.32   |
| COHERENT CORP               | 215,424    | 392.50 | 84,553,920.00    |
| CORNING INC                 | 919,721    | 205.83 | 189,306,173.43   |
| DELL TECHNOLOGIES -C        | 348,629    | 434.06 | 151,325,903.74   |
| EVERPURE INC-A              | 352,678    | 72.80  | 25,674,958.40    |
| F5 INC                      | 65,605     | 384.78 | 25,243,491.90    |
| FABRINET                    | 40,186     | 568.17 | 22,832,479.62    |
| FLEX LTD                    | 419,304    | 150.72 | 63,197,498.88    |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE  | 1,514,505  | 48.75  | 73,832,118.75    |
| HP INC                      | 1,061,894  | 23.29  | 24,731,511.26    |
| IONQ INC                    | 381,354    | 53.60  | 20,440,574.40    |
| JABIL INC                   | 121,722    | 371.80 | 45,256,239.60    |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN    | 199,371    | 351.30 | 70,039,032.30    |
| LUMENTUM HOLDINGS INC       | 81,542     | 842.53 | 68,701,581.26    |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC      | 192,670    | 400.60 | 77,183,602.00    |
| NETAPP INC                  | 228,323    | 155.56 | 35,517,925.88    |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS | 252,400    | 993.25 | 250,696,300.00   |
| SUPER MICRO COMPUTER INC    | 661,905    | 32.45  | 21,478,817.25    |
| TE CONNECTIVITY PLC         | 340,210    | 198.55 | 67,548,695.50    |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC   | 53,232     | 612.17 | 32,587,033.44    |
| WESTERN DIGITAL CORP        | 399,896    | 643.83 | 257,465,041.68   |
| AST SPACEMOBILE INC         | 267,253    | 68.01  | 18,175,876.53    |
| AT&T INC                    | 8,067,556  | 22.37  | 180,471,227.72   |
| COMCAST CORP-CLASS A        | 4,102,103  | 22.64  | 92,871,611.92    |
| MILLICOM INTL CELLULAR S.A. | 103,666    | 87.52  | 9,072,848.32     |

|                              |           |        |                  |
|------------------------------|-----------|--------|------------------|
| T-MOBILE US INC              | 567,215   | 180.79 | 102,546,799.85   |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 4,826,325 | 45.68  | 220,466,526.00   |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 294,596   | 75.59  | 22,268,511.64    |
| AMEREN CORPORATION           | 313,380   | 113.32 | 35,512,221.60    |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 623,615   | 134.96 | 84,163,080.40    |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 227,715   | 129.64 | 29,520,972.60    |
| ATMOS ENERGY CORP            | 192,935   | 172.59 | 33,298,651.65    |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 754,229   | 43.86  | 33,080,483.94    |
| CMS ENERGY CORP              | 351,899   | 76.49  | 26,916,754.51    |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 431,676   | 110.72 | 47,795,166.72    |
| CONSTELLATION ENERGY         | 356,905   | 267.97 | 95,639,832.85    |
| DOMINION ENERGY INC          | 1,007,645 | 69.26  | 69,789,492.70    |
| DTE ENERGY COMPANY           | 241,528   | 151.10 | 36,494,880.80    |
| DUKE ENERGY CORP             | 898,299   | 126.53 | 113,661,772.47   |
| EDISON INTERNATIONAL         | 432,621   | 74.22  | 32,109,130.62    |
| ENTERGY CORP                 | 529,826   | 114.69 | 60,765,743.94    |
| EVERGY INC                   | 261,741   | 85.82  | 22,462,612.62    |
| EVERSOURCE ENERGY            | 435,024   | 71.71  | 31,195,571.04    |
| EXELON CORP                  | 1,196,423 | 46.90  | 56,112,238.70    |
| FIRSTENERGY CORP             | 640,670   | 47.82  | 30,636,839.40    |
| NEXTERA ENERGY INC           | 2,410,145 | 87.62  | 211,176,904.90   |
| NISOURCE INC                 | 544,543   | 47.63  | 25,936,583.09    |
| NRG ENERGY INC               | 229,214   | 142.21 | 32,596,522.94    |
| P G & E CORP                 | 2,537,587 | 17.12  | 43,443,489.44    |
| PPL CORP                     | 879,915   | 36.92  | 32,486,461.80    |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 582,599   | 81.95  | 47,743,988.05    |
| SEMPRA                       | 752,396   | 92.73  | 69,769,681.08    |
| SOUTHERN CO/THE              | 1,302,756 | 95.78  | 124,777,969.68   |
| VISTRA CORP                  | 387,159   | 162.87 | 63,056,586.33    |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 382,559   | 115.61 | 44,227,645.99    |
| XCEL ENERGY INC              | 723,719   | 81.47  | 58,961,386.93    |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 1,882,108 | 519.74 | 978,206,811.92   |
| ANALOG DEVICES INC           | 564,172   | 413.16 | 233,093,303.52   |
| APPLIED MATERIALS INC        | 916,581   | 588.97 | 539,838,711.57   |
| ASTERA LABS INC              | 156,550   | 399.92 | 62,607,476.00    |
| BROADCOM INC                 | 5,190,712 | 382.07 | 1,983,215,333.84 |
| CREDO TECHNOLOGY GROUP HOLDI | 193,097   | 268.99 | 51,941,162.03    |
| ENTEGRIS INC                 | 174,205   | 171.46 | 29,869,189.30    |
| FIRST SOLAR INC              | 119,028   | 248.36 | 29,561,794.08    |
| INTEL CORP                   | 5,072,297 | 131.65 | 667,767,900.05   |
| KLA CORP                     | 1,513,982 | 240.48 | 364,082,391.36   |
| LAM RESEARCH CORP            | 1,442,201 | 374.80 | 540,536,934.80   |

|       |                              |             |          |                                           |  |
|-------|------------------------------|-------------|----------|-------------------------------------------|--|
|       | MARVELL TECHNOLOGY INC       | 985,128     | 276.70   | 272,584,917.60                            |  |
|       | MICROCHIP TECHNOLOGY INC     | 614,600     | 92.48    | 56,838,208.00                             |  |
|       | MICRON TECHNOLOGY INC        | 1,301,705   | 1,048.51 | 1,364,850,709.55                          |  |
|       | MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 54,117      | 1,434.95 | 77,655,189.15                             |  |
|       | NVIDIA CORP                  | 26,638,420  | 199.00   | 5,301,045,580.00                          |  |
|       | NXP SEMICONDUCTORS NV        | 288,649     | 294.06   | 84,880,124.94                             |  |
|       | ON SEMICONDUCTOR             | 449,955     | 115.74   | 52,077,791.70                             |  |
|       | QNTITY ELECTRONICS INC       | 237,383     | 158.73   | 37,679,803.59                             |  |
|       | QUALCOMM INC                 | 1,232,619   | 197.41   | 243,331,316.79                            |  |
|       | TERADYNE INC                 | 181,774     | 427.20   | 77,653,852.80                             |  |
|       | TEXAS INSTRUMENTS INC        | 1,051,684   | 303.11   | 318,775,937.24                            |  |
|       | CBRE GROUP INC - A           | 335,572     | 133.94   | 44,946,513.68                             |  |
|       | COSTAR GROUP INC             | 463,106     | 29.81    | 13,805,189.86                             |  |
|       | HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | 1,140,400   | 7.29     | 8,313,516.00                              |  |
|       | アメリカドル 小計                    | 420,963,882 |          | 72,148,918,991.77<br>(11,675,138,071,248) |  |
| カナダドル | ARC RESOURCES LTD            | 666,600     | 29.94    | 19,958,004.00                             |  |
|       | CAMECO CORP                  | 495,400     | 151.73   | 75,167,042.00                             |  |
|       | CANADIAN NATURAL RESOURCES   | 2,427,971   | 56.06    | 136,112,054.26                            |  |
|       | CENOVUS ENERGY INC           | 1,525,472   | 35.09    | 53,528,812.48                             |  |
|       | ENBRIDGE INC                 | 2,505,741   | 78.80    | 197,452,390.80                            |  |
|       | IMPERIAL OIL LTD             | 162,344     | 160.39   | 26,038,354.16                             |  |
|       | KEYERA CORP                  | 349,900     | 57.34    | 20,063,266.00                             |  |
|       | PEMBINA PIPELINE CORP        | 656,432     | 66.15    | 43,422,976.80                             |  |
|       | SUNCOR ENERGY INC            | 1,361,461   | 77.55    | 105,581,300.55                            |  |
|       | TC ENERGY CORP               | 1,210,412   | 98.67    | 119,431,352.04                            |  |
|       | TOURMALINE OIL CORP          | 442,000     | 59.86    | 26,458,120.00                             |  |
|       | WHITECAP RESOURCES INC       | 1,383,956   | 14.98    | 20,731,660.88                             |  |
|       | AGNICO EAGLE MINES LTD       | 590,480     | 218.26   | 128,878,164.80                            |  |
|       | ALAMOS GOLD INC-CLASS A      | 463,400     | 42.78    | 19,824,252.00                             |  |
|       | BARRICK MINING CORP          | 1,943,420   | 51.86    | 100,785,761.20                            |  |
|       | CCL INDUSTRIES INC - CL B    | 177,900     | 91.47    | 16,272,513.00                             |  |
|       | EQUINOX GOLD CORP            | 885,965     | 13.31    | 11,792,194.15                             |  |
|       | FIRST QUANTUM MINERALS LTD   | 813,000     | 36.75    | 29,877,750.00                             |  |
|       | FRANCO-NEVADA CORP           | 220,405     | 299.01   | 65,903,299.05                             |  |
|       | IVANHOE MINES LTD-CL A       | 907,500     | 10.27    | 9,320,025.00                              |  |
|       | KINROSS GOLD CORP            | 1,380,473   | 33.70    | 46,521,940.10                             |  |
|       | LUNDIN GOLD INC              | 112,500     | 74.75    | 8,409,375.00                              |  |
|       | LUNDIN MINING CORP           | 815,000     | 32.84    | 26,764,600.00                             |  |
|       | LUNR ROYALTIES CORP          | 23,494      | 18.79    | 441,452.26                                |  |
|       | NUTRIEN LTD                  | 554,797     | 85.94    | 47,679,254.18                             |  |
|       | PAN AMERICAN SILVER CORP     | 481,800     | 63.15    | 30,425,670.00                             |  |

|                              |           |          |                |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| TECK RESOURCES LTD-CLS B     | 522,279   | 82.13    | 42,894,774.27  |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 529,100   | 160.52   | 84,931,132.00  |
| ATKINSREALIS GROUP INC       | 186,300   | 89.81    | 16,731,603.00  |
| BOMBARDIER INC-B             | 93,400    | 316.18   | 29,531,212.00  |
| CAE INC                      | 317,100   | 35.54    | 11,269,734.00  |
| STANTEC INC                  | 128,800   | 98.68    | 12,709,984.00  |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD      | 89,600    | 228.78   | 20,498,688.00  |
| WSP GLOBAL INC               | 151,100   | 174.74   | 26,403,214.00  |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR | 450,700   | 29.80    | 13,430,860.00  |
| GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT | 288,300   | 53.02    | 15,285,666.00  |
| RB GLOBAL INC                | 216,284   | 160.13   | 34,633,556.92  |
| THOMSON REUTERS CORP         | 150,053   | 115.25   | 17,293,608.25  |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     | 591,944   | 165.00   | 97,670,760.00  |
| CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY | 1,022,885 | 120.77   | 123,533,821.45 |
| TFI INTERNATIONAL INC        | 90,500    | 203.75   | 18,439,375.00  |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      | 301,400   | 91.20    | 27,487,680.00  |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        | 205,700   | 77.02    | 15,843,014.00  |
| RESTAURANT BRANDS INTERN     | 364,410   | 103.65   | 37,771,096.50  |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A   | 58,100    | 190.46   | 11,065,726.00  |
| DOLLARAMA INC                | 311,000   | 192.17   | 59,764,870.00  |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 793,457   | 93.76    | 74,394,528.32  |
| EMPIRE CO LTD 'A'            | 147,100   | 51.68    | 7,602,128.00   |
| LOBLAW COMPANIES LTD         | 632,700   | 66.20    | 41,884,740.00  |
| METRO INC/CN                 | 222,500   | 94.62    | 21,052,950.00  |
| WESTON (GEORGE) LTD          | 187,433   | 104.79   | 19,641,104.07  |
| SAPUTO INC                   | 278,100   | 42.07    | 11,699,667.00  |
| BANK OF MONTREAL             | 797,481   | 245.53   | 195,805,509.93 |
| BANK OF NOVA SCOTIA          | 1,414,211 | 121.48   | 171,798,352.28 |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  | 1,054,288 | 162.17   | 170,973,884.96 |
| NATIONAL BANK OF CANADA      | 444,480   | 224.09   | 99,603,523.20  |
| ROYAL BANK OF CANADA         | 1,614,393 | 288.03   | 464,993,615.79 |
| TORONTO-DOMINION BANK        | 1,913,284 | 169.29   | 323,899,848.36 |
| BROOKFIELD ASSET MGMT-A      | 375,349   | 63.90    | 23,984,801.10  |
| BROOKFIELD CORP              | 2,317,263 | 61.06    | 141,492,078.78 |
| IGM FINANCIAL INC            | 95,100    | 77.58    | 7,377,858.00   |
| TMX GROUP LTD                | 344,600   | 46.76    | 16,113,496.00  |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD  | 21,943    | 2,319.96 | 50,906,882.28  |
| GREAT-WEST LIFE CO INC       | 278,085   | 88.89    | 24,718,975.65  |
| IA FINANCIAL CORP INC        | 104,100   | 191.12   | 19,895,592.00  |
| INTACT FINANCIAL CORP        | 203,400   | 294.88   | 59,978,592.00  |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      | 1,956,100 | 56.55    | 110,617,455.00 |
| POWER CORP OF CANADA         | 623,743   | 86.71    | 54,084,755.53  |

|               |                             |            |          |                                       |  |
|---------------|-----------------------------|------------|----------|---------------------------------------|--|
|               | SUN LIFE FINANCIAL INC      | 643,483    | 110.02   | 70,795,999.66                         |  |
|               | CGI INC                     | 216,000    | 89.80    | 19,396,800.00                         |  |
|               | CONSTELLATION SOFTWARE INC  | 23,000     | 2,868.91 | 65,984,930.00                         |  |
|               | DESCARTES SYSTEMS GRP/THE   | 106,800    | 96.64    | 10,321,152.00                         |  |
|               | SHOPIFY INC - CLASS A       | 1,406,693  | 162.59   | 228,714,214.87                        |  |
|               | CELESTICA INC               | 132,485    | 515.77   | 68,331,788.45                         |  |
|               | BCE INC                     | 344,000    | 33.08    | 11,379,520.00                         |  |
|               | ROGERS COMMUNICATIONS INC-B | 429,578    | 50.48    | 21,685,097.44                         |  |
|               | TELUS CORP                  | 531,200    | 16.02    | 8,509,824.00                          |  |
|               | ALTAGAS LTD                 | 348,200    | 54.40    | 18,942,080.00                         |  |
|               | BROOKFIELD RENEWABLE CORP   | 151,750    | 53.61    | 8,135,317.50                          |  |
|               | CANADIAN UTILITIES LTD-A    | 140,900    | 52.59    | 7,409,931.00                          |  |
|               | EMERA INC                   | 371,500    | 75.31    | 27,977,665.00                         |  |
|               | FORTIS INC                  | 574,151    | 81.29    | 46,672,734.79                         |  |
|               | HYDRO ONE LTD               | 389,936    | 57.93    | 22,588,992.48                         |  |
|               | FIRSTSERVICE CORP           | 45,900     | 193.00   | 8,858,700.00                          |  |
|               | カナダドル 小計                    | 50,301,464 |          | 4,862,257,045.54<br>(552,546,890,655) |  |
| オーストラリア<br>ドル | SANTOS LTD                  | 3,771,548  | 7.24     | 27,306,007.52                         |  |
|               | WOODSIDE ENERGY GROUP LTD   | 2,182,621  | 28.24    | 61,637,217.04                         |  |
|               | BHP GROUP LTD               | 5,885,534  | 59.50    | 350,189,273.00                        |  |
|               | EVOLUTION MINING LTD        | 2,374,324  | 12.35    | 29,322,901.40                         |  |
|               | FORTESCUE LTD               | 1,843,104  | 19.25    | 35,479,752.00                         |  |
|               | LYNAS RARE EARTHS LTD       | 1,051,435  | 19.34    | 20,334,752.90                         |  |
|               | NORTHERN STAR RESOURCES LTD | 1,563,363  | 20.59    | 32,189,644.17                         |  |
|               | PLS GROUP LTD               | 3,538,690  | 5.66     | 20,028,985.40                         |  |
|               | RIO TINTO LTD               | 425,263    | 173.92   | 73,961,740.96                         |  |
|               | SOUTH32 LTD                 | 4,953,765  | 4.06     | 20,112,285.90                         |  |
|               | SGH LTD                     | 235,846    | 45.07    | 10,629,579.22                         |  |
|               | BRAMBLES LTD                | 1,582,202  | 19.07    | 30,172,592.14                         |  |
|               | COMPUTERSHARE LTD           | 618,200    | 37.17    | 22,978,494.00                         |  |
|               | QANTAS AIRWAYS LTD          | 751,244    | 10.29    | 7,730,300.76                          |  |
|               | TRANSURBAN GROUP            | 3,578,527  | 15.16    | 54,250,469.32                         |  |
|               | ARISTOCRAT LEISURE LTD      | 613,908    | 57.99    | 35,600,524.92                         |  |
|               | LOTTERY CORP LTD/THE        | 2,448,080  | 5.56     | 13,611,324.80                         |  |
|               | CAR GROUP LTD               | 429,765    | 26.19    | 11,255,545.35                         |  |
|               | REA GROUP LTD               | 60,861     | 131.58   | 8,008,090.38                          |  |
|               | WESFARMERS LTD              | 1,304,694  | 87.27    | 113,860,645.38                        |  |
|               | COLES GROUP LTD             | 1,519,765  | 23.77    | 36,124,814.05                         |  |
|               | WOOLWORTHS GROUP LTD        | 1,409,074  | 39.37    | 55,475,243.38                         |  |
|               | COCHLEAR LTD                | 90,073     | 113.45   | 10,218,781.85                         |  |
|               | PRO MEDICUS LTD             | 60,171     | 178.99   | 10,770,007.29                         |  |

|         |                              |            |        |                                       |  |
|---------|------------------------------|------------|--------|---------------------------------------|--|
|         | SIGMA HEALTHCARE LTD         | 5,666,163  | 2.73   | 15,468,624.99                         |  |
|         | SONIC HEALTHCARE LTD         | 499,073    | 19.86  | 9,911,589.78                          |  |
|         | CSL LTD                      | 571,056    | 114.99 | 65,665,729.44                         |  |
|         | ANZ GROUP HOLDINGS LTD       | 3,458,163  | 35.64  | 123,248,929.32                        |  |
|         | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 1,935,061  | 164.79 | 318,878,702.19                        |  |
|         | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD  | 3,560,635  | 38.75  | 137,974,606.25                        |  |
|         | WESTPAC BANKING CORP         | 3,972,515  | 35.78  | 142,136,586.70                        |  |
|         | ASX LTD                      | 213,842    | 51.28  | 10,965,817.76                         |  |
|         | MACQUARIE GROUP LTD          | 423,963    | 250.12 | 106,041,625.56                        |  |
|         | WASHINGTON H SOUL PATTINSON  | 414,058    | 45.15  | 18,694,718.70                         |  |
|         | INSURANCE AUSTRALIA GROUP    | 2,506,185  | 7.87   | 19,723,675.95                         |  |
|         | MEDIBANK PRIVATE LTD         | 3,169,380  | 4.86   | 15,403,186.80                         |  |
|         | QBE INSURANCE GROUP LTD      | 1,735,074  | 24.56  | 42,613,417.44                         |  |
|         | SUNCORP GROUP LTD            | 1,216,148  | 18.93  | 23,021,681.64                         |  |
|         | WISETECH GLOBAL LTD          | 202,587    | 32.86  | 6,657,008.82                          |  |
|         | XERO LTD                     | 188,789    | 70.31  | 13,273,754.59                         |  |
|         | TELSTRA GROUP LTD            | 4,473,405  | 5.11   | 22,859,099.55                         |  |
|         | APA GROUP                    | 1,515,794  | 10.44  | 15,824,889.36                         |  |
|         | ORIGIN ENERGY LTD            | 1,917,126  | 10.80  | 20,704,960.80                         |  |
|         | オーストラリアドル 小計                 | 79,931,074 |        | 2,220,317,578.77<br>(247,720,832,263) |  |
| イギリスポンド | BP PLC                       | 18,237,103 | 4.80   | 87,547,212.95                         |  |
|         | SHELL PLC                    | 6,485,000  | 29.46  | 191,080,525.00                        |  |
|         | ANGLO AMERICAN PLC           | 1,238,563  | 36.12  | 44,736,895.56                         |  |
|         | ANTOFAGASTA PLC              | 388,716    | 36.50  | 14,188,134.00                         |  |
|         | ENDEAVOUR MINING PLC         | 255,448    | 37.54  | 9,589,517.92                          |  |
|         | FRESNILLO PLC                | 226,142    | 27.73  | 6,270,917.66                          |  |
|         | GLENCORE PLC                 | 10,891,083 | 5.21   | 56,818,780.01                         |  |
|         | RIO TINTO PLC                | 1,235,279  | 71.63  | 88,483,034.77                         |  |
|         | BAE SYSTEMS PLC              | 3,432,281  | 18.24  | 62,621,966.84                         |  |
|         | BUNZL PLC                    | 369,274    | 26.76  | 9,881,772.24                          |  |
|         | MELROSE INDUSTRIES PLC       | 1,394,061  | 4.77   | 6,660,823.45                          |  |
|         | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC     | 9,658,047  | 14.19  | 137,067,003.02                        |  |
|         | SMITHS GROUP PLC             | 333,676    | 25.90  | 8,642,208.40                          |  |
|         | SPIRAX GROUP PLC             | 86,277     | 68.90  | 5,944,485.30                          |  |
|         | SUNBELT RENTALS HOLDINGS INC | 474,310    | 55.28  | 26,219,856.80                         |  |
|         | EXPERIAN PLC                 | 1,047,300  | 25.51  | 26,716,623.00                         |  |
|         | INTERTEK GROUP PLC           | 175,050    | 58.00  | 10,152,900.00                         |  |
|         | RELX PLC                     | 2,039,809  | 23.78  | 48,506,658.02                         |  |
|         | RENTOKIL INITIAL PLC         | 2,938,030  | 4.39   | 12,918,517.91                         |  |
|         | PEARSON PLC                  | 520,147    | 11.46  | 5,960,884.62                          |  |
|         | INFORMA PLC                  | 1,456,954  | 8.85   | 12,902,784.62                         |  |

|                              |             |        |                  |
|------------------------------|-------------|--------|------------------|
| KINGFISHER PLC               | 1,974,497   | 2.88   | 5,694,449.34     |
| NEXT PLC                     | 136,567     | 146.55 | 20,013,893.85    |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC    | 2,443,444   | 3.77   | 9,231,331.43     |
| SAINSBURY (J) PLC            | 2,110,289   | 3.11   | 6,581,991.39     |
| TESCO PLC                    | 7,331,279   | 4.56   | 33,452,626.07    |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 361,819     | 19.56  | 7,078,988.73     |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 2,299,330   | 46.78  | 107,562,657.40   |
| COCA-COLA HBC AG-DI          | 226,501     | 48.16  | 10,908,288.16    |
| DIAGEO PLC                   | 2,559,909   | 15.80  | 40,446,562.20    |
| IMPERIAL BRANDS PLC          | 846,148     | 27.79  | 23,514,452.92    |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 739,280     | 47.78  | 35,322,798.40    |
| UNILEVER PLC                 | 2,502,499   | 45.44  | 113,713,554.56   |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 938,176     | 11.52  | 10,812,478.40    |
| ASTRAZENECA PLC              | 1,746,791   | 139.10 | 242,978,628.10   |
| GSK PLC                      | 4,695,234   | 19.50  | 91,557,063.00    |
| HALEON PLC                   | 10,201,993  | 3.48   | 35,502,935.64    |
| BARCLAYS PLC                 | 15,870,621  | 5.07   | 80,495,789.71    |
| HSBC HOLDINGS PLC            | 19,837,021  | 14.29  | 283,550,378.17   |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 67,928,227  | 1.07   | 73,192,664.59    |
| NATWEST GROUP PLC            | 9,247,796   | 6.47   | 59,833,240.12    |
| STANDARD CHARTERED PLC       | 2,048,021   | 20.33  | 41,636,266.93    |
| 3I GROUP PLC                 | 1,121,869   | 22.73  | 25,500,082.37    |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  | 510,919     | 82.80  | 42,304,093.20    |
| M&G PLC                      | 2,533,219   | 3.32   | 8,433,086.05     |
| SCHRODERS PLC                | 900,715     | 5.85   | 5,269,182.75     |
| WISE GROUP PLC-CL A          | 847,120     | 8.38   | 7,105,642.56     |
| ADMIRAL GROUP PLC            | 288,653     | 34.60  | 9,987,393.80     |
| AVIVA PLC                    | 3,560,734   | 6.42   | 22,874,155.21    |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC    | 6,070,972   | 2.86   | 17,369,050.89    |
| PRUDENTIAL PLC               | 2,956,174   | 9.97   | 29,478,967.12    |
| STANDARD LIFE PLC            | 733,696     | 8.26   | 6,063,997.44     |
| SAGE GROUP PLC/THE           | 1,000,239   | 8.08   | 8,085,932.07     |
| HALMA PLC                    | 417,964     | 39.18  | 16,375,829.52    |
| AIRTEL AFRICA PLC            | 939,887     | 3.40   | 3,203,134.89     |
| BT GROUP PLC                 | 6,508,884   | 1.96   | 12,760,667.08    |
| VODAFONE GROUP PLC           | 21,482,100  | 1.05   | 22,685,097.60    |
| CENTRICA PLC                 | 5,173,956   | 1.73   | 8,984,574.59     |
| NATIONAL GRID PLC            | 5,708,246   | 12.41  | 70,839,332.86    |
| SEVERN TRENT PLC             | 339,682     | 29.34  | 9,966,269.88     |
| SSE PLC                      | 1,410,645   | 23.48  | 33,121,944.60    |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 865,575     | 13.25  | 11,468,868.75    |
|                              | 282,299,241 |        | 2,577,869,844.43 |

| イギリスポンド 小計 |                              |            |           | (549,137,834,260) |  |
|------------|------------------------------|------------|-----------|-------------------|--|
| スイスフラン     | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    | 7,009      | 707.50    | 4,958,867.50      |  |
|            | GIVAUDAN-REG                 | 10,821     | 3,423.00  | 37,040,283.00     |  |
|            | HOLCIM LTD                   | 582,535    | 74.64     | 43,480,412.40     |  |
|            | SIKA AG-REG                  | 176,229    | 164.75    | 29,033,727.75     |  |
|            | ABB LTD-REG                  | 1,810,946  | 86.58     | 156,791,704.68    |  |
|            | BELIMO HOLDING AG-REG        | 10,873     | 928.00    | 10,090,144.00     |  |
|            | GEBERIT AG-REG               | 37,118     | 536.20    | 19,902,671.60     |  |
|            | SCHINDLER HOLDING AG-REG     | 25,722     | 258.50    | 6,649,137.00      |  |
|            | SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 45,900     | 266.40    | 12,227,760.00     |  |
|            | VAT GROUP AG                 | 31,465     | 665.60    | 20,943,104.00     |  |
|            | SGS SA-REG                   | 194,425    | 93.20     | 18,120,410.00     |  |
|            | KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG   | 55,206     | 190.40    | 10,511,222.40     |  |
|            | CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 622,910    | 185.50    | 115,549,805.00    |  |
|            | SWATCH GROUP AG/THE-BR       | 31,735     | 202.90    | 6,439,031.50      |  |
|            | AVOLTA AG                    | 102,803    | 54.25     | 5,577,062.75      |  |
|            | BARRY CALLEBAUT AG-REG       | 4,351      | 1,182.00  | 5,142,882.00      |  |
|            | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   | 1,092      | 9,725.00  | 10,619,700.00     |  |
|            | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG  | 109        | 98,800.00 | 10,769,200.00     |  |
|            | NESTLE SA-REG                | 2,973,480  | 82.89     | 246,471,757.20    |  |
|            | ALCON INC                    | 575,870    | 55.38     | 31,891,680.60     |  |
|            | SONOVA HOLDING AG-REG        | 55,377     | 193.90    | 10,737,600.30     |  |
|            | STRAUMANN HOLDING AG-REG     | 131,310    | 104.90    | 13,774,419.00     |  |
|            | GALDERMA GROUP AG            | 211,028    | 183.55    | 38,734,189.40     |  |
|            | LONZA GROUP AG-REG           | 80,871     | 528.40    | 42,732,236.40     |  |
|            | NOVARTIS AG-REG              | 2,113,917  | 124.34    | 262,844,439.78    |  |
|            | ROCHE HOLDING AG             | 812,011    | 332.00    | 269,587,652.00    |  |
|            | ROCHE HOLDING AG-BR          | 33,285     | 339.40    | 11,296,929.00     |  |
|            | SANDOZ GROUP AG              | 478,091    | 72.30     | 34,565,979.30     |  |
|            | BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | 28,971     | 117.90    | 3,415,680.90      |  |
|            | JULIUS BAER GROUP LTD        | 246,161    | 65.54     | 16,133,391.94     |  |
|            | PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 24,872     | 649.00    | 16,141,928.00     |  |
|            | UBS GROUP AG-REG             | 3,671,119  | 40.36     | 148,166,362.84    |  |
|            | HELVETIA BALOISE HOLDING AG  | 86,754     | 209.80    | 18,200,989.20     |  |
|            | SWISS LIFE HOLDING AG-REG    | 32,482     | 880.60    | 28,603,649.20     |  |
|            | SWISS RE AG                  | 346,355    | 126.65    | 43,865,860.75     |  |
|            | ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 173,465    | 585.20    | 101,511,718.00    |  |
|            | LOGITECH INTERNATIONAL-REG   | 172,041    | 83.94     | 14,441,121.54     |  |
|            | SWISSCOM AG-REG              | 30,640     | 639.50    | 19,594,280.00     |  |
|            | BKW AG                       | 19,842     | 136.20    | 2,702,480.40      |  |
|            | SWISS PRIME SITE-REG         | 90,072     | 132.30    | 11,916,525.60     |  |
|            |                              | 16,139,263 |           | 1,911,177,996.93  |  |

| スイスフラン 小計   |                              |            |        | (380,591,986,308)                    |  |
|-------------|------------------------------|------------|--------|--------------------------------------|--|
| 香港ドル        | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    | 3,108,368  | 67.75  | 210,591,932.00                       |  |
|             | SWIRE PACIFIC LTD - CL A     | 367,500    | 81.45  | 29,932,875.00                        |  |
|             | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 1,592,500  | 121.30 | 193,170,250.00                       |  |
|             | MTR CORP                     | 1,922,500  | 31.02  | 59,635,950.00                        |  |
|             | SITC INTERNATIONAL HOLDINGS  | 1,521,000  | 31.70  | 48,215,700.00                        |  |
|             | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 2,387,000  | 30.02  | 71,657,740.00                        |  |
|             | SANDS CHINA LTD              | 2,452,400  | 13.26  | 32,518,824.00                        |  |
|             | WH GROUP LTD                 | 9,227,500  | 8.58   | 79,171,950.00                        |  |
|             | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD   | 4,212,500  | 46.52  | 195,965,500.00                       |  |
|             | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR  | 1,398,800  | 371.20 | 519,234,560.00                       |  |
|             | AIA GROUP LTD                | 12,070,200 | 73.65  | 888,970,230.00                       |  |
|             | HKT TRUST AND HKT LTD-SS     | 4,072,000  | 11.80  | 48,049,600.00                        |  |
|             | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 649,500    | 59.15  | 38,417,925.00                        |  |
|             | CLP HOLDINGS LTD             | 1,824,000  | 74.35  | 135,614,400.00                       |  |
|             | HONG KONG & CHINA GAS        | 12,581,348 | 6.72   | 84,546,658.56                        |  |
|             | POWER ASSETS HOLDINGS LTD    | 1,522,000  | 58.20  | 88,580,400.00                        |  |
|             | CK ASSET HOLDINGS LTD        | 1,904,368  | 44.66  | 85,049,074.88                        |  |
|             | HENDERSON LAND DEVELOPMENT   | 1,659,641  | 25.32  | 42,022,110.12                        |  |
|             | SINO LAND CO                 | 4,353,400  | 10.56  | 45,971,904.00                        |  |
|             | SUN HUNG KAI PROPERTIES      | 1,554,500  | 113.70 | 176,746,650.00                       |  |
|             | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 1,962,000  | 21.70  | 42,575,400.00                        |  |
| 香港ドル 小計     |                              | 72,343,025 |        | 3,116,639,633.56<br>(64,327,442,036) |  |
| シンガポールドル    | KEPPEL LTD                   | 1,663,100  | 11.20  | 18,626,720.00                        |  |
|             | SINGAPORE TECH ENGINEERING   | 1,753,100  | 10.68  | 18,723,108.00                        |  |
|             | YANGZIJIAN SHIPBUILDING      | 2,752,800  | 3.53   | 9,717,384.00                         |  |
|             | SINGAPORE AIRLINES LTD       | 1,695,040  | 7.50   | 12,712,800.00                        |  |
|             | WILMAR INTERNATIONAL LTD     | 1,739,100  | 3.70   | 6,434,670.00                         |  |
|             | DBS GROUP HOLDINGS LTD       | 2,364,530  | 66.22  | 156,579,176.60                       |  |
|             | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 3,811,300  | 24.95  | 95,091,935.00                        |  |
|             | UNITED OVERSEAS BANK LTD     | 1,390,200  | 39.90  | 55,468,980.00                        |  |
|             | SINGAPORE EXCHANGE LTD       | 956,800    | 23.78  | 22,752,704.00                        |  |
|             | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 8,751,060  | 4.41   | 38,592,174.60                        |  |
|             | SEMBCORP INDUSTRIES LTD      | 1,049,300  | 6.47   | 6,788,971.00                         |  |
|             | CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI | 2,698,800  | 2.51   | 6,773,988.00                         |  |
| シンガポールドル 小計 |                              | 30,625,130 |        | 448,262,611.20<br>(55,907,312,868)   |  |
| ニュージーランドドル  | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    | 1,867,075  | 8.40   | 15,683,430.00                        |  |
|             | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 656,304    | 37.50  | 24,611,400.00                        |  |
|             | INFRATIL LTD                 | 981,938    | 15.18  | 14,905,818.84                        |  |
|             | CONTACT ENERGY LTD           | 1,246,775  | 9.42   | 11,744,620.50                        |  |

|                |                              |           |        |                                  |  |
|----------------|------------------------------|-----------|--------|----------------------------------|--|
|                | MERIDIAN ENERGY LTD          | 1,493,675 | 5.85   | 8,737,998.75                     |  |
|                | ニュージーランドドル 小計                | 6,245,767 |        | 75,683,268.09<br>(6,913,666,540) |  |
| スウェーデンク<br>ローネ | BOLIDEN AB                   | 318,607   | 530.40 | 168,989,152.80                   |  |
|                | SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B   | 611,369   | 100.80 | 61,625,995.20                    |  |
|                | ADDTECH AB-B SHARES          | 277,600   | 330.00 | 91,608,000.00                    |  |
|                | ALFA LAVAL AB                | 343,014   | 557.20 | 191,127,400.80                   |  |
|                | ASSA ABLOY AB-B              | 1,109,814 | 340.00 | 377,336,760.00                   |  |
|                | ATLAS COPCO AB-A SHS         | 2,910,579 | 190.15 | 553,446,596.85                   |  |
|                | ATLAS COPCO AB-B SHS         | 1,759,672 | 167.50 | 294,745,060.00                   |  |
|                | BEIJER REF AB                | 442,549   | 135.70 | 60,053,899.30                    |  |
|                | EPIROC AB-A                  | 740,994   | 258.30 | 191,398,750.20                   |  |
|                | EPIROC AB-B                  | 406,058   | 217.60 | 88,358,220.80                    |  |
|                | INDUTRADE AB                 | 286,975   | 189.60 | 54,410,460.00                    |  |
|                | INVESTMENT AB LATOUR-B SHS   | 137,810   | 192.55 | 26,535,315.50                    |  |
|                | LIFCO AB-B SHS               | 246,558   | 317.20 | 78,208,197.60                    |  |
|                | NIBE INDUSTRIER AB-B SHS     | 1,565,192 | 35.92  | 56,221,696.64                    |  |
|                | SAAB AB-B                    | 371,645   | 491.00 | 182,477,695.00                   |  |
|                | SANDVIK AB                   | 1,213,233 | 386.90 | 469,399,847.70                   |  |
|                | SKANSKA AB-B SHS             | 379,976   | 257.70 | 97,919,815.20                    |  |
|                | SKF AB-B SHARES              | 409,365   | 248.40 | 101,686,266.00                   |  |
|                | TRELLEBORG AB-B SHS          | 221,976   | 417.60 | 92,697,177.60                    |  |
|                | VOLVO AB-B SHS               | 1,784,625 | 318.20 | 567,867,675.00                   |  |
|                | SECURITAS AB-B SHS           | 559,465   | 155.10 | 86,773,021.50                    |  |
|                | EVOLUTION AB                 | 140,948   | 675.40 | 95,196,279.20                    |  |
|                | HENNES & MAURITZ AB-B SHS    | 475,149   | 168.70 | 80,157,636.30                    |  |
|                | ESSITY AKTIEBOLAG-B          | 642,986   | 275.90 | 177,399,837.40                   |  |
|                | SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB  | 211,949   | 471.20 | 99,870,368.80                    |  |
|                | SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 1,656,423 | 190.15 | 314,968,833.45                   |  |
|                | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 1,638,211 | 140.20 | 229,677,182.20                   |  |
|                | SWEDBANK AB - A SHARES       | 948,061   | 353.00 | 334,665,533.00                   |  |
|                | EQT AB                       | 489,510   | 261.90 | 128,202,669.00                   |  |
|                | INDUSTRIVARDEN AB-A SHS      | 121,044   | 528.50 | 63,971,754.00                    |  |
|                | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS      | 176,669   | 514.40 | 90,878,533.60                    |  |
|                | INVESTOR AB-B SHS            | 2,028,695 | 392.00 | 795,248,440.00                   |  |
|                | LUNDBERGS AB-B SHS           | 91,909    | 552.00 | 50,733,768.00                    |  |
|                | OCTAVE INTELLIGENCE PLC-SDR  | 226,727   | 156.00 | 35,369,412.00                    |  |
|                | ERICSSON LM-B SHS            | 3,058,939 | 109.10 | 333,730,244.90                   |  |
|                | HEXAGON AB-B SHS             | 2,425,453 | 80.38  | 194,957,912.14                   |  |
|                | TELE2 AB-B SHS               | 681,221   | 174.10 | 118,600,576.10                   |  |
|                | TELIA CO AB                  | 2,640,195 | 48.71  | 128,603,898.45                   |  |
|                | FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS  | 681,238   | 51.06  | 34,784,012.28                    |  |

|               |                             |            |           |                                       |  |
|---------------|-----------------------------|------------|-----------|---------------------------------------|--|
|               | SAGAX AB-B                  | 226,840    | 146.20    | 33,164,008.00                         |  |
| スウェーデンクローネ 小計 |                             | 34,659,243 |           | 7,233,067,902.51<br>(119,996,596,502) |  |
| ノルウェーク<br>ローネ | AKER BP ASA                 | 388,766    | 307.10    | 119,390,038.60                        |  |
|               | EQUINOR ASA                 | 784,444    | 311.10    | 244,040,528.40                        |  |
|               | VAR ENERGI ASA              | 1,077,396  | 41.19     | 44,377,941.24                         |  |
|               | NORSK HYDRO ASA             | 1,499,374  | 91.56     | 137,282,683.44                        |  |
|               | YARA INTERNATIONAL ASA      | 185,989    | 441.00    | 82,021,149.00                         |  |
|               | KONGSBERG GRUPPEN ASA       | 463,895    | 290.80    | 134,900,666.00                        |  |
|               | MOWI ASA                    | 518,107    | 197.10    | 102,118,889.70                        |  |
|               | ORKLA ASA                   | 786,872    | 103.80    | 81,677,313.60                         |  |
|               | SALMAR ASA                  | 78,781     | 544.00    | 42,856,864.00                         |  |
|               | DNB BANK ASA                | 914,676    | 293.40    | 268,365,938.40                        |  |
|               | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA   | 200,024    | 263.20    | 52,646,316.80                         |  |
|               | TELENOR ASA                 | 742,457    | 144.10    | 106,988,053.70                        |  |
| ノルウェークローネ 小計  |                             | 7,640,781  |           | 1,416,666,382.88<br>(23,275,828,670)  |  |
| デンマークク<br>ローネ | NOVONESIS (NOVOZYMES) B     | 408,600    | 414.00    | 169,160,400.00                        |  |
|               | ROCKWOOL A/S-B SHS          | 133,053    | 220.20    | 29,298,270.60                         |  |
|               | VESTAS WIND SYSTEMS A/S     | 1,073,631  | 170.85    | 183,429,856.35                        |  |
|               | AP MOLLER-MAERSK A/S-A      | 2,917      | 15,600.00 | 45,505,200.00                         |  |
|               | AP MOLLER-MAERSK A/S-B      | 3,592      | 16,060.00 | 57,687,520.00                         |  |
|               | DSV A/S                     | 221,759    | 1,550.50  | 343,837,329.50                        |  |
|               | PANDORA A/S                 | 80,435     | 688.60    | 55,387,541.00                         |  |
|               | CARLSBERG AS-B              | 106,513    | 876.60    | 93,369,295.80                         |  |
|               | COLOPLAST-B                 | 132,156    | 379.00    | 50,087,124.00                         |  |
|               | DEMANT A/S                  | 124,063    | 261.40    | 32,430,068.20                         |  |
|               | GENMAB A/S                  | 67,435     | 1,706.00  | 115,044,110.00                        |  |
|               | NOVO NORDISK A/S-B          | 3,727,685  | 311.55    | 1,161,360,261.75                      |  |
|               | DANSKE BANK A/S             | 727,186    | 346.30    | 251,824,511.80                        |  |
|               | TRYG A/S                    | 343,618    | 150.00    | 51,542,700.00                         |  |
|               | ORSTED A/S                  | 521,650    | 147.30    | 76,839,045.00                         |  |
| デンマーククローネ 小計  |                             | 7,674,293  |           | 2,716,803,234.00<br>(66,779,023,491)  |  |
| イスラエルシェ<br>ケル | ICL GROUP LTD               | 824,953    | 15.33     | 12,646,529.49                         |  |
|               | ELBIT SYSTEMS LTD           | 31,330     | 2,300.70  | 72,080,931.00                         |  |
|               | BANK HAPOLIM BM             | 1,514,252  | 68.94     | 104,392,532.88                        |  |
|               | BANK LEUMI LE-ISRAEL        | 1,707,109  | 66.40     | 113,352,037.60                        |  |
|               | ISRAEL DISCOUNT BANK-A      | 1,391,880  | 28.74     | 40,002,631.20                         |  |
|               | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD    | 177,702    | 195.50    | 34,740,741.00                         |  |
|               | HAREL INSURANCE INVESTMENTS | 131,563    | 163.50    | 21,510,550.50                         |  |
|               | PHOENIX FINANCIAL LTD       | 280,968    | 167.40    | 47,034,043.20                         |  |

|     |                              |           |          |                                    |  |
|-----|------------------------------|-----------|----------|------------------------------------|--|
|     | ENLIGHT RENEWABLE ENERGY LTD | 156,794   | 273.70   | 42,914,517.80                      |  |
|     | OPC ENERGY LTD               | 189,000   | 100.00   | 18,900,000.00                      |  |
|     | NOVA LTD                     | 35,018    | 1,563.40 | 54,747,141.20                      |  |
|     | TOWER SEMICONDUCTOR LTD      | 130,446   | 821.80   | 107,200,522.80                     |  |
|     | AZRIELI GROUP LTD            | 50,975    | 406.80   | 20,736,630.00                      |  |
|     | イスラエルシェケル 小計                 | 6,621,990 |          | 690,258,808.67<br>(37,412,648,662) |  |
| ユーロ | BOLLORE SE                   | 863,382   | 4.05     | 3,496,697.10                       |  |
|     | ENI SPA                      | 2,095,086 | 20.79    | 43,567,313.37                      |  |
|     | GALP ENERGIA SGPS SA         | 482,766   | 18.35    | 8,858,756.10                       |  |
|     | NESTE OYJ                    | 506,582   | 26.33    | 13,338,304.06                      |  |
|     | OMV AG                       | 170,206   | 54.75    | 9,318,778.50                       |  |
|     | REPSOL SA                    | 1,276,982 | 21.02    | 26,842,161.64                      |  |
|     | TENARIS SA                   | 388,546   | 24.84    | 9,651,482.64                       |  |
|     | TOTALENERGIES SE             | 2,280,061 | 69.51    | 158,487,040.11                     |  |
|     | AIR LIQUIDE SA               | 739,100   | 169.76   | 125,469,616.00                     |  |
|     | AKZO NOBEL N.V.              | 178,947   | 60.82    | 10,883,556.54                      |  |
|     | ARCELORMITTAL                | 489,970   | 54.22    | 26,566,173.40                      |  |
|     | BASF SE                      | 1,025,751 | 48.89    | 50,148,966.39                      |  |
|     | BUZZI SPA                    | 99,377    | 45.57    | 4,528,609.89                       |  |
|     | DSM-FIRMENICH AG             | 194,652   | 80.98    | 15,762,918.96                      |  |
|     | EVONIK INDUSTRIES AG         | 281,967   | 16.09    | 4,536,849.03                       |  |
|     | HEIDELBERG MATERIALS AG      | 150,026   | 184.15   | 27,627,287.90                      |  |
|     | STORA ENSO OYJ-R SHS         | 643,783   | 9.43     | 6,076,023.95                       |  |
|     | SYENSQO SA                   | 73,212    | 65.20    | 4,773,422.40                       |  |
|     | SYMRISE AG                   | 148,638   | 89.30    | 13,273,373.40                      |  |
|     | UPM-KYMMENE OYJ              | 632,797   | 23.59    | 14,927,681.23                      |  |
|     | ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV  | 200,467   | 129.90   | 26,040,663.30                      |  |
|     | AIRBUS SE                    | 682,534   | 195.10   | 133,162,383.40                     |  |
|     | ALSTOM                       | 418,187   | 15.90    | 6,651,264.23                       |  |
|     | BOUYGUES SA                  | 245,750   | 49.54    | 12,174,455.00                      |  |
|     | BRENNTAG SE                  | 138,321   | 54.80    | 7,579,990.80                       |  |
|     | COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN    | 511,348   | 79.84    | 40,826,024.32                      |  |
|     | CSG NV                       | 205,000   | 12.78    | 2,620,720.00                       |  |
|     | DAIMLER TRUCK HOLDING AG     | 529,665   | 40.84    | 21,631,518.60                      |  |
|     | DASSAULT AVIATION SA         | 19,803    | 295.00   | 5,841,885.00                       |  |
|     | EIFFAGE                      | 76,571    | 129.15   | 9,889,144.65                       |  |
|     | FERROVIAL NV                 | 560,470   | 61.84    | 34,659,464.80                      |  |
|     | GEA GROUP AG                 | 178,210   | 59.50    | 10,603,495.00                      |  |
|     | HENSOLDT AG                  | 69,250    | 68.96    | 4,775,480.00                       |  |
|     | HOCHTIEF AG                  | 17,500    | 509.50   | 8,916,250.00                       |  |
|     | KINGSPAN GROUP PLC           | 183,214   | 83.90    | 15,371,654.60                      |  |

|                              |           |          |                |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| KNORR-BREMSE AG              | 81,581    | 101.30   | 8,264,155.30   |
| KONE OYJ-B                   | 366,752   | 48.68    | 17,853,487.36  |
| LEGRAND SA                   | 295,683   | 145.75   | 43,095,797.25  |
| LEONARDO SPA                 | 457,645   | 48.03    | 21,980,689.35  |
| METSO CORP                   | 699,882   | 14.77    | 10,337,257.14  |
| MTU AERO ENGINES AG          | 63,002    | 357.90   | 22,548,415.80  |
| PRYSMIAN SPA                 | 320,198   | 147.90   | 47,357,284.20  |
| RATIONAL AG                  | 4,758     | 654.50   | 3,114,111.00   |
| REXEL SA                     | 248,175   | 36.85    | 9,145,248.75   |
| RHEINMETALL AG               | 54,355    | 949.00   | 51,582,895.00  |
| SAFRAN SA                    | 397,439   | 338.40   | 134,493,357.60 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE        | 634,398   | 280.50   | 177,948,639.00 |
| SIEMENS AG-REG               | 858,025   | 271.40   | 232,867,985.00 |
| SIEMENS ENERGY AG            | 897,410   | 159.86   | 143,459,962.60 |
| THALES SA                    | 104,595   | 225.30   | 23,565,253.50  |
| VINCI SA                     | 532,906   | 129.15   | 68,824,809.90  |
| WARTSILA OYJ ABP             | 564,329   | 32.23    | 18,188,323.67  |
| BUREAU VERITAS SA            | 383,396   | 26.29    | 10,079,480.84  |
| VERISURE PLC                 | 276,907   | 10.33    | 2,860,449.31   |
| WOLTERS KLUWER               | 252,003   | 56.26    | 14,177,688.78  |
| ADP                          | 41,102    | 114.30   | 4,697,958.60   |
| AENA SME SA                  | 871,393   | 27.22    | 23,719,317.46  |
| AYVENS SA                    | 367,054   | 11.50    | 4,221,121.00   |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       | 757,660   | 9.60     | 7,273,536.00   |
| DHL GROUP                    | 1,049,725 | 51.18    | 53,724,925.50  |
| GETLINK SE                   | 321,945   | 18.80    | 6,052,566.00   |
| INPOST SA                    | 285,051   | 15.38    | 4,384,084.38   |
| INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI | 1,291,254 | 5.56     | 7,189,702.27   |
| RYANAIR HOLDINGS PLC         | 473,623   | 27.08    | 12,825,710.84  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG  | 330,460   | 60.90    | 20,125,014.00  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 60,408    | 60.80    | 3,672,806.40   |
| CONTINENTAL AG               | 120,177   | 73.62    | 8,847,430.74   |
| DR ING HC F PORSCHE AG       | 123,394   | 45.08    | 5,562,601.52   |
| FERRARI NV                   | 139,906   | 307.50   | 43,021,095.00  |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG       | 823,011   | 44.40    | 36,545,803.45  |
| MICHELIN (CGDE)              | 727,307   | 33.57    | 24,415,695.99  |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF   | 186,269   | 29.67    | 5,526,601.23   |
| RENAULT SA                   | 234,955   | 26.61    | 6,252,152.55   |
| STELLANTIS NV                | 2,250,219 | 5.17     | 11,647,133.54  |
| VOLKSWAGEN AG-PREF           | 238,636   | 76.02    | 18,141,108.72  |
| ADIDAS AG                    | 190,062   | 176.00   | 33,450,912.00  |
| HERMES INTERNATIONAL         | 29,899    | 1,629.00 | 48,705,471.00  |

|                              |           |           |                |
|------------------------------|-----------|-----------|----------------|
| KERING                       | 79,841    | 265.35    | 21,185,809.35  |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 288,052   | 493.00    | 142,009,636.00 |
| MONCLER SPA                  | 253,339   | 51.24     | 12,981,090.36  |
| ACCOR SA                     | 228,307   | 50.04     | 11,424,482.28  |
| AMADEUS IT GROUP SA          | 521,167   | 52.18     | 27,194,494.06  |
| DELIVERY HERO SE             | 203,561   | 35.20     | 7,165,347.20   |
| SODEXO SA                    | 98,730    | 51.25     | 5,059,912.50   |
| CTS EVENTIM AG & CO KGAA     | 67,951    | 50.35     | 3,421,332.85   |
| PUBLICIS GROUPE              | 265,201   | 88.08     | 23,358,904.08  |
| SCOUT24 SE                   | 91,708    | 73.95     | 6,781,806.60   |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP NV     | 1,132,045 | 18.35     | 20,773,025.75  |
| D'IETEREN GROUP              | 28,050    | 167.30    | 4,692,765.00   |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL   | 1,248,453 | 55.78     | 69,638,708.34  |
| PROSUS NV                    | 1,499,839 | 38.42     | 57,623,814.38  |
| ZALANDO SE                   | 221,160   | 26.37     | 5,831,989.20   |
| CARREFOUR SA                 | 670,299   | 16.28     | 10,912,467.72  |
| JERONIMO MARTINS             | 342,275   | 17.50     | 5,989,812.50   |
| KESKO OYJ-B SHS              | 300,623   | 19.92     | 5,988,410.16   |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 1,008,548 | 35.26     | 35,561,402.48  |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV   | 1,029,287 | 74.44     | 76,620,124.28  |
| DANONE                       | 736,240   | 69.54     | 51,198,129.60  |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV     | 629,249   | 5.48      | 3,450,801.51   |
| HEINEKEN HOLDING NV          | 138,696   | 67.50     | 9,361,980.00   |
| HEINEKEN NV                  | 330,831   | 74.56     | 24,666,759.36  |
| KERRY GROUP PLC-A            | 190,312   | 80.90     | 15,396,240.80  |
| LOTUS BAKERIES               | 459       | 11,300.00 | 5,186,700.00   |
| MAGNUM ICE CREAM CO NV/THE   | 530,087   | 15.00     | 7,951,305.00   |
| PERNOD RICARD SA             | 237,347   | 66.24     | 15,721,865.28  |
| BEIERSDORF AG                | 104,394   | 73.96     | 7,720,980.24   |
| HENKEL AG & CO KGAA          | 111,818   | 68.65     | 7,676,305.70   |
| HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF | 178,547   | 72.76     | 12,991,079.72  |
| L'OREAL                      | 278,174   | 386.65    | 107,555,977.10 |
| BIOMERIEUX                   | 39,327    | 68.15     | 2,680,135.05   |
| ESSILORLUXOTTICA             | 345,011   | 168.60    | 58,168,854.60  |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG    | 229,315   | 42.15     | 9,665,627.25   |
| FRESENIUS SE & CO KGAA       | 486,283   | 40.07     | 19,485,359.81  |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       | 895,016   | 23.64     | 21,158,178.24  |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG      | 365,167   | 34.23     | 12,499,666.41  |
| ABIVAX SA                    | 56,500    | 80.70     | 4,559,550.00   |
| ARGENX SE                    | 72,267    | 748.60    | 54,099,076.20  |
| BAYER AG-REG                 | 1,117,480 | 39.59     | 44,241,033.20  |
| EUROFINS SCIENTIFIC          | 122,947   | 67.02     | 8,239,907.94   |

|                              |            |        |                |
|------------------------------|------------|--------|----------------|
| FINANCIERE DE TUBIZE         | 22,650     | 217.60 | 4,928,640.00   |
| IPSEN                        | 41,013     | 163.50 | 6,705,625.50   |
| MERCK KGAA                   | 149,504    | 140.10 | 20,945,510.40  |
| ORION OYJ-CLASS B            | 130,403    | 69.55  | 9,069,528.65   |
| QIAGEN N.V.                  | 257,124    | 34.00  | 8,743,501.62   |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA  | 141,463    | 51.55  | 7,292,417.65   |
| SANOFI                       | 1,265,019  | 73.55  | 93,042,147.45  |
| SARTORIUS AG-VORZUG          | 31,572     | 219.40 | 6,926,896.80   |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH     | 29,810     | 169.20 | 5,043,852.00   |
| UCB SA                       | 139,297    | 255.00 | 35,520,735.00  |
| ABN AMRO BANK NV-CVA         | 736,180    | 36.63  | 26,966,273.40  |
| AIB GROUP PLC                | 2,460,953  | 10.38  | 25,544,692.14  |
| BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA | 2,178,858  | 10.88  | 23,723,405.90  |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 6,521,519  | 21.32  | 139,038,785.08 |
| BANCO BPM SPA                | 1,356,307  | 15.30  | 20,758,278.63  |
| BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R  | 8,745,104  | 1.02   | 8,954,986.49   |
| BANCO DE SABADELL SA         | 5,317,285  | 3.08   | 16,409,141.51  |
| BANCO SANTANDER SA           | 16,568,763 | 11.86  | 196,538,666.70 |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC    | 1,058,600  | 17.74  | 18,779,564.00  |
| BANKINTER SA                 | 766,255    | 14.49  | 11,103,034.95  |
| BAWAG GROUP AG               | 82,341     | 170.30 | 14,022,672.30  |
| BNP PARIBAS                  | 1,150,736  | 101.46 | 116,753,674.56 |
| BPER BANCA SPA               | 1,767,991  | 13.62  | 24,080,037.42  |
| CAIXABANK SA                 | 4,024,988  | 12.37  | 49,789,101.56  |
| COMMERZBANK AG               | 728,319    | 37.38  | 27,224,564.22  |
| CREDIT AGRICOLE SA           | 1,013,104  | 17.54  | 17,769,844.16  |
| ERSTE GROUP BANK AG          | 352,695    | 115.10 | 40,595,194.50  |
| FINECOBANK SPA               | 737,899    | 22.47  | 16,580,590.53  |
| ING GROEP NV                 | 3,390,633  | 27.46  | 93,123,735.34  |
| INTESA SANPAOLO              | 16,014,425 | 6.09   | 97,575,891.52  |
| KBC GROUP NV                 | 266,996    | 116.80 | 31,185,132.80  |
| NORDEA BANK ABP              | 3,515,166  | 16.22  | 57,015,992.52  |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA | 144,841    | 54.50  | 7,893,834.50   |
| SOCIETE GENERALE SA          | 732,560    | 76.02  | 55,689,211.20  |
| UNICREDIT SPA                | 1,558,954  | 77.76  | 121,224,263.04 |
| ADYEN NV                     | 31,988     | 844.00 | 26,997,872.00  |
| AMUNDI SA                    | 63,272     | 82.95  | 5,248,412.40   |
| BANCA MEDIOLANUM SPA         | 236,796    | 21.95  | 5,197,672.20   |
| CVC CAPITAL PARTNERS PLC     | 208,300    | 12.53  | 2,609,999.00   |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED  | 2,110,787  | 30.16  | 63,661,335.92  |
| DEUTSCHE BOERSE AG           | 211,790    | 244.80 | 51,846,192.00  |
| EURONEXT NV                  | 88,348     | 142.60 | 12,598,424.80  |

|                             |           |        |                |
|-----------------------------|-----------|--------|----------------|
| EXOR NV                     | 94,876    | 65.20  | 6,185,915.20   |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV | 78,320    | 79.70  | 6,242,104.00   |
| POSTE ITALIANE SPA          | 527,076   | 28.23  | 14,879,355.48  |
| SOFINA                      | 15,696    | 221.00 | 3,468,816.00   |
| AEGON LTD                   | 1,427,510 | 7.42   | 10,600,689.26  |
| AGEAS                       | 168,958   | 68.90  | 11,641,206.20  |
| ALLIANZ SE-REG              | 440,102   | 404.50 | 178,021,259.00 |
| ASR NEDERLAND NV            | 181,218   | 66.06  | 11,971,261.08  |
| AXA SA                      | 1,799,447 | 42.80  | 77,016,331.60  |
| GENERALI                    | 949,540   | 42.53  | 40,383,936.20  |
| HANNOVER RUECK SE           | 71,555    | 238.00 | 17,030,090.00  |
| MAPFRE SA                   | 1,048,939 | 4.28   | 4,493,654.67   |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG  | 149,880   | 479.50 | 71,867,460.00  |
| NN GROUP NV                 | 300,987   | 75.90  | 22,844,913.30  |
| SAMPO OYJ-A SHS             | 2,776,621 | 9.01   | 25,017,355.21  |
| TALANX AG                   | 67,511    | 107.00 | 7,223,677.00   |
| UNIPOL ASSICURAZIONI SPA    | 399,193   | 24.06  | 9,604,583.58   |
| CAPGEMINI SE                | 179,516   | 89.00  | 15,976,924.00  |
| DASSAULT SYSTEMES SE        | 749,925   | 17.39  | 13,041,195.75  |
| INDRA SISTEMAS SA           | 81,808    | 51.10  | 4,180,388.80   |
| NEMETSCHEK SE               | 58,830    | 53.75  | 3,162,112.50   |
| SAP SE                      | 1,208,682 | 134.86 | 163,002,854.52 |
| NOKIA OYJ                   | 5,847,889 | 12.31  | 72,016,753.03  |
| CELLNEX TELECOM SA          | 570,070   | 29.00  | 16,532,030.00  |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG     | 3,938,840 | 26.44  | 104,142,929.60 |
| ELISA OYJ                   | 158,023   | 37.54  | 5,932,183.42   |
| KONINKLIJKE KPN NV          | 4,307,148 | 4.44   | 19,149,580.00  |
| ORANGE                      | 2,211,730 | 16.89  | 37,356,119.70  |
| TELECOM ITALIA SPA          | 1,998,386 | 7.95   | 15,891,165.47  |
| TELEFONICA SA               | 4,237,944 | 3.67   | 15,591,395.97  |
| ACCIONA SA                  | 29,664    | 272.00 | 8,068,608.00   |
| E.ON SE                     | 2,576,959 | 17.61  | 45,393,132.78  |
| EDP RENEWABLES SA           | 355,556   | 13.29  | 4,725,339.24   |
| EDP SA                      | 3,498,065 | 4.38   | 15,335,516.96  |
| ELIA GROUP SA/NV            | 51,883    | 134.80 | 6,993,828.40   |
| ENDESA SA                   | 345,111   | 38.77  | 13,379,953.47  |
| ENEL SPA                    | 8,832,335 | 9.86   | 87,148,649.44  |
| ENGIE                       | 2,041,482 | 26.50  | 54,099,273.00  |
| FORTUM OYJ                  | 504,356   | 19.25  | 9,711,374.78   |
| IBERDROLA SA                | 7,033,247 | 21.15  | 148,753,174.05 |
| ITALGAS SPA                 | 790,413   | 10.33  | 8,164,966.29   |
| NATURGY ENERGY GROUP SA     | 483,899   | 27.54  | 13,326,578.46  |

|                              |               |          |                                            |  |
|------------------------------|---------------|----------|--------------------------------------------|--|
| REDEIA CORP SA               | 441,610       | 15.30    | 6,756,633.00                               |  |
| RWE AG                       | 669,260       | 54.52    | 36,488,055.20                              |  |
| SNAM SPA                     | 2,248,725     | 6.28     | 14,139,982.80                              |  |
| TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA | 1,565,017     | 10.16    | 15,908,397.80                              |  |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT         | 690,862       | 35.63    | 24,615,413.06                              |  |
| VERBUND AG                   | 74,711        | 54.75    | 4,090,427.25                               |  |
| ASM INTERNATIONAL NV         | 53,493        | 969.20   | 51,845,415.60                              |  |
| ASML HOLDING NV              | 448,223       | 1,553.80 | 696,448,897.40                             |  |
| BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES  | 80,220        | 292.90   | 23,496,438.00                              |  |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG     | 1,499,519     | 79.56    | 119,301,731.64                             |  |
| STMICROELECTRONICS NV        | 722,065       | 63.36    | 45,750,038.40                              |  |
| VONOVIA SE                   | 837,876       | 20.79    | 17,419,442.04                              |  |
| ユーロ 小計                       | 210,210,352   |          | 7,529,067,133.91<br>(1,383,164,923,170)    |  |
| 合 計                          | 1,225,655,505 |          | 15,162,913,056,673<br>(15,162,913,056,673) |  |

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

## (2)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 通貨         | 種 類  | 銘 柄                          | 口数        | 評価額            | 備考 |
|------------|------|------------------------------|-----------|----------------|----|
| アメリカ<br>ドル | 投資証券 | AMERICAN TOWER CORP          | 541,661   | 94,498,178.06  |    |
|            |      | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 165,712   | 30,424,723.20  |    |
|            |      | CROWN CASTLE INC             | 503,747   | 41,377,778.58  |    |
|            |      | DIGITAL REALTY TRUST INC     | 393,769   | 76,005,292.38  |    |
|            |      | EQUINIX INC                  | 113,070   | 123,811,650.00 |    |
|            |      | EQUITY RESIDENTIAL           | 396,605   | 26,263,183.10  |    |
|            |      | ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 73,559    | 20,717,892.35  |    |
|            |      | EXTRA SPACE STORAGE INC      | 251,166   | 36,635,072.76  |    |
|            |      | GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 296,833   | 13,467,313.21  |    |
|            |      | INVITATION HOMES INC         | 608,500   | 18,035,940.00  |    |
|            |      | IRON MOUNTAIN INC            | 343,385   | 44,842,647.15  |    |
|            |      | KIMCO REALTY CORP            | 801,444   | 20,372,706.48  |    |
|            |      | MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 136,466   | 18,343,759.72  |    |
|            |      | PROLOGIS INC                 | 1,079,678 | 152,094,239.86 |    |
|            |      | PUBLIC STORAGE               | 180,765   | 57,468,808.80  |    |
|            |      | REALTY INCOME CORP           | 1,079,645 | 66,927,193.55  |    |
|            |      | REGENCY CENTERS CORP         | 193,994   | 15,494,300.78  |    |
|            |      | SBA COMMUNICATIONS CORP      | 124,440   | 23,078,642.40  |    |
|            |      | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 373,172   | 82,900,159.80  |    |
|            |      | SUN COMMUNITIES INC          | 136,341   | 16,351,376.13  |    |
|            |      | VENTAS INC                   | 544,872   | 47,169,569.04  |    |

|             |      |                              |            |                                       |  |
|-------------|------|------------------------------|------------|---------------------------------------|--|
|             |      | VICI PROPERTIES INC          | 1,272,018  | 33,988,320.96                         |  |
|             |      | WELLTOWER INC                | 816,914    | 180,889,267.02                        |  |
|             |      | WEYERHAEUSER CO              | 865,123    | 21,887,611.90                         |  |
|             |      | WP CAREY INC                 | 243,662    | 17,697,171.06                         |  |
| アメリカドル合計    |      |                              | 11,536,541 | 1,280,742,798.29<br>(207,249,799,619) |  |
| オーストラリアドル   | 投資証券 | GOODMAN GROUP                | 2,310,023  | 73,528,032.09                         |  |
|             |      | SCENTRE GROUP                | 5,764,123  | 22,191,873.55                         |  |
|             |      | STOCKLAND                    | 2,911,872  | 12,142,506.24                         |  |
|             |      | VICINITY CENTRES             | 4,663,887  | 12,032,828.46                         |  |
| オーストラリアドル合計 |      |                              | 15,649,905 | 119,895,240.34<br>(13,376,711,964)    |  |
| イギリスポンド     | 投資証券 | LAND SECURITIES GROUP PLC    | 845,472    | 5,504,022.72                          |  |
|             |      | SEGRO PLC                    | 1,343,587  | 11,708,017.11                         |  |
| イギリスポンド合計   |      |                              | 2,189,059  | 17,212,039.83<br>(3,666,508,724)      |  |
| 香港ドル        | 投資証券 | LINK REIT                    | 2,874,900  | 102,058,950.00                        |  |
| 香港ドル合計      |      |                              | 2,874,900  | 102,058,950.00<br>(2,106,496,728)     |  |
| シンガポールドル    | 投資証券 | CAPITALAND ASCENDAS REIT     | 4,884,466  | 12,357,698.98                         |  |
|             |      | CAPITALAND INTEGRATED COMMER | 7,463,470  | 17,688,423.90                         |  |
| シンガポールドル合計  |      |                              | 12,347,936 | 30,046,122.88<br>(3,747,352,445)      |  |
| ユーロ         | 投資証券 | COVIVIO                      | 55,256     | 2,972,772.80                          |  |
|             |      | GECINA SA                    | 44,144     | 3,218,097.60                          |  |
|             |      | KLEPIERRE                    | 241,648    | 8,858,815.68                          |  |
|             |      | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    | 119,685    | 12,225,822.75                         |  |
| ユーロ合計       |      |                              | 460,733    | 27,275,508.83<br>(5,010,783,727)      |  |
| 合計          |      |                              |            | 235,157,653,207<br>(235,157,653,207)  |  |

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

| 種類        | 銘柄数       | 組入株式<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|-----------|-----------|--------------|----------------|-------------------------|
| アメリカドル    | 株式 514銘柄  | 98.26%       | —              | 75.82%                  |
|           | 投資証券 25銘柄 | —            | 1.74%          | 1.35%                   |
| カナダドル     | 株式 84銘柄   | 100.00%      | —              | 3.59%                   |
| オーストラリアドル | 株式 43銘柄   | 94.88%       | —              | 1.61%                   |
|           | 投資証券 4銘柄  | —            | 5.12%          | 0.09%                   |
| イギリスポンド   | 株式 62銘柄   | 99.34%       | —              | 3.57%                   |

|            |      |       |         |       |       |
|------------|------|-------|---------|-------|-------|
|            | 投資証券 | 2銘柄   | —       | 0.66% | 0.02% |
| スイスフラン     | 株式   | 40銘柄  | 100.00% | —     | 2.47% |
| 香港ドル       | 株式   | 21銘柄  | 96.83%  | —     | 0.42% |
|            | 投資証券 | 1銘柄   | —       | 3.17% | 0.01% |
| シンガポールドル   | 株式   | 12銘柄  | 93.72%  | —     | 0.36% |
|            | 投資証券 | 2銘柄   | —       | 6.28% | 0.02% |
| ニュージーランドドル | 株式   | 5銘柄   | 100.00% | —     | 0.04% |
| スウェーデンクローネ | 株式   | 40銘柄  | 100.00% | —     | 0.78% |
| ノルウェークローネ  | 株式   | 12銘柄  | 100.00% | —     | 0.15% |
| デンマーククローネ  | 株式   | 15銘柄  | 100.00% | —     | 0.43% |
| イスラエルシェケル  | 株式   | 13銘柄  | 100.00% | —     | 0.24% |
| ユーロ        | 株式   | 215銘柄 | 99.64%  | —     | 8.98% |
|            | 投資証券 | 4銘柄   | —       | 0.36% | 0.03% |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

## 国内債券インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

[2026年 6月25日現在]

|             |                 |
|-------------|-----------------|
| 資産の部        |                 |
| 流動資産        |                 |
| コール・ローン     | 579,869,958     |
| 国債証券        | 130,887,944,540 |
| 地方債証券       | 9,485,262,600   |
| 特殊債証券       | 5,901,978,333   |
| 社債券         | 8,686,144,000   |
| 未収利息        | 218,413,304     |
| 前払費用        | 56,678,888      |
| 流動資産合計      | 155,816,291,623 |
| 資産合計        | 155,816,291,623 |
| 負債の部        |                 |
| 流動負債        |                 |
| 未払金         | 6,891,331,100   |
| 未払解約金       | 55,210,148      |
| 流動負債合計      | 6,946,541,248   |
| 負債合計        | 6,946,541,248   |
| 純資産の部       |                 |
| 元本等         |                 |
| 元本          | 180,016,279,792 |
| 剰余金         |                 |
| 剰余金又は欠損金（△） | △31,146,529,417 |
| 元本等合計       | 148,869,750,375 |
| 純資産合計       | 148,869,750,375 |
| 負債純資産合計     | 155,816,291,623 |

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

|                                            | [2026年 6月25日現在]  |
|--------------------------------------------|------------------|
| 1. 期首                                      | 2025年 6月26日      |
| 期首元本額                                      | 158,298,291,884円 |
| 期中追加設定元本額                                  | 563,931,016,828円 |
| 期中一部解約元本額                                  | 542,213,028,920円 |
| 元本の内訳※                                     |                  |
| ファンド・マネジャー（国内債券）                           | 9,388,236,774円   |
| ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）                   | 10,753,754,246円  |
| ラップ向けダイナミックアロケーションファンド                     | 518,446,137円     |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド                      | 141,545,496円     |
| アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）                    | 837,451,527円     |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）                  | 4,637,001,855円   |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）                  | 514,990,972円     |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）                 | 162,557,752円     |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）             | 12,181,401,080円  |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）                  | 3,140,425,744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）    | 19,842,097,363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）   | 2,656,722,836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）          | 20,246,862,305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）    | 3,129,880,365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） | 91,168,445,180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）  | 696,460,160円     |
| 合計                                         | 180,016,279,792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。                | 31,146,529,417円  |
| 3. 受益権の総数                                  | 180,016,279,792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 2025年 6月26日<br>至 2026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。<br>当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用してあります。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。                                       |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。<br>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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                   | [2026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<br>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 |

| 区分                        | [2026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 | <p>(2) デリバティブ取引<br/>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品<br/>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。<br/>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。</p> |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種類    | [2026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  | △60,868,650        |
| 地方債証券 | 3,701,600          |
| 特殊債券  | △8,542,073         |
| 社債券   | 10,061,000         |
| 合計    | △55,648,123        |

(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）

|              | [2026年 6月25日現在] |
|--------------|-----------------|
| 1口当たり純資産額    | 0.8270円         |
| (1万口当たり純資産額) | (8,270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474回利付国債（2年） | 80,000,000    | 79,623,200    |    |
|      | 第475回利付国債（2年） | 660,000,000   | 657,921,000   |    |
|      | 第476回利付国債（2年） | 1,050,000,000 | 1,046,136,000 |    |
|      | 第478回利付国債（2年） | 3,330,000,000 | 3,318,278,400 |    |
|      | 第479回利付国債（2年） | 920,000,000   | 916,246,400   |    |
|      | 第480回利付国債（2年） | 1,800,000,000 | 1,794,240,000 |    |
|      | 第481回利付国債（2年） | 720,000,000   | 719,604,000   |    |
|      | 第482回利付国債（2年） | 670,000,000   | 669,443,900   |    |
|      | 第483回利付国債（2年） | 370,000,000   | 370,188,700   |    |
|      | 第484回利付国債（2年） | 1,000,000,000 | 1,000,180,000 |    |
|      | 第154回利付国債（5年） | 170,000,000   | 167,691,400   |    |

|                |               |               |  |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第１５７回利付国債（５年）  | 490,000,000   | 480,342,100   |  |
| 第１５８回利付国債（５年）  | 980,000,000   | 959,028,000   |  |
| 第１６０回利付国債（５年）  | 80,000,000    | 78,116,800    |  |
| 第１６１回利付国債（５年）  | 2,490,000,000 | 2,436,191,100 |  |
| 第１６３回利付国債（５年）  | 2,630,000,000 | 2,569,641,500 |  |
| 第１６６回利付国債（５年）  | 2,730,000,000 | 2,658,364,800 |  |
| 第１６７回利付国債（５年）  | 720,000,000   | 698,479,200   |  |
| 第１６９回利付国債（５年）  | 1,630,000,000 | 1,585,761,800 |  |
| 第１７０回利付国債（５年）  | 20,000,000    | 19,447,000    |  |
| 第１７１回利付国債（５年）  | 290,000,000   | 280,287,900   |  |
| 第１７２回利付国債（５年）  | 3,410,000,000 | 3,305,517,600 |  |
| 第１７３回利付国債（５年）  | 1,570,000,000 | 1,520,293,800 |  |
| 第１７４回利付国債（５年）  | 1,360,000,000 | 1,321,117,600 |  |
| 第１７７回利付国債（５年）  | 3,230,000,000 | 3,168,823,800 |  |
| 第１７８回利付国債（５年）  | 2,240,000,000 | 2,182,678,400 |  |
| 第１８０回利付国債（５年）  | 4,380,000,000 | 4,269,186,000 |  |
| 第１８１回利付国債（５年）  | 350,000,000   | 342,842,500   |  |
| 第１８２回利付国債（５年）  | 2,090,000,000 | 2,055,870,300 |  |
| 第１８３回利付国債（５年）  | 3,170,000,000 | 3,136,524,800 |  |
| 第１８４回利付国債（５年）  | 550,000,000   | 547,965,000   |  |
| 第１８５回利付国債（５年）  | 700,000,000   | 703,647,000   |  |
| 第２回利付国債（４０年）   | 250,000,000   | 194,110,000   |  |
| 第６回利付国債（４０年）   | 501,000,000   | 341,276,190   |  |
| 第８回利付国債（４０年）   | 230,000,000   | 134,023,300   |  |
| 第９回利付国債（４０年）   | 730,000,000   | 296,095,300   |  |
| 第１０回利付国債（４０年）  | 530,000,000   | 257,527,000   |  |
| 第１１回利付国債（４０年）  | 530,000,000   | 245,331,700   |  |
| 第１２回利付国債（４０年）  | 541,000,000   | 217,195,270   |  |
| 第１３回利付国債（４０年）  | 750,000,000   | 299,542,500   |  |
| 第１４回利付国債（４０年）  | 600,000,000   | 255,984,000   |  |
| 第１５回利付国債（４０年）  | 770,000,000   | 362,508,300   |  |
| 第１６回利付国債（４０年）  | 607,000,000   | 314,948,020   |  |
| 第１７回利付国債（４０年）  | 730,000,000   | 501,495,400   |  |
| 第１８回利付国債（４０年）  | 440,000,000   | 380,991,600   |  |
| 第３５０回利付国債（１０年） | 80,000,000    | 78,288,000    |  |
| 第３５４回利付国債（１０年） | 70,000,000    | 67,348,400    |  |
| 第３５５回利付国債（１０年） | 230,000,000   | 220,300,900   |  |
| 第３５６回利付国債（１０年） | 550,000,000   | 523,891,500   |  |
| 第３６１回利付国債（１０年） | 100,000,000   | 92,561,000    |  |
| 第３６２回利付国債（１０年） | 530,000,000   | 487,631,800   |  |
| 第３６３回利付国債（１０年） | 2,000,000,000 | 1,829,020,000 |  |
| 第３６４回利付国債（１０年） | 1,740,000,000 | 1,581,068,400 |  |

|                |               |               |  |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第３６５回利付国債（１０年） | 1,260,000,000 | 1,137,452,400 |  |
| 第３６６回利付国債（１０年） | 2,050,000,000 | 1,849,305,000 |  |
| 第３６７回利付国債（１０年） | 1,740,000,000 | 1,559,283,600 |  |
| 第３６８回利付国債（１０年） | 1,920,000,000 | 1,708,492,800 |  |
| 第３６９回利付国債（１０年） | 2,270,000,000 | 2,048,652,300 |  |
| 第３７０回利付国債（１０年） | 1,980,000,000 | 1,776,376,800 |  |
| 第３７１回利付国債（１０年） | 2,510,000,000 | 2,219,015,700 |  |
| 第３７２回利付国債（１０年） | 1,850,000,000 | 1,672,659,000 |  |
| 第３７３回利付国債（１０年） | 2,690,000,000 | 2,379,735,400 |  |
| 第３７４回利付国債（１０年） | 1,610,000,000 | 1,437,311,400 |  |
| 第３７５回利付国債（１０年） | 2,270,000,000 | 2,062,612,800 |  |
| 第３７６回利付国債（１０年） | 2,260,000,000 | 2,007,558,000 |  |
| 第３７７回利付国債（１０年） | 1,982,000,000 | 1,794,720,820 |  |
| 第３７８回利付国債（１０年） | 2,475,000,000 | 2,267,669,250 |  |
| 第３７９回利付国債（１０年） | 1,760,000,000 | 1,619,006,400 |  |
| 第３８０回利付国債（１０年） | 1,400,000,000 | 1,304,212,000 |  |
| 第３８１回利付国債（１０年） | 2,322,000,000 | 2,231,116,920 |  |
| 第３８２回利付国債（１０年） | 1,040,000,000 | 1,021,852,000 |  |
| 第５回利付国債（３０年）   | 50,000,000    | 50,694,500    |  |
| 第７回利付国債（３０年）   | 50,000,000    | 50,711,000    |  |
| 第１０回利付国債（３０年）  | 50,000,000    | 46,734,000    |  |
| 第１２回利付国債（３０年）  | 80,000,000    | 79,252,800    |  |
| 第１３回利付国債（３０年）  | 220,000,000   | 215,716,600   |  |
| 第１５回利付国債（３０年）  | 100,000,000   | 101,008,000   |  |
| 第１７回利付国債（３０年）  | 50,000,000    | 49,859,000    |  |
| 第１８回利付国債（３０年）  | 60,000,000    | 59,203,200    |  |
| 第２１回利付国債（３０年）  | 20,000,000    | 19,550,800    |  |
| 第２２回利付国債（３０年）  | 80,000,000    | 79,285,600    |  |
| 第２３回利付国債（３０年）  | 40,000,000    | 39,557,200    |  |
| 第２４回利付国債（３０年）  | 20,000,000    | 19,734,600    |  |
| 第２６回利付国債（３０年）  | 130,000,000   | 126,124,700   |  |
| 第２７回利付国債（３０年）  | 70,000,000    | 68,088,300    |  |
| 第３０回利付国債（３０年）  | 110,000,000   | 102,152,600   |  |
| 第３１回利付国債（３０年）  | 180,000,000   | 163,796,400   |  |
| 第３５回利付国債（３０年）  | 500,000,000   | 427,595,000   |  |
| 第３６回利付国債（３０年）  | 710,000,000   | 601,334,500   |  |
| 第３８回利付国債（３０年）  | 80,000,000    | 64,458,400    |  |
| 第３９回利付国債（３０年）  | 230,000,000   | 187,307,400   |  |
| 第４２回利付国債（３０年）  | 60,000,000    | 46,504,200    |  |
| 第４３回利付国債（３０年）  | 500,000,000   | 385,560,000   |  |
| 第４６回利付国債（３０年）  | 90,000,000    | 65,799,900    |  |
| 第４８回利付国債（３０年）  | 30,000,000    | 21,277,500    |  |

|               |             |             |  |
|---------------|-------------|-------------|--|
| 第５０回利付国債（３０年） | 490,000,000 | 301,933,100 |  |
| 第５１回利付国債（３０年） | 560,000,000 | 302,344,000 |  |
| 第５２回利付国債（３０年） | 520,000,000 | 292,874,400 |  |
| 第５３回利付国債（３０年） | 370,000,000 | 211,895,300 |  |
| 第５４回利付国債（３０年） | 450,000,000 | 268,537,500 |  |
| 第５５回利付国債（３０年） | 530,000,000 | 313,616,900 |  |
| 第５６回利付国債（３０年） | 420,000,000 | 246,565,200 |  |
| 第５７回利付国債（３０年） | 450,000,000 | 262,107,000 |  |
| 第５８回利付国債（３０年） | 790,000,000 | 456,311,900 |  |
| 第５９回利付国債（３０年） | 380,000,000 | 211,986,800 |  |
| 第６０回利付国債（３０年） | 340,000,000 | 198,549,800 |  |
| 第６１回利付国債（３０年） | 340,000,000 | 186,728,000 |  |
| 第６２回利付国債（３０年） | 420,000,000 | 216,043,800 |  |
| 第６３回利付国債（３０年） | 550,000,000 | 272,019,000 |  |
| 第６４回利付国債（３０年） | 420,000,000 | 205,921,800 |  |
| 第６５回利付国債（３０年） | 440,000,000 | 213,870,800 |  |
| 第６６回利付国債（３０年） | 630,000,000 | 303,288,300 |  |
| 第６７回利付国債（３０年） | 430,000,000 | 218,306,700 |  |
| 第６８回利付国債（３０年） | 450,000,000 | 226,341,000 |  |
| 第６９回利付国債（３０年） | 610,000,000 | 313,826,700 |  |
| 第７０回利付国債（３０年） | 840,000,000 | 428,274,000 |  |
| 第７１回利付国債（３０年） | 460,000,000 | 232,410,400 |  |
| 第７２回利付国債（３０年） | 470,000,000 | 235,441,800 |  |
| 第７３回利付国債（３０年） | 428,000,000 | 212,591,880 |  |
| 第７４回利付国債（３０年） | 830,000,000 | 450,308,200 |  |
| 第７５回利付国債（３０年） | 450,000,000 | 264,978,000 |  |
| 第７６回利付国債（３０年） | 460,000,000 | 277,255,800 |  |
| 第７７回利付国債（３０年） | 410,000,000 | 259,735,000 |  |
| 第７８回利付国債（３０年） | 370,000,000 | 221,152,700 |  |
| 第７９回利付国債（３０年） | 540,000,000 | 303,253,200 |  |
| 第８０回利付国債（３０年） | 400,000,000 | 263,956,000 |  |
| 第８１回利付国債（３０年） | 420,000,000 | 261,966,600 |  |
| 第８２回利付国債（３０年） | 900,000,000 | 590,031,000 |  |
| 第８３回利付国債（３０年） | 490,000,000 | 353,912,300 |  |
| 第８４回利付国債（３０年） | 380,000,000 | 267,421,200 |  |
| 第８５回利付国債（３０年） | 546,000,000 | 402,582,180 |  |
| 第８６回利付国債（３０年） | 580,000,000 | 437,238,800 |  |
| 第８７回利付国債（３０年） | 350,000,000 | 288,018,500 |  |
| 第８８回利付国債（３０年） | 320,000,000 | 285,692,800 |  |
| 第８９回利付国債（３０年） | 348,000,000 | 323,027,520 |  |
| 第９０回利付国債（３０年） | 150,000,000 | 147,391,500 |  |
| 第９７回利付国債（２０年） | 70,000,000  | 70,847,700  |  |

|                |               |               |  |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第９８回利付国債（２０年）  | 200,000,000   | 202,178,000   |  |
| 第１０５回利付国債（２０年） | 210,000,000   | 213,024,000   |  |
| 第１０６回利付国債（２０年） | 100,000,000   | 101,657,000   |  |
| 第１０７回利付国債（２０年） | 250,000,000   | 253,775,000   |  |
| 第１０９回利付国債（２０年） | 150,000,000   | 151,513,500   |  |
| 第１１０回利付国債（２０年） | 100,000,000   | 101,547,000   |  |
| 第１１１回利付国債（２０年） | 40,000,000    | 40,752,800    |  |
| 第１１４回利付国債（２０年） | 100,000,000   | 101,482,000   |  |
| 第１１５回利付国債（２０年） | 70,000,000    | 71,268,400    |  |
| 第１１６回利付国債（２０年） | 250,000,000   | 254,385,000   |  |
| 第１１９回利付国債（２０年） | 100,000,000   | 100,148,000   |  |
| 第１２２回利付国債（２０年） | 230,000,000   | 229,954,000   |  |
| 第１２５回利付国債（２０年） | 950,000,000   | 963,832,000   |  |
| 第１２８回利付国債（２０年） | 30,000,000    | 29,993,100    |  |
| 第１３１回利付国債（２０年） | 460,000,000   | 454,641,000   |  |
| 第１３３回利付国債（２０年） | 72,000,000    | 71,340,480    |  |
| 第１３５回利付国債（２０年） | 100,000,000   | 98,305,000    |  |
| 第１３６回利付国債（２０年） | 100,000,000   | 97,767,000    |  |
| 第１３８回利付国債（２０年） | 70,000,000    | 67,839,100    |  |
| 第１４０回利付国債（２０年） | 100,000,000   | 97,713,000    |  |
| 第１４２回利付国債（２０年） | 110,000,000   | 107,900,100   |  |
| 第１４４回利付国債（２０年） | 40,000,000    | 38,380,800    |  |
| 第１４６回利付国債（２０年） | 20,000,000    | 19,279,400    |  |
| 第１４８回利付国債（２０年） | 1,140,000,000 | 1,073,788,800 |  |
| 第１４９回利付国債（２０年） | 50,000,000    | 46,875,000    |  |
| 第１５０回利付国債（２０年） | 10,000,000    | 9,255,000     |  |
| 第１５１回利付国債（２０年） | 100,000,000   | 90,551,000    |  |
| 第１５３回利付国債（２０年） | 210,000,000   | 189,842,100   |  |
| 第１５４回利付国債（２０年） | 130,000,000   | 115,798,800   |  |
| 第１５５回利付国債（２０年） | 90,000,000    | 78,180,300    |  |
| 第１５６回利付国債（２０年） | 820,000,000   | 665,667,800   |  |
| 第１５７回利付国債（２０年） | 560,000,000   | 441,397,600   |  |
| 第１５８回利付国債（２０年） | 1,100,000,000 | 888,470,000   |  |
| 第１５９回利付国債（２０年） | 340,000,000   | 275,352,400   |  |
| 第１６０回利付国債（２０年） | 890,000,000   | 723,231,800   |  |
| 第１６１回利付国債（２０年） | 630,000,000   | 501,971,400   |  |
| 第１６２回利付国債（２０年） | 520,000,000   | 410,810,400   |  |
| 第１６３回利付国債（２０年） | 630,000,000   | 493,466,400   |  |
| 第１６４回利付国債（２０年） | 1,280,000,000 | 981,030,400   |  |
| 第１６５回利付国債（２０年） | 220,000,000   | 167,028,400   |  |
| 第１６６回利付国債（２０年） | 880,000,000   | 679,976,000   |  |
| 第１６７回利付国債（２０年） | 640,000,000   | 477,120,000   |  |

|         |                        |                 |                 |  |
|---------|------------------------|-----------------|-----------------|--|
|         | 第１６８回利付国債（２０年）         | 1,140,000,000   | 830,216,400     |  |
|         | 第１６９回利付国債（２０年）         | 670,000,000     | 476,055,100     |  |
|         | 第１７０回利付国債（２０年）         | 580,000,000     | 408,053,200     |  |
|         | 第１７１回利付国債（２０年）         | 510,000,000     | 355,281,300     |  |
|         | 第１７２回利付国債（２０年）         | 1,070,000,000   | 750,187,700     |  |
|         | 第１７３回利付国債（２０年）         | 840,000,000     | 583,464,000     |  |
|         | 第１７４回利付国債（２０年）         | 1,530,000,000   | 1,052,823,600   |  |
|         | 第１７５回利付国債（２０年）         | 750,000,000     | 519,982,500     |  |
|         | 第１７６回利付国債（２０年）         | 1,340,000,000   | 921,049,000     |  |
|         | 第１７７回利付国債（２０年）         | 560,000,000     | 374,813,600     |  |
|         | 第１７８回利付国債（２０年）         | 750,000,000     | 506,295,000     |  |
|         | 第１７９回利付国債（２０年）         | 650,000,000     | 434,746,000     |  |
|         | 第１８０回利付国債（２０年）         | 580,000,000     | 405,884,000     |  |
|         | 第１８１回利付国債（２０年）         | 650,000,000     | 459,355,000     |  |
|         | 第１８２回利付国債（２０年）         | 1,260,000,000   | 915,188,400     |  |
|         | 第１８３回利付国債（２０年）         | 580,000,000     | 440,249,000     |  |
|         | 第１８４回利付国債（２０年）         | 1,040,000,000   | 744,785,600     |  |
|         | 第１８５回利付国債（２０年）         | 910,000,000     | 647,037,300     |  |
|         | 第１８６回利付国債（２０年）         | 1,000,000,000   | 757,700,000     |  |
|         | 第１８７回利付国債（２０年）         | 870,000,000     | 632,542,200     |  |
|         | 第１８８回利付国債（２０年）         | 910,000,000     | 693,137,900     |  |
|         | 第１８９回利付国債（２０年）         | 380,000,000     | 303,027,200     |  |
|         | 第１９０回利付国債（２０年）         | 950,000,000     | 741,342,000     |  |
|         | 第１９１回利付国債（２０年）         | 935,000,000     | 751,440,800     |  |
|         | 第１９２回利付国債（２０年）         | 810,000,000     | 692,347,500     |  |
|         | 第１９３回利付国債（２０年）         | 860,000,000     | 744,502,000     |  |
|         | 第１９４回利付国債（２０年）         | 830,000,000     | 739,214,600     |  |
|         | 第１９５回利付国債（２０年）         | 797,000,000     | 763,549,910     |  |
|         | 第１９６回利付国債（２０年）         | 160,000,000     | 157,488,000     |  |
|         | 第３回スロベニア               | 200,000,000     | 197,984,000     |  |
| 国債証券 合計 |                        | 155,294,000,000 | 130,887,944,540 |  |
| 地方債証券   | 第８回東京都公募公債（３０年）        | 80,000,000      | 72,919,200      |  |
|         | 第８２５回東京都公募公債           | 300,000,000     | 271,026,000     |  |
|         | 平成２８年度第１０回北海道公募公債（２０年） | 200,000,000     | 158,410,000     |  |
|         | 令和４年度第９回北海道公募公債（５年）    | 300,000,000     | 294,951,000     |  |
|         | 令和６年度第１回北海道公募公債        | 100,000,000     | 88,327,000      |  |
|         | 第２９回神奈川県公募公債（２０年）      | 100,000,000     | 88,997,000      |  |
|         | 第１８回大阪府公募公債（２０年）       | 200,000,000     | 135,058,000     |  |
|         | 第４３０回大阪府公募公債           | 200,000,000     | 195,546,000     |  |
|         | 第４６９回大阪府公募公債           | 100,000,000     | 90,923,000      |  |
|         | 令和４年度第６回京都府公募公債（５年）    | 200,000,000     | 197,038,000     |  |
|         | 令和６年度第５回京都府公募公債（５年）    | 300,000,000     | 289,629,000     |  |

|          |                           |                |               |  |
|----------|---------------------------|----------------|---------------|--|
|          | 第３２回兵庫県公募公債（２０年）          | 100,000,000    | 78,728,000    |  |
|          | 令和４年度第３回兵庫県公募公債           | 400,000,000    | 357,480,000   |  |
|          | 第２０回静岡県公募公債（２０年）          | 200,000,000    | 174,210,000   |  |
|          | 平成２９年度第１４回愛知県公募公債         | 300,000,000    | 294,546,000   |  |
|          | 平成３０年度第１回広島県公募公債（２０年）     | 300,000,000    | 225,867,000   |  |
|          | 令和２年度第１回広島県公募公債（２０年）      | 200,000,000    | 134,446,000   |  |
|          | 令和４年度第２回広島県公募公債           | 200,000,000    | 178,940,000   |  |
|          | 第１５回埼玉県公募公債（２０年）          | 100,000,000    | 88,691,000    |  |
|          | 第１６回埼玉県公募公債（２０年）          | 200,000,000    | 176,068,000   |  |
|          | 平成２６年度第１回福岡県公募公債（２０年）     | 100,000,000    | 92,987,000    |  |
|          | 第２３回千葉県公募公債（２０年）          | 100,000,000    | 77,571,000    |  |
|          | 令和５年度第２回千葉県公募公債（５年）       | 300,000,000    | 293,598,000   |  |
|          | 令和６年度第１回千葉県公募公債           | 100,000,000    | 88,370,000    |  |
|          | 令和２年度第１回岐阜県公募公債           | 200,000,000    | 185,052,000   |  |
|          | 第１９２回共同発行市場公募地方債          | 300,000,000    | 288,045,000   |  |
|          | 第２２４回共同発行市場公募地方債          | 300,000,000    | 269,838,000   |  |
|          | 第２５３回共同発行市場公募地方債          | 100,000,000    | 88,279,000    |  |
|          | 令和３年度第１回鳥取県公募公債           | 400,000,000    | 358,596,000   |  |
|          | 平成２９年度第２回長崎県公募公債          | 200,000,000    | 197,010,000   |  |
|          | 令和７年度第１回島根県公募公債           | 400,000,000    | 370,360,000   |  |
|          | 平成２９年度第１回福島県公募公債          | 300,000,000    | 294,867,000   |  |
|          | 令和２年度第２回熊本県公募公債           | 400,000,000    | 370,120,000   |  |
|          | 令和５年度第１回奈良県公募公債（５年）       | 200,000,000    | 196,092,000   |  |
|          | 第１９回名古屋市公募公債（２０年）         | 200,000,000    | 157,754,000   |  |
|          | 第１３回京都市公募公債（２０年）          | 200,000,000    | 181,292,000   |  |
|          | 平成３０年度第３回京都市公募公債          | 200,000,000    | 194,080,000   |  |
|          | 平成２５年度第１回札幌市公募公債（２０年）     | 100,000,000    | 95,899,000    |  |
|          | 第６回川崎市公募公債（２０年）           | 100,000,000    | 101,538,000   |  |
|          | ２０２１年度第４回福岡市公募公債（２０年）     | 100,000,000    | 64,845,000    |  |
|          | 平成２９年度第２回広島市公募公債（２０年）     | 200,000,000    | 155,752,000   |  |
|          | 平成３０年度第６回広島市公募公債          | 300,000,000    | 288,423,000   |  |
|          | 平成３０年度第３回千葉市公募公債          | 110,000,000    | 106,550,400   |  |
|          | 令和４年度第８回千葉市公募公債           | 200,000,000    | 181,680,000   |  |
|          | 第１９回さいたま市公募公債             | 300,000,000    | 268,935,000   |  |
|          | 令和５年度第１回相模原市公募公債          | 100,000,000    | 89,943,000    |  |
|          | 平成２７年度第１回福井県公募公債（２０年）     | 100,000,000    | 88,732,000    |  |
|          | 平成３０年度第１回山梨県公募公債          | 300,000,000    | 291,096,000   |  |
|          | 令和２年度第２回岡山県公募公債           | 300,000,000    | 275,676,000   |  |
|          | 令和４年度第２回岡山県公募公債           | 200,000,000    | 180,482,000   |  |
| 地方債証券 合計 |                           | 10,490,000,000 | 9,485,262,600 |  |
| 特殊債券     | 第２６回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券 | 400,000,000    | 397,308,000   |  |
|          | 第７５回政府保証日本政策投資銀行          | 100,000,000    | 89,039,000    |  |

|                                   |             |             |  |
|-----------------------------------|-------------|-------------|--|
| 第 8 2 回日本政策投資銀行債券（財投機関債）          | 300,000,000 | 296,583,000 |  |
| 第 5 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）   | 50,000,000  | 50,386,500  |  |
| 第 1 0 3 回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債） | 300,000,000 | 287,556,000 |  |
| 第 1 3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債） | 300,000,000 | 273,870,000 |  |
| 第 1 6 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000 | 80,391,000  |  |
| 第 2 3 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000 | 87,440,000  |  |
| 第 2 3 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債） | 200,000,000 | 136,740,000 |  |
| 第 2 4 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000 | 88,385,000  |  |
| 第 2 8 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000 | 77,810,000  |  |
| 第 2 9 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 200,000,000 | 158,274,000 |  |
| 第 3 2 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 200,000,000 | 154,614,000 |  |
| 第 3 4 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 300,000,000 | 293,061,000 |  |
| 第 3 5 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000 | 97,275,000  |  |
| 第 3 5 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 200,000,000 | 150,248,000 |  |
| 第 3 7 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 200,000,000 | 191,684,000 |  |
| 第 1 1 回地方公共団体金融機構債券（２０年）（財投機関債）   | 100,000,000 | 99,369,000  |  |
| 第 2 4 回地方公共団体金融機構債券（２０年）（財投機関債）   | 100,000,000 | 96,568,000  |  |
| 第 4 7 回地方公共団体金融機構債券（２０年）（財投機関債）   | 100,000,000 | 86,875,000  |  |
| 第 1 0 6 回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 100,000,000 | 97,763,000  |  |
| 第 1 3 1 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）      | 300,000,000 | 280,533,000 |  |
| 第 6 6 回福祉医療機構債券（財投機関債）            | 200,000,000 | 178,372,000 |  |
| 第 3 回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券           | 16,622,000  | 16,317,484  |  |
| 第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券           | 22,868,000  | 23,002,006  |  |
| 第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券           | 13,429,000  | 13,413,288  |  |
| 第 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券           | 392,400,000 | 392,294,052 |  |
| 第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券           | 25,673,000  | 23,306,976  |  |
| 第 9 7 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）      | 300,000,000 | 294,858,000 |  |
| 第 1 0 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 45,760,000  | 37,683,817  |  |
| 第 1 0 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 50,390,000  | 39,544,056  |  |
| 第 1 4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 65,608,000  | 47,463,451  |  |
| 第 1 8 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 412,880,000 | 298,879,703 |  |

|         |                              |               |               |  |
|---------|------------------------------|---------------|---------------|--|
|         | い第８７６号商工債券                   | 200,000,000   | 195,266,000   |  |
|         | 第４３１回信金中金債                   | 200,000,000   | 195,350,000   |  |
|         | 第１０３回東日本高速道路                 | 100,000,000   | 97,958,000    |  |
|         | 第５８回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券（財投機関債） | 200,000,000   | 191,908,000   |  |
|         | 第８４回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券（財投機関債） | 300,000,000   | 284,589,000   |  |
| 特殊債券 合計 |                              | 6,495,630,000 | 5,901,978,333 |  |
| 社債券     | 第４回香港上海銀行                    | 300,000,000   | 297,966,000   |  |
|         | 第１６回新関西国際空港                  | 300,000,000   | 262,125,000   |  |
|         | 第２５回前田建設工業                   | 100,000,000   | 94,245,000    |  |
|         | 第２３回積水ハウス                    | 300,000,000   | 297,423,000   |  |
|         | 第２７回アサヒグループホールディングス          | 100,000,000   | 97,216,000    |  |
|         | 第３回コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス  | 200,000,000   | 189,356,000   |  |
|         | 第１８回日本たばこ産業                  | 200,000,000   | 194,364,000   |  |
|         | 第３３回東レ                       | 200,000,000   | 194,542,000   |  |
|         | 第８回クレハ                       | 200,000,000   | 194,728,000   |  |
|         | 第２６回オリエンタルランド                | 200,000,000   | 192,396,000   |  |
|         | 第９回住友理工                      | 200,000,000   | 197,192,000   |  |
|         | 第７回日本製鉄（グリーン）                | 200,000,000   | 195,932,000   |  |
|         | 第９回住友重機械工業                   | 300,000,000   | 290,949,000   |  |
|         | 第４０回ソニーグループ                  | 200,000,000   | 194,012,000   |  |
|         | 第４２回ソニーグループ                  | 200,000,000   | 195,014,000   |  |
|         | 第７回凸版印刷                      | 200,000,000   | 194,214,000   |  |
|         | 第７０回三井物産                     | 100,000,000   | 96,891,000    |  |
|         | 第４１回丸井グループ                   | 100,000,000   | 98,667,000    |  |
|         | 第１７回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ        | 100,000,000   | 97,271,000    |  |
|         | 第３０回芙蓉総合リース                  | 100,000,000   | 90,134,000    |  |
|         | 第２２回みずほリース（サステナビリティ）         | 300,000,000   | 293,601,000   |  |
|         | 第１８回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス          | 200,000,000   | 185,036,000   |  |
|         | 第３９回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス          | 300,000,000   | 291,921,000   |  |
|         | 第１０６回トヨタファイナンス               | 200,000,000   | 197,954,000   |  |
|         | 第３５回三井住友ファイナンス&リース           | 300,000,000   | 295,395,000   |  |
|         | 第１回損害保険ジャパン                  | 300,000,000   | 295,503,000   |  |
|         | 第５０回京成電鉄                     | 100,000,000   | 91,425,000    |  |
|         | 第１２０回東日本旅客鉄道                 | 300,000,000   | 235,905,000   |  |
|         | 第３１回京阪ホールディングス               | 200,000,000   | 193,048,000   |  |
|         | 第７回横浜高速鉄道                    | 200,000,000   | 179,960,000   |  |
|         | 第２３回九州旅客鉄道                   | 200,000,000   | 185,386,000   |  |
|         | 第２回東京臨海高速鉄道                  | 100,000,000   | 89,352,000    |  |
|         | 第１７回三菱倉庫                     | 200,000,000   | 196,416,000   |  |
|         | 第３３回ＫＤＤＩ                     | 200,000,000   | 194,268,000   |  |

|                    |                 |                 |  |
|--------------------|-----------------|-----------------|--|
| 第３７回ＫＤＤＩ（サステナビリティ） | 200,000,000     | 193,430,000     |  |
| 第４１回ＫＤＤＩ           | 100,000,000     | 98,027,000      |  |
| 第４２２回中国電力          | 300,000,000     | 280,383,000     |  |
| 第４３８回中国電力          | 100,000,000     | 84,164,000      |  |
| 第５４６回東北電力          | 100,000,000     | 89,425,000      |  |
| 第４９１回九州電力          | 300,000,000     | 273,000,000     |  |
| 第５１０回九州電力          | 200,000,000     | 195,620,000     |  |
| 第３１回東京電力パワーグリッド    | 200,000,000     | 192,204,000     |  |
| 第３５回東京電力パワーグリッド    | 200,000,000     | 191,552,000     |  |
| 第４６回東京ガス           | 300,000,000     | 220,470,000     |  |
| 第３３回大阪ガス           | 200,000,000     | 180,436,000     |  |
| 第５０回大阪ガス           | 100,000,000     | 97,626,000      |  |
| 社債券 合計             | 9,200,000,000   | 8,686,144,000   |  |
| 合計                 | 181,479,630,000 | 154,961,329,473 |  |

## 第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 日本短期債券マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

[2026年 6月25日現在]

|             |                |
|-------------|----------------|
| 資産の部        |                |
| 流動資産        |                |
| コール・ローン     | 721,637,982    |
| 社債券         | 14,708,059,000 |
| 未収利息        | 22,514,025     |
| 前払費用        | 4,358,036      |
| 流動資産合計      | 15,456,569,043 |
| 資産合計        | 15,456,569,043 |
| 負債の部        |                |
| 流動負債        |                |
| 未払金         | 589,747,000    |
| 未払解約金       | 471,937        |
| 流動負債合計      | 590,218,937    |
| 負債合計        | 590,218,937    |
| 純資産の部       |                |
| 元本等         |                |
| 元本          | 13,172,125,942 |
| 剰余金         |                |
| 剰余金又は欠損金（△） | 1,694,224,164  |
| 元本等合計       | 14,866,350,106 |
| 純資産合計       | 14,866,350,106 |
| 負債純資産合計     | 15,456,569,043 |

### 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）

|                           | [2026年 6月25日現在] |
|---------------------------|-----------------|
| 1. 期首                     | 2025年 6月26日     |
| 期首元本額                     | 7,210,073,567円  |
| 期中追加設定元本額                 | 7,090,020,792円  |
| 期中一部解約元本額                 | 1,127,968,417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         |
| 国内債券セレクション（ラップ向け）         | 4,423,192,411円  |
| ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）  | 998,597,382円    |
| ラップ向けダイナミックアロケーションファンド    | 44,978,263円     |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド     | 12,220,431円     |
| アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）   | 82,120,114円     |
| 三菱ＵＦＪ 日本短期債券オープン          | 5,519,340,564円  |
| 日本短期債券ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）   | 2,057,830円      |
| 日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）     | 102,767,848円    |
| 三菱ＵＦＪ 積立ファンド（日本バランス型）     | 1,336,067,512円  |
| 三菱ＵＦＪ 国内バランス２０            | 650,695,166円    |
| 合計                        | 13,172,125,942円 |
| 2. 受益権の総数                 | 13,172,125,942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 2025年 6月26日<br>至 2026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。<br>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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                         | [2026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<br>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。<br>（２）デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、該当事項はありません。<br>（３）上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。                                                                                                                       |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類  | [2026年 6月25日現在]    |
|-----|--------------------|
|     | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 社債券 | △27,667,000        |
| 合計  | △27,667,000        |

(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）

|              | [2026年 6月25日現在] |
|--------------|-----------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.1286円         |
| (1万口当たり純資産額) | (11,286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 |
|-----|-------------------------------|-------------|-------------|----|
| 社債券 | 第３５回フランス相互信用連合銀行              | 100,000,000 | 99,611,000  |    |
|     | 第４４回フランス相互信用連合銀行              | 200,000,000 | 197,952,000 |    |
|     | 第４７回フランス相互信用連合銀行              | 100,000,000 | 98,965,000  |    |
|     | 第１回新韓銀行                       | 100,000,000 | 99,493,000  |    |
|     | 第２４回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付 | 100,000,000 | 99,350,000  |    |
|     | 第２７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付 | 200,000,000 | 197,314,000 |    |
|     | 第２９回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付 | 100,000,000 | 98,923,000  |    |
|     | 第３２回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー         | 200,000,000 | 199,928,000 |    |
|     | 第１５回クレディ・アグリコル・エス・エー（２０２４）    | 200,000,000 | 199,324,000 |    |
|     | 第１８回クレディ・アグリコル・エス・エー（２０２５）    | 100,000,000 | 99,244,000  |    |
|     | 第２１回クレディ・アグリコル・エス・エー（２０２５）    | 300,000,000 | 296,712,000 |    |
|     | 第２５回クレディ・アグリコル・エス・エー（２０２６）    | 200,000,000 | 199,380,000 |    |
|     | 第４回香港上海銀行                     | 200,000,000 | 198,644,000 |    |
|     | 第１０回エイチエスピーシー・ホールディングス期限前償還条項 | 100,000,000 | 98,869,000  |    |
|     | 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 | 199,840,000 |    |
|     | 第１４回ロイズ・バンキング・グループ期限前償還条項付    | 200,000,000 | 199,856,000 |    |
|     | 第１０回フランス電力                    | 200,000,000 | 197,854,000 |    |
|     | 第１２回フランス電力                    | 100,000,000 | 98,694,000  |    |
|     | 第２７回ルノー                       | 100,000,000 | 99,271,000  |    |
|     | 第２９回ルノー                       | 100,000,000 | 100,518,000 |    |

|                               |             |             |  |
|-------------------------------|-------------|-------------|--|
| 第３７回サッポロホールディングス              | 300,000,000 | 292,005,000 |  |
| 第６回ヒューリック                     | 100,000,000 | 96,894,000  |  |
| 第５９回住友化学                      | 100,000,000 | 97,468,000  |  |
| 第２６回ＬＩＮＥヤフー                   | 100,000,000 | 98,820,000  |  |
| 第１３回資生堂（サステナビリティ）             | 400,000,000 | 392,868,000 |  |
| 第６回新日鐵住金                      | 300,000,000 | 294,273,000 |  |
| 第７回日本製鉄（グリーン）                 | 100,000,000 | 97,966,000  |  |
| 第９回新日本製鐵                      | 100,000,000 | 97,189,000  |  |
| 第１３回日本製鉄                      | 200,000,000 | 200,280,000 |  |
| 第６８回神戸製鋼所                     | 100,000,000 | 97,553,000  |  |
| 第２回ＪＦＥホールディングス利払繰延・期限前償還条項付   | 100,000,000 | 100,050,000 |  |
| 第３６回ジェイ エフ イー ホールディングス        | 100,000,000 | 98,890,000  |  |
| 第６８回日本電気                      | 100,000,000 | 100,109,000 |  |
| 第２４回パナソニックホールディングス            | 300,000,000 | 292,497,000 |  |
| 第２９回パナソニックホールディングス            | 100,000,000 | 99,218,000  |  |
| 第３１回パナソニックホールディングス            | 100,000,000 | 99,538,000  |  |
| 第３３回パナソニックホールディングス            | 100,000,000 | 99,567,000  |  |
| 第６５回クレディセゾン                   | 300,000,000 | 296,106,000 |  |
| 第８７回クレディセゾン                   | 200,000,000 | 194,732,000 |  |
| 第９９回クレディセゾン                   | 100,000,000 | 96,740,000  |  |
| 第１１９回クレディセゾン                  | 100,000,000 | 99,945,000  |  |
| 第２６回三井住友フィナンシャルグループ永久償還意償還条項付 | 100,000,000 | 100,008,000 |  |
| 第１８回芙蓉総合リース                   | 100,000,000 | 96,915,000  |  |
| 第２９回芙蓉総合リース                   | 100,000,000 | 97,076,000  |  |
| 第３５回芙蓉総合リース                   | 200,000,000 | 196,698,000 |  |
| 第３７回芙蓉総合リース                   | 200,000,000 | 194,920,000 |  |
| 第３８回芙蓉総合リース（サステナビリティ）         | 100,000,000 | 97,617,000  |  |
| 第４０回芙蓉総合リース（サステナビリティ）         | 100,000,000 | 96,897,000  |  |
| 第２４回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン）     | 100,000,000 | 97,432,000  |  |
| 第２８回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン）     | 100,000,000 | 97,508,000  |  |
| 第４２回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス           | 200,000,000 | 199,400,000 |  |
| 第４６回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス           | 200,000,000 | 200,152,000 |  |
| 第３０回東京センチュリー                  | 100,000,000 | 97,846,000  |  |
| 第３３回東京センチュリー                  | 300,000,000 | 292,233,000 |  |
| 第３４回東京センチュリー                  | 200,000,000 | 193,778,000 |  |
| 第８１回ホンダファイナンス                 | 100,000,000 | 97,159,000  |  |
| 第９３回ホンダファイナンス                 | 100,000,000 | 98,706,000  |  |
| 第９８回ホンダファイナンス                 | 100,000,000 | 100,102,000 |  |
| 第４１回ＳＢＩホールディングス               | 100,000,000 | 99,160,000  |  |
| 第４４回ＳＢＩホールディングス               | 100,000,000 | 98,776,000  |  |

|                           |                |                |  |
|---------------------------|----------------|----------------|--|
| 第４２回リコリース                 | 100,000,000    | 98,934,000     |  |
| 第１７回イオンフィナンシャルサービス        | 300,000,000    | 299,706,000    |  |
| 第２４回イオンフィナンシャルサービス        | 100,000,000    | 99,377,000     |  |
| 第２６回イオンフィナンシャルサービス        | 100,000,000    | 99,065,000     |  |
| 第２８回イオンフィナンシャルサービス        | 100,000,000    | 99,787,000     |  |
| 第３０回イオンフィナンシャルサービス        | 200,000,000    | 200,000,000    |  |
| 第８３回アコム                   | 100,000,000    | 97,365,000     |  |
| 第８４回アコム                   | 100,000,000    | 99,618,000     |  |
| 第８９回アコム                   | 100,000,000    | 99,053,000     |  |
| 第９０回アコム                   | 300,000,000    | 300,423,000    |  |
| 第２０５回オリックス（グリーン）          | 100,000,000    | 97,044,000     |  |
| 第２０９回オリックス                | 100,000,000    | 98,638,000     |  |
| 第２１２回オリックス                | 200,000,000    | 196,544,000    |  |
| 第１７回三井住友ファイナンス&リース        | 100,000,000    | 98,032,000     |  |
| 第２回三菱ＨＣキャピタル              | 100,000,000    | 99,193,000     |  |
| 第１８回三菱ＨＣキャピタル（グリーン）       | 100,000,000    | 98,749,000     |  |
| 第２２回三菱ＨＣキャピタル             | 100,000,000    | 98,920,000     |  |
| 第５２回三菱ＵＦＪリース              | 300,000,000    | 296,406,000    |  |
| 第５９回三菱ＵＦＪリース              | 100,000,000    | 97,453,000     |  |
| 第３１回大和証券グループ本社            | 300,000,000    | 295,707,000    |  |
| 第４０回大和証券グループ本社            | 100,000,000    | 99,665,000     |  |
| 第４４回大和証券グループ本社（グリーン）      | 100,000,000    | 99,340,000     |  |
| 第３回野村ホールディングス             | 100,000,000    | 99,785,000     |  |
| 第７回野村ホールディングス永久債任意償還条項付   | 100,000,000    | 98,658,000     |  |
| 第１回ＳＢＩ証券劣後特約付             | 100,000,000    | 99,243,000     |  |
| 第７回三菱地所利払繰延・期限前償還条項・劣後特約付 | 100,000,000    | 98,847,000     |  |
| 第１７回イオンモール                | 200,000,000    | 194,198,000    |  |
| 第３２回イオンモール                | 100,000,000    | 98,697,000     |  |
| 第３５回イオンモール                | 300,000,000    | 293,637,000    |  |
| 第３７回イオンモール（グリーン）          | 100,000,000    | 97,597,000     |  |
| 第２５回商船三井                  | 300,000,000    | 291,579,000    |  |
| 第３０回商船三井                  | 300,000,000    | 297,201,000    |  |
| 第２０回ソフトバンク                | 100,000,000    | 99,960,000     |  |
| 第２５回ソフトバンク                | 300,000,000    | 297,741,000    |  |
| 第２８回ソフトバンク                | 200,000,000    | 199,178,000    |  |
| 第３３回ソフトバンク                | 100,000,000    | 100,076,000    |  |
| 第５２回光通信                   | 100,000,000    | 98,788,000     |  |
| 第８回ＪＥＲＡ                   | 100,000,000    | 99,022,000     |  |
| 合計                        | 14,900,000,000 | 14,708,059,000 |  |

## 第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 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)          |                 |
|-----------------|-----------------|
| [2026年 6月25日現在] |                 |
| <b>資産の部</b>     |                 |
| 流動資産            |                 |
| 預金              | 1,599,980,686   |
| コール・ローン         | 1,404,066,000   |
| 国債証券            | 360,481,381,257 |
| 派生商品評価勘定        | 1,573,145,544   |
| 未収入金            | 2,435,473,801   |
| 未収利息            | 2,834,836,407   |
| 前払費用            | 466,413,290     |
| 流動資産合計          | 370,795,296,985 |
| 資産合計            | 370,795,296,985 |
| <b>負債の部</b>     |                 |
| 流動負債            |                 |
| 派生商品評価勘定        | 3,262,541,123   |
| 未払金             | 1,596,178,075   |
| 未払解約金           | 8,450,674       |
| 流動負債合計          | 4,867,169,872   |
| 負債合計            | 4,867,169,872   |
| <b>純資産の部</b>    |                 |
| 元本等             |                 |
| 元本              | 332,259,294,017 |
| 剰余金             |                 |
| 剰余金又は欠損金（△）     | 33,668,833,096  |
| 元本等合計           | 365,928,127,113 |
| 純資産合計           | 365,928,127,113 |
| 負債純資産合計         | 370,795,296,985 |

### 注記表

#### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

#### （重要な会計上の見積りに関する注記）

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

#### （貸借対照表に関する注記）

| [2026年 6月25日現在]                  |                  |
|----------------------------------|------------------|
| 1. 期首                            | 2025年 6月26日      |
| 期首元本額                            | 325,838,612,584円 |
| 期中追加設定元本額                        | 103,215,862,095円 |
| 期中一部解約元本額                        | 96,795,180,662円  |
| 元本の内訳※                           |                  |
| eMAXIS 先進国債券インデックス（除く日本・為替ヘッジあり） | 1,454,724,204円   |
| ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）         | 10,772,350,463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）      | 8,205,295,544円   |
| ラップ向けダイナミックアロケーションファンド           | 412,319,335円     |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド            | 77,168,784円      |

|                                            | [2026年 6月25日現在]  |
|--------------------------------------------|------------------|
| アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）                    | 629,547,791円     |
| eMAXIS/PayPay証券 全世界バランス                    | 26,738,589円      |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）                  | 2,599,844,114円   |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）                  | 3,257,686,523円   |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）                 | 81,764,277円      |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）             | 6,814,512,830円   |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）                  | 1,172,224,770円   |
| eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）                      | 80,259,835円      |
| MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）      | 188,981,417,234円 |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）              | 8,345,976,784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）    | 11,260,773,359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）   | 1,485,133,410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）      | 310,237,535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）          | 12,117,827,850円  |
| MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）    | 1,148,217,918円   |
| MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）       | 13,655,163,404円  |
| MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスオープン（適格機関投資家限定）        | 6,842,600,868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）        | 169,201,973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） | 46,532,022,377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）  | 389,214,480円     |
| MUKAM バランスファンド2019-12（適格機関投資家限定）           | 2,727,146,638円   |
| MUKAM バランスファンド2020-07（適格機関投資家限定）           | 2,709,923,128円   |
| 合計                                         | 332,259,294,017円 |
| 2. 受益権の総数                                  | 332,259,294,017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 2025年 6月26日<br>至 2026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。<br>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。<br>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。<br>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。<br>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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                   | [2026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                |

| 区分                        | [2026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 | <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>（２）デリバティブ取引<br/>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>（３）上記以外の金融商品<br/>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>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。</p> |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種類   | [2026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 | △992,623,710       |
| 合計   | △992,623,710       |

(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

[2026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     | 339,436,230     | —     | 339,794,490     | 358,260        |
|           | イギリスポンド    | 164,301,368     | —     | 164,011,925     | △289,443       |
|           | ユーロ        | 101,138,290     | —     | 101,036,210     | △102,080       |
|           | 売建         |                 |       |                 |                |
|           | アメリカドル     | 163,148,402,900 | —     | 165,938,297,006 | △2,789,894,106 |
|           | カナダドル      | 7,815,131,320   | —     | 7,692,443,468   | 122,687,852    |
|           | オーストラリアドル  | 4,810,333,456   | —     | 4,717,665,801   | 92,667,655     |
|           | イギリスポンド    | 20,742,703,772  | —     | 20,667,818,175  | 74,885,597     |
|           | シンガポールドル   | 1,285,556,005   | —     | 1,284,332,750   | 1,223,255      |
|           | マレーシアリンギット | 1,925,792,624   | —     | 1,880,823,648   | 44,968,976     |
|           | ニュージーランドドル | 1,105,399,890   | —     | 1,068,232,230   | 37,167,660     |
|           | スウェーデンクローネ | 700,312,950     | —     | 675,406,352     | 24,906,598     |
|           | ノルウェークローネ  | 618,562,191     | —     | 592,337,952     | 26,224,239     |
|           | デンマーククローネ  | 774,065,760     | —     | 766,574,640     | 7,491,120      |
|           | メキシコペソ     | 3,288,951,842   | —     | 3,297,838,555   | △8,886,713     |
|           | 韓国ウォン      | 2,603,560,202   | —     | 2,573,714,317   | 29,845,885     |
|           | イスラエルシェケル  | 1,681,765,972   | —     | 1,621,661,178   | 60,104,794     |

|    |          |                 |   |                 |                |
|----|----------|-----------------|---|-----------------|----------------|
|    | ポーランドズロチ | 2,741,028,362   | — | 2,683,036,370   | 57,991,992     |
|    | 中国元      | 46,675,068,553  | — | 47,137,649,652  | △462,581,099   |
|    | ユーロ      | 105,782,604,937 | — | 104,790,770,958 | 991,833,979    |
| 合計 |          | 366,304,116,624 | — | 367,993,445,677 | △1,689,395,579 |

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

|              |                 |
|--------------|-----------------|
|              | [2026年 6月25日現在] |
| 1口当たり純資産額    | 1.1013円         |
| (1万口当たり純資産額) | (11,013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 | 0.375 T-NOTE 270731 | 4,000,000.00 | 3,840,390.64 |    |
|        |      | 0.375 T-NOTE 270930 | 4,200,000.00 | 4,007,718.75 |    |
|        |      | 0.5 T-NOTE 270630   | 3,500,000.00 | 3,376,686.60 |    |
|        |      | 0.5 T-NOTE 270831   | 3,850,000.00 | 3,690,585.93 |    |
|        |      | 0.5 T-NOTE 271031   | 4,900,000.00 | 4,668,015.62 |    |
|        |      | 0.625 T-NOTE 271130 | 5,700,000.00 | 5,424,128.89 |    |
|        |      | 0.625 T-NOTE 271231 | 6,280,000.00 | 5,958,150.00 |    |
|        |      | 0.625 T-NOTE 300515 | 4,800,000.00 | 4,195,031.23 |    |
|        |      | 0.625 T-NOTE 300815 | 6,450,000.00 | 5,588,320.31 |    |
|        |      | 0.75 T-NOTE 280131  | 4,200,000.00 | 3,981,058.57 |    |
|        |      | 0.875 T-NOTE 301115 | 8,000,000.00 | 6,951,250.00 |    |
|        |      | 1 T-NOTE 280731     | 6,600,000.00 | 6,185,824.19 |    |
|        |      | 1.125 T-BOND 400515 | 3,760,000.00 | 2,397,587.49 |    |
|        |      | 1.125 T-BOND 400815 | 3,850,000.00 | 2,429,936.50 |    |
|        |      | 1.125 T-NOTE 280229 | 7,000,000.00 | 6,659,296.84 |    |
|        |      | 1.125 T-NOTE 280831 | 5,850,000.00 | 5,483,689.43 |    |
|        |      | 1.125 T-NOTE 310215 | 6,950,000.00 | 6,066,861.34 |    |
|        |      | 1.25 T-BOND 500515  | 3,550,000.00 | 1,713,707.04 |    |

|                     |              |              |  |
|---------------------|--------------|--------------|--|
| 1.25 T-NOTE 280331  | 5,590,000.00 | 5,316,286.54 |  |
| 1.25 T-NOTE 280430  | 4,800,000.00 | 4,554,656.25 |  |
| 1.25 T-NOTE 280531  | 5,050,000.00 | 4,780,239.25 |  |
| 1.25 T-NOTE 280630  | 4,800,000.00 | 4,533,281.23 |  |
| 1.25 T-NOTE 280930  | 7,500,000.00 | 7,033,300.80 |  |
| 1.25 T-NOTE 310815  | 8,640,000.00 | 7,471,068.73 |  |
| 1.375 T-BOND 401115 | 4,840,000.00 | 3,154,885.94 |  |
| 1.375 T-BOND 500815 | 4,860,000.00 | 2,418,419.53 |  |
| 1.375 T-NOTE 281031 | 4,460,000.00 | 4,184,908.58 |  |
| 1.375 T-NOTE 281231 | 3,110,000.00 | 2,905,481.05 |  |
| 1.375 T-NOTE 311115 | 7,360,000.00 | 6,361,512.51 |  |
| 1.5 T-NOTE 281130   | 4,900,000.00 | 4,602,076.17 |  |
| 1.5 T-NOTE 300215   | 4,250,000.00 | 3,872,314.44 |  |
| 1.625 T-BOND 501115 | 4,360,000.00 | 2,311,651.55 |  |
| 1.625 T-NOTE 290815 | 2,000,000.00 | 1,853,476.56 |  |
| 1.625 T-NOTE 310515 | 5,130,000.00 | 4,553,576.37 |  |
| 1.75 T-BOND 410815  | 4,080,000.00 | 2,758,382.81 |  |
| 1.75 T-NOTE 290131  | 2,800,000.00 | 2,635,390.63 |  |
| 1.875 T-BOND 410215 | 3,980,000.00 | 2,783,667.95 |  |
| 1.875 T-BOND 510215 | 4,670,000.00 | 2,631,709.19 |  |
| 1.875 T-BOND 511115 | 6,010,000.00 | 3,350,105.49 |  |
| 1.875 T-NOTE 290228 | 3,850,000.00 | 3,629,602.55 |  |
| 1.875 T-NOTE 320215 | 8,900,000.00 | 7,858,769.50 |  |
| 2 T-BOND 411115     | 5,000,000.00 | 3,495,117.19 |  |
| 2 T-BOND 500215     | 3,400,000.00 | 2,006,863.29 |  |
| 2 T-BOND 510815     | 5,630,000.00 | 3,250,665.21 |  |
| 2.25 T-BOND 410515  | 3,220,000.00 | 2,367,391.78 |  |
| 2.25 T-BOND 460815  | 3,000,000.00 | 1,978,125.00 |  |
| 2.25 T-BOND 490815  | 3,440,000.00 | 2,166,393.73 |  |
| 2.25 T-BOND 520215  | 4,390,000.00 | 2,680,472.27 |  |
| 2.25 T-NOTE 270815  | 4,800,000.00 | 4,700,531.23 |  |
| 2.25 T-NOTE 271115  | 4,200,000.00 | 4,093,523.44 |  |
| 2.375 T-BOND 420215 | 3,620,000.00 | 2,663,669.52 |  |
| 2.375 T-BOND 491115 | 2,430,000.00 | 1,567,065.22 |  |
| 2.375 T-BOND 510515 | 4,570,000.00 | 2,895,255.68 |  |
| 2.375 T-NOTE 290331 | 4,650,000.00 | 4,436,027.36 |  |
| 2.375 T-NOTE 290515 | 6,320,000.00 | 6,018,565.64 |  |
| 2.5 T-BOND 450215   | 2,770,000.00 | 1,962,155.47 |  |
| 2.5 T-BOND 460215   | 4,180,000.00 | 2,912,121.10 |  |
| 2.5 T-BOND 460515   | 1,490,000.00 | 1,034,211.32 |  |
| 2.625 T-NOTE 270531 | 7,150,000.00 | 7,056,182.70 |  |
| 2.625 T-NOTE 290215 | 5,590,000.00 | 5,377,973.03 |  |
|                     |              |              |  |

|                     |              |              |
|---------------------|--------------|--------------|
| 2.625 T-NOTE 290731 | 3,230,000.00 | 3,087,930.45 |
| 2.75 T-BOND 420815  | 1,430,000.00 | 1,102,384.76 |
| 2.75 T-BOND 421115  | 1,340,000.00 | 1,027,717.18 |
| 2.75 T-BOND 470815  | 2,040,000.00 | 1,457,882.81 |
| 2.75 T-BOND 471115  | 2,110,000.00 | 1,503,622.27 |
| 2.75 T-NOTE 270731  | 4,510,000.00 | 4,443,935.53 |
| 2.75 T-NOTE 280215  | 5,550,000.00 | 5,427,509.77 |
| 2.75 T-NOTE 290531  | 1,070,000.00 | 1,029,018.16 |
| 2.75 T-NOTE 320815  | 7,130,000.00 | 6,556,814.87 |
| 2.875 T-BOND 430515 | 1,200,000.00 | 929,953.12   |
| 2.875 T-BOND 450815 | 1,860,000.00 | 1,394,200.77 |
| 2.875 T-BOND 461115 | 390,000.00   | 287,762.10   |
| 2.875 T-BOND 490515 | 2,720,000.00 | 1,954,203.12 |
| 2.875 T-BOND 520515 | 4,240,000.00 | 2,971,478.11 |
| 2.875 T-NOTE 280515 | 5,700,000.00 | 5,568,966.80 |
| 2.875 T-NOTE 280815 | 4,960,000.00 | 4,831,350.00 |
| 2.875 T-NOTE 320515 | 6,450,000.00 | 5,995,980.50 |
| 3 T-BOND 420515     | 1,310,000.00 | 1,051,735.54 |
| 3 T-BOND 441115     | 2,100,000.00 | 1,621,839.84 |
| 3 T-BOND 450515     | 2,510,000.00 | 1,927,405.45 |
| 3 T-BOND 451115     | 2,040,000.00 | 1,555,978.13 |
| 3 T-BOND 470215     | 2,700,000.00 | 2,030,167.96 |
| 3 T-BOND 480215     | 2,560,000.00 | 1,905,500.00 |
| 3 T-BOND 480815     | 3,150,000.00 | 2,333,214.82 |
| 3 T-BOND 490215     | 3,180,000.00 | 2,344,753.12 |
| 3 T-BOND 520815     | 4,330,000.00 | 3,110,411.50 |
| 3.125 T-BOND 411115 | 600,000.00   | 494,085.93   |
| 3.125 T-BOND 420215 | 1,340,000.00 | 1,098,642.96 |
| 3.125 T-BOND 430215 | 1,850,000.00 | 1,492,863.27 |
| 3.125 T-BOND 440815 | 2,480,000.00 | 1,959,684.36 |
| 3.125 T-BOND 480515 | 2,020,000.00 | 1,534,213.67 |
| 3.125 T-NOTE 270831 | 7,170,000.00 | 7,087,937.12 |
| 3.125 T-NOTE 281115 | 1,750,000.00 | 1,709,497.07 |
| 3.25 T-BOND 420515  | 1,080,000.00 | 897,180.47   |
| 3.25 T-NOTE 290630  | 2,850,000.00 | 2,777,915.03 |
| 3.375 T-BOND 420815 | 2,860,000.00 | 2,407,371.48 |
| 3.375 T-BOND 440515 | 1,490,000.00 | 1,226,863.67 |
| 3.375 T-BOND 481115 | 5,730,000.00 | 4,530,505.06 |
| 3.375 T-NOTE 271130 | 7,500,000.00 | 7,420,605.45 |
| 3.375 T-NOTE 280915 | 4,000,000.00 | 3,933,906.24 |
| 3.375 T-NOTE 330515 | 8,200,000.00 | 7,758,289.04 |
| 3.5 T-BOND 390215   | 700,000.00   | 633,445.31   |
| 3.5 T-NOTE 271031   | 9,650,000.00 | 9,567,824.26 |

|                     |              |              |  |
|---------------------|--------------|--------------|--|
| 3.5 T-NOTE 280131   | 2,800,000.00 | 2,771,890.63 |  |
| 3.5 T-NOTE 280430   | 5,240,000.00 | 5,179,514.83 |  |
| 3.5 T-NOTE 281015   | 1,290,000.00 | 1,271,355.47 |  |
| 3.5 T-NOTE 281115   | 5,200,000.00 | 5,122,812.50 |  |
| 3.5 T-NOTE 281215   | 4,000,000.00 | 3,938,984.36 |  |
| 3.5 T-NOTE 290115   | 2,500,000.00 | 2,460,351.55 |  |
| 3.5 T-NOTE 290215   | 3,100,000.00 | 3,049,503.91 |  |
| 3.5 T-NOTE 290930   | 6,200,000.00 | 6,076,726.57 |  |
| 3.5 T-NOTE 300430   | 5,290,000.00 | 5,165,085.74 |  |
| 3.5 T-NOTE 301130   | 6,260,000.00 | 6,089,683.99 |  |
| 3.5 T-NOTE 310228   | 6,950,000.00 | 6,751,816.43 |  |
| 3.5 T-NOTE 330215   | 7,990,000.00 | 7,636,067.92 |  |
| 3.625 T-BOND 430815 | 1,150,000.00 | 988,865.23   |  |
| 3.625 T-BOND 440215 | 1,040,000.00 | 889,525.00   |  |
| 3.625 T-BOND 530215 | 4,000,000.00 | 3,239,062.48 |  |
| 3.625 T-BOND 530515 | 3,290,000.00 | 2,662,201.18 |  |
| 3.625 T-NOTE 280331 | 2,980,000.00 | 2,953,401.17 |  |
| 3.625 T-NOTE 280531 | 3,760,000.00 | 3,723,721.86 |  |
| 3.625 T-NOTE 280815 | 2,500,000.00 | 2,472,851.55 |  |
| 3.625 T-NOTE 290831 | 5,180,000.00 | 5,098,556.61 |  |
| 3.625 T-NOTE 300331 | 3,590,000.00 | 3,522,827.72 |  |
| 3.625 T-NOTE 300831 | 3,050,000.00 | 2,985,723.62 |  |
| 3.625 T-NOTE 300930 | 5,850,000.00 | 5,725,458.99 |  |
| 3.625 T-NOTE 301031 | 3,450,000.00 | 3,374,666.00 |  |
| 3.625 T-NOTE 301231 | 4,000,000.00 | 3,909,375.00 |  |
| 3.625 T-NOTE 310930 | 4,950,000.00 | 4,816,388.65 |  |
| 3.75 T-BOND 410815  | 1,200,000.00 | 1,074,796.87 |  |
| 3.75 T-BOND 431115  | 1,770,000.00 | 1,544,048.43 |  |
| 3.75 T-NOTE 270630  | 1,700,000.00 | 1,694,389.40 |  |
| 3.75 T-NOTE 270815  | 7,360,000.00 | 7,329,812.51 |  |
| 3.75 T-NOTE 280415  | 4,300,000.00 | 4,270,269.54 |  |
| 3.75 T-NOTE 280515  | 4,900,000.00 | 4,864,398.46 |  |
| 3.75 T-NOTE 281231  | 4,860,000.00 | 4,812,634.00 |  |
| 3.75 T-NOTE 300531  | 3,100,000.00 | 3,053,197.25 |  |
| 3.75 T-NOTE 300630  | 3,150,000.00 | 3,100,965.80 |  |
| 3.75 T-NOTE 301231  | 3,470,000.00 | 3,408,529.50 |  |
| 3.75 T-NOTE 310131  | 4,700,000.00 | 4,615,455.08 |  |
| 3.75 T-NOTE 321031  | 3,900,000.00 | 3,791,074.20 |  |
| 3.75 T-NOTE 321130  | 2,270,000.00 | 2,205,579.87 |  |
| 3.875 T-BOND 400815 | 970,000.00   | 891,187.50   |  |
| 3.875 T-BOND 430215 | 2,400,000.00 | 2,145,843.74 |  |
| 3.875 T-BOND 430515 | 2,760,000.00 | 2,461,790.61 |  |
|                     |              |              |  |

|                     |              |              |
|---------------------|--------------|--------------|
| 3.875 T-NOTE 271015 | 5,000,000.00 | 4,983,496.10 |
| 3.875 T-NOTE 271231 | 3,500,000.00 | 3,486,328.12 |
| 3.875 T-NOTE 280715 | 4,530,000.00 | 4,504,518.75 |
| 3.875 T-NOTE 290415 | 6,200,000.00 | 6,155,195.32 |
| 3.875 T-NOTE 290930 | 3,650,000.00 | 3,618,917.98 |
| 3.875 T-NOTE 291130 | 3,060,000.00 | 3,032,268.75 |
| 3.875 T-NOTE 291231 | 4,550,000.00 | 4,507,699.19 |
| 3.875 T-NOTE 300430 | 2,800,000.00 | 2,771,070.31 |
| 3.875 T-NOTE 300630 | 5,520,000.00 | 5,459,625.00 |
| 3.875 T-NOTE 300731 | 3,200,000.00 | 3,164,500.00 |
| 3.875 T-NOTE 310331 | 4,900,000.00 | 4,835,304.71 |
| 3.875 T-NOTE 310430 | 4,590,000.00 | 4,528,321.87 |
| 3.875 T-NOTE 320831 | 1,780,000.00 | 1,744,260.94 |
| 3.875 T-NOTE 320930 | 2,400,000.00 | 2,350,781.25 |
| 3.875 T-NOTE 321231 | 2,300,000.00 | 2,249,732.41 |
| 3.875 T-NOTE 330815 | 8,260,000.00 | 8,048,498.80 |
| 3.875 T-NOTE 340815 | 8,110,000.00 | 7,852,919.32 |
| 4 T-BOND 421115     | 3,000,000.00 | 2,731,289.07 |
| 4 T-BOND 521115     | 3,040,000.00 | 2,633,221.88 |
| 4 T-NOTE 271215     | 2,300,000.00 | 2,295,328.12 |
| 4 T-NOTE 280229     | 6,300,000.00 | 6,284,865.25 |
| 4 T-NOTE 280630     | 2,750,000.00 | 2,742,158.21 |
| 4 T-NOTE 290131     | 5,400,000.00 | 5,378,906.25 |
| 4 T-NOTE 290731     | 4,880,000.00 | 4,858,173.41 |
| 4 T-NOTE 291031     | 4,040,000.00 | 4,019,642.19 |
| 4 T-NOTE 300228     | 5,040,000.00 | 5,012,142.20 |
| 4 T-NOTE 300331     | 2,600,000.00 | 2,585,121.08 |
| 4 T-NOTE 300531     | 2,930,000.00 | 2,912,088.08 |
| 4 T-NOTE 300731     | 3,250,000.00 | 3,228,862.29 |
| 4 T-NOTE 310131     | 3,390,000.00 | 3,363,979.10 |
| 4 T-NOTE 320430     | 2,450,000.00 | 2,420,954.09 |
| 4 T-NOTE 320630     | 3,150,000.00 | 3,110,871.07 |
| 4 T-NOTE 320731     | 3,000,000.00 | 2,961,035.16 |
| 4 T-NOTE 330131     | 3,880,000.00 | 3,821,042.19 |
| 4 T-NOTE 340215     | 8,400,000.00 | 8,226,421.88 |
| 4 T-NOTE 351115     | 9,510,000.00 | 9,226,185.93 |
| 4.125 T-BOND 440815 | 2,720,000.00 | 2,482,637.51 |
| 4.125 T-BOND 530815 | 4,900,000.00 | 4,333,246.10 |
| 4.125 T-NOTE 270930 | 4,200,000.00 | 4,199,835.94 |
| 4.125 T-NOTE 271031 | 3,920,000.00 | 3,918,468.76 |
| 4.125 T-NOTE 271115 | 8,000,000.00 | 7,998,124.96 |
| 4.125 T-NOTE 280731 | 4,070,000.00 | 4,067,615.22 |
| 4.125 T-NOTE 290331 | 6,400,000.00 | 6,394,750.01 |

|                     |               |               |  |
|---------------------|---------------|---------------|--|
| 4.125 T-NOTE 291031 | 6,320,000.00  | 6,312,840.64  |  |
| 4.125 T-NOTE 291130 | 7,200,000.00  | 7,192,125.00  |  |
| 4.125 T-NOTE 300831 | 3,260,000.00  | 3,253,059.75  |  |
| 4.125 T-NOTE 310331 | 3,480,000.00  | 3,470,688.28  |  |
| 4.125 T-NOTE 310731 | 3,610,000.00  | 3,598,366.19  |  |
| 4.125 T-NOTE 311031 | 2,350,000.00  | 2,340,774.41  |  |
| 4.125 T-NOTE 311130 | 3,650,000.00  | 3,635,029.30  |  |
| 4.125 T-NOTE 320229 | 3,710,000.00  | 3,692,174.60  |  |
| 4.125 T-NOTE 320331 | 600,000.00    | 596,964.84    |  |
| 4.125 T-NOTE 320531 | 4,300,000.00  | 4,275,560.56  |  |
| 4.125 T-NOTE 321115 | 8,040,000.00  | 7,981,270.29  |  |
| 4.125 T-NOTE 330430 | 3,540,000.00  | 3,507,365.61  |  |
| 4.125 T-NOTE 360215 | 11,060,000.00 | 10,824,975.00 |  |
| 4.25 T-BOND 390515  | 1,000,000.00  | 971,718.75    |  |
| 4.25 T-BOND 540215  | 5,180,000.00  | 4,678,693.37  |  |
| 4.25 T-BOND 540815  | 4,590,000.00  | 4,148,929.68  |  |
| 4.25 T-NOTE 280115  | 6,000,000.00  | 6,008,671.86  |  |
| 4.25 T-NOTE 280215  | 6,000,000.00  | 6,008,671.86  |  |
| 4.25 T-NOTE 290228  | 6,100,000.00  | 6,114,654.27  |  |
| 4.25 T-NOTE 290630  | 6,350,000.00  | 6,366,495.14  |  |
| 4.25 T-NOTE 300131  | 3,650,000.00  | 3,659,766.59  |  |
| 4.25 T-NOTE 310228  | 3,300,000.00  | 3,309,087.90  |  |
| 4.25 T-NOTE 310630  | 3,950,000.00  | 3,960,029.28  |  |
| 4.25 T-NOTE 330331  | 5,200,000.00  | 5,192,687.50  |  |
| 4.25 T-NOTE 341115  | 8,560,000.00  | 8,496,803.14  |  |
| 4.25 T-NOTE 350515  | 7,190,000.00  | 7,124,419.35  |  |
| 4.25 T-NOTE 350815  | 7,800,000.00  | 7,722,457.00  |  |
| 4.375 T-BOND 380215 | 520,000.00    | 517,989.06    |  |
| 4.375 T-BOND 391115 | 680,000.00    | 664,567.18    |  |
| 4.375 T-BOND 400515 | 600,000.00    | 583,921.87    |  |
| 4.375 T-BOND 410515 | 1,020,000.00  | 984,778.12    |  |
| 4.375 T-BOND 430815 | 2,850,000.00  | 2,703,993.16  |  |
| 4.375 T-NOTE 270715 | 6,200,000.00  | 6,217,468.12  |  |
| 4.375 T-NOTE 280831 | 4,480,000.00  | 4,499,949.97  |  |
| 4.375 T-NOTE 281130 | 4,550,000.00  | 4,572,572.27  |  |
| 4.375 T-NOTE 291231 | 6,300,000.00  | 6,343,804.65  |  |
| 4.375 T-NOTE 301130 | 2,100,000.00  | 2,116,283.21  |  |
| 4.375 T-NOTE 320131 | 3,380,000.00  | 3,405,878.12  |  |
| 4.375 T-NOTE 340515 | 7,950,000.00  | 7,974,067.35  |  |
| 4.375 T-NOTE 360515 | 2,060,000.00  | 2,055,332.81  |  |
| 4.5 T-BOND 380515   | 170,000.00    | 170,919.72    |  |
| 4.5 T-BOND 390815   | 720,000.00    | 714,403.12    |  |
|                     |               |               |  |

|          |      |                      |                  |                                       |  |
|----------|------|----------------------|------------------|---------------------------------------|--|
|          |      | 4.5 T-BOND 440215    | 2,880,000.00     | 2,767,949.99                          |  |
|          |      | 4.5 T-BOND 541115    | 4,630,000.00     | 4,362,870.71                          |  |
|          |      | 4.5 T-NOTE 290531    | 5,750,000.00     | 5,804,018.54                          |  |
|          |      | 4.5 T-NOTE 311231    | 2,070,000.00     | 2,099,149.80                          |  |
|          |      | 4.5 T-NOTE 331115    | 7,740,000.00     | 7,834,028.92                          |  |
|          |      | 4.625 T-BOND 400215  | 540,000.00       | 540,506.25                            |  |
|          |      | 4.625 T-BOND 440515  | 3,200,000.00     | 3,119,500.00                          |  |
|          |      | 4.625 T-BOND 441115  | 3,110,000.00     | 3,024,232.04                          |  |
|          |      | 4.625 T-BOND 451115  | 5,400,000.00     | 5,233,781.25                          |  |
|          |      | 4.625 T-BOND 460215  | 1,650,000.00     | 1,598,050.77                          |  |
|          |      | 4.625 T-BOND 540515  | 5,020,000.00     | 4,825,867.15                          |  |
|          |      | 4.625 T-BOND 550215  | 5,190,000.00     | 4,992,435.33                          |  |
|          |      | 4.625 T-BOND 551115  | 4,580,000.00     | 4,410,039.03                          |  |
|          |      | 4.625 T-NOTE 280930  | 1,400,000.00     | 1,413,972.65                          |  |
|          |      | 4.625 T-NOTE 290430  | 6,150,000.00     | 6,226,875.00                          |  |
|          |      | 4.625 T-NOTE 300930  | 2,970,000.00     | 3,021,510.93                          |  |
|          |      | 4.625 T-NOTE 310430  | 3,640,000.00     | 3,709,103.14                          |  |
|          |      | 4.625 T-NOTE 310531  | 3,450,000.00     | 3,515,967.76                          |  |
|          |      | 4.625 T-NOTE 350215  | 8,760,000.00     | 8,923,907.83                          |  |
|          |      | 4.75 T-BOND 410215   | 750,000.00       | 755,625.00                            |  |
|          |      | 4.75 T-BOND 431115   | 3,170,000.00     | 3,146,348.82                          |  |
|          |      | 4.75 T-BOND 450215   | 430,000.00       | 424,415.03                            |  |
|          |      | 4.75 T-BOND 531115   | 4,020,000.00     | 3,937,401.54                          |  |
|          |      | 4.75 T-BOND 550515   | 4,650,000.00     | 4,564,265.62                          |  |
|          |      | 4.75 T-BOND 550815   | 5,420,000.00     | 5,322,397.66                          |  |
|          |      | 4.75 T-BOND 560215   | 5,000,000.00     | 4,916,015.60                          |  |
|          |      | 4.875 T-BOND 450815  | 320,000.00       | 320,387.50                            |  |
|          |      | 4.875 T-NOTE 281031  | 7,000,000.00     | 7,110,332.04                          |  |
|          |      | 4.875 T-NOTE 301031  | 3,350,000.00     | 3,441,601.56                          |  |
|          |      | 5 T-BOND 370515      | 600,000.00       | 632,460.93                            |  |
|          |      | 5 T-BOND 450515      | 2,980,000.00     | 3,032,441.02                          |  |
|          |      | 5 T-BOND 560515      | 2,250,000.00     | 2,301,152.35                          |  |
|          |      | 5.25 T-BOND 281115   | 1,000,000.00     | 1,025,234.38                          |  |
|          |      | 5.375 T-BOND 310215  | 910,000.00       | 956,637.50                            |  |
|          |      | 6.125 T-BOND 271115  | 800,000.00       | 821,937.50                            |  |
|          |      | 6.25 T-BOND 300515   | 660,000.00       | 709,035.94                            |  |
| アメリカドル合計 |      |                      | 1,077,610,000.00 | 1,001,270,322.70<br>(162,025,563,619) |  |
| カナダドル    | 国債証券 | 0.5 CAN GOVT 301201  | 1,780,000.00     | 1,600,084.43                          |  |
|          |      | 1 CAN GOVT 270601    | 3,200,000.00     | 3,156,124.86                          |  |
|          |      | 1.25 CAN GOVT 300601 | 2,000,000.00     | 1,875,731.14                          |  |
|          |      | 1.5 CAN GOVT 310601  | 3,580,000.00     | 3,333,273.77                          |  |

|           |      |                          |               |                                  |  |
|-----------|------|--------------------------|---------------|----------------------------------|--|
|           |      | 1.5 CAN GOVT 311201      | 2,770,000.00  | 2,556,208.99                     |  |
|           |      | 1.75 CAN GOVT 531201     | 2,430,000.00  | 1,596,536.73                     |  |
|           |      | 2 CAN GOVT 280601        | 1,750,000.00  | 1,726,335.36                     |  |
|           |      | 2 CAN GOVT 320601        | 1,170,000.00  | 1,101,504.97                     |  |
|           |      | 2 CAN GOVT 511201        | 2,560,000.00  | 1,827,044.53                     |  |
|           |      | 2.25 CAN GOVT 280201     | 2,060,000.00  | 2,045,912.71                     |  |
|           |      | 2.25 CAN GOVT 291201     | 800,000.00    | 783,672.00                       |  |
|           |      | 2.5 CAN GOVT 280501      | 1,600,000.00  | 1,593,418.01                     |  |
|           |      | 2.5 CAN GOVT 321201      | 1,600,000.00  | 1,542,002.19                     |  |
|           |      | 2.75 CAN GOVT 270901     | 3,600,000.00  | 3,606,873.12                     |  |
|           |      | 2.75 CAN GOVT 300301     | 3,000,000.00  | 2,982,765.68                     |  |
|           |      | 2.75 CAN GOVT 300901     | 3,000,000.00  | 2,975,625.69                     |  |
|           |      | 2.75 CAN GOVT 310301     | 2,540,000.00  | 2,513,296.09                     |  |
|           |      | 2.75 CAN GOVT 330601     | 750,000.00    | 731,208.70                       |  |
|           |      | 2.75 CAN GOVT 481201     | 750,000.00    | 642,220.31                       |  |
|           |      | 2.75 CAN GOVT 551201     | 2,180,000.00  | 1,788,793.71                     |  |
|           |      | 2.75 CANADA GOVER 641201 | 900,000.00    | 714,974.07                       |  |
|           |      | 3 CAN GOVT 310901        | 640,000.00    | 639,212.08                       |  |
|           |      | 3 CAN GOVT 340601        | 2,120,000.00  | 2,087,925.48                     |  |
|           |      | 3.25 CAN GOVT 280901     | 1,300,000.00  | 1,313,158.30                     |  |
|           |      | 3.25 CAN GOVT 331201     | 1,370,000.00  | 1,375,927.42                     |  |
|           |      | 3.25 CAN GOVT 341201     | 2,100,000.00  | 2,100,227.43                     |  |
|           |      | 3.25 CAN GOVT 350601     | 3,080,000.00  | 3,071,492.67                     |  |
|           |      | 3.25 CAN GOVT 351201     | 2,900,000.00  | 2,882,197.24                     |  |
|           |      | 3.25 CAN GOVT 360601     | 1,440,000.00  | 1,426,504.19                     |  |
|           |      | 3.5 CAN GOVT 280301      | 1,190,000.00  | 1,205,638.13                     |  |
|           |      | 3.5 CAN GOVT 290901      | 1,740,000.00  | 1,772,794.94                     |  |
|           |      | 3.5 CAN GOVT 340301      | 550,000.00    | 561,333.58                       |  |
|           |      | 3.5 CAN GOVT 451201      | 730,000.00    | 716,355.11                       |  |
|           |      | 3.5 CAN GOVT 571201      | 1,790,000.00  | 1,703,838.11                     |  |
|           |      | 4 CAN GOVT 290301        | 2,120,000.00  | 2,183,722.72                     |  |
|           |      | 4 CAN GOVT 410601        | 610,000.00    | 642,485.46                       |  |
|           |      | 5 CAN GOVT 370601        | 700,000.00    | 801,258.53                       |  |
|           |      | 5.75 CAN GOVT 290601     | 1,100,000.00  | 1,189,608.23                     |  |
|           |      | 5.75 CAN GOVT 330601     | 900,000.00    | 1,044,283.77                     |  |
| カナダドル合計   |      |                          | 70,400,000.00 | 67,411,570.45<br>(7,660,650,865) |  |
| オーストラリアドル | 国債証券 | 1 AUST GOVT 301221       | 2,040,000.00  | 1,759,540.80                     |  |
|           |      | 1 AUST GOVT 311121       | 2,600,000.00  | 2,172,300.00                     |  |
|           |      | 1.25 AUST GOVT 320521    | 2,450,000.00  | 2,041,634.00                     |  |
|           |      | 1.5 AUST GOVT 310621     | 2,150,000.00  | 1,870,650.50                     |  |
|           |      | 1.75 AUST GOVT 321121    | 2,520,000.00  | 2,132,978.40                     |  |

|             |      |                       |               |                                  |  |
|-------------|------|-----------------------|---------------|----------------------------------|--|
|             |      | 1.75 AUST GOVT 510621 | 1,360,000.00  | 695,816.80                       |  |
|             |      | 2.25 AUST GOVT 280521 | 2,000,000.00  | 1,920,500.00                     |  |
|             |      | 2.5 AUST GOVT 300521  | 1,750,000.00  | 1,632,225.00                     |  |
|             |      | 2.75 AUST GOVT 271121 | 1,500,000.00  | 1,464,645.00                     |  |
|             |      | 2.75 AUST GOVT 281121 | 1,870,000.00  | 1,799,818.90                     |  |
|             |      | 2.75 AUST GOVT 291121 | 2,080,000.00  | 1,972,672.00                     |  |
|             |      | 2.75 AUST GOVT 350621 | 2,180,000.00  | 1,867,017.40                     |  |
|             |      | 2.75 AUST GOVT 410521 | 1,080,000.00  | 826,837.20                       |  |
|             |      | 3 AUST GOVT 331121    | 1,930,000.00  | 1,736,922.80                     |  |
|             |      | 3 AUST GOVT 470321    | 1,090,000.00  | 787,252.50                       |  |
|             |      | 3.25 AUST GOVT 290421 | 1,670,000.00  | 1,619,532.60                     |  |
|             |      | 3.25 AUST GOVT 390621 | 1,300,000.00  | 1,093,469.00                     |  |
|             |      | 3.5 AUST GOVT 341221  | 2,340,000.00  | 2,146,645.80                     |  |
|             |      | 3.75 AUST GOVT 340521 | 1,850,000.00  | 1,741,053.50                     |  |
|             |      | 3.75 AUST GOVT 370421 | 1,490,000.00  | 1,357,583.70                     |  |
|             |      | 4.25 AUST GOVT 340621 | 550,000.00    | 535,249.00                       |  |
|             |      | 4.25 AUST GOVT 351221 | 2,100,000.00  | 2,020,851.00                     |  |
|             |      | 4.25 AUST GOVT 360321 | 1,500,000.00  | 1,440,915.00                     |  |
|             |      | 4.25 AUST GOVT 361021 | 1,240,000.00  | 1,186,295.60                     |  |
|             |      | 4.5 AUST GOVT 330421  | 1,690,000.00  | 1,683,831.50                     |  |
|             |      | 4.75 AUST GOVT 371021 | 1,100,000.00  | 1,092,509.00                     |  |
|             |      | 4.75 AUST GOVT 540621 | 790,000.00    | 728,703.90                       |  |
|             |      | 5 AUST GOVT 360621    | 700,000.00    | 712,362.00                       |  |
| オーストラリアドル合計 |      |                       | 46,920,000.00 | 42,039,812.90<br>(4,690,381,925) |  |
| イギリス<br>ポンド | 国債証券 | 0.125 GILT 280131     | 1,130,000.00  | 1,064,496.93                     |  |
|             |      | 0.25 GILT 310731      | 1,710,000.00  | 1,403,771.52                     |  |
|             |      | 0.375 GILT 301022     | 1,090,000.00  | 928,811.32                       |  |
|             |      | 0.5 GILT 290131       | 2,050,000.00  | 1,871,863.28                     |  |
|             |      | 0.5 GILT 611022       | 1,610,000.00  | 393,018.12                       |  |
|             |      | 0.625 GILT 350731     | 1,610,000.00  | 1,134,618.82                     |  |
|             |      | 0.625 GILT 501022     | 1,290,000.00  | 463,652.05                       |  |
|             |      | 0.875 GILT 291022     | 1,040,000.00  | 936,531.29                       |  |
|             |      | 0.875 GILT 330731     | 2,730,000.00  | 2,139,057.45                     |  |
|             |      | 0.875 GILT 460131     | 1,580,000.00  | 730,982.18                       |  |
|             |      | 1 GILT 320131         | 3,100,000.00  | 2,593,368.23                     |  |
|             |      | 1.125 GILT 390131     | 1,590,000.00  | 1,027,617.00                     |  |
|             |      | 1.25 GILT 270722      | 1,890,000.00  | 1,835,460.47                     |  |
|             |      | 1.25 GILT 411022      | 1,800,000.00  | 1,070,643.79                     |  |
|             |      | 1.25 GILT 510731      | 1,620,000.00  | 699,398.06                       |  |
|             |      | 1.5 GILT 470722       | 1,210,000.00  | 623,997.45                       |  |
|             |      | 1.5 GILT 530731       | 1,960,000.00  | 874,088.53                       |  |

|                   |              |              |  |
|-------------------|--------------|--------------|--|
| 1.625 GILT 281022 | 1,900,000.00 | 1,798,378.50 |  |
| 1.625 GILT 541022 | 760,000.00   | 345,821.24   |  |
| 1.625 GILT 711022 | 1,940,000.00 | 747,722.48   |  |
| 1.75 GILT 370907  | 1,960,000.00 | 1,442,952.00 |  |
| 1.75 GILT 490122  | 970,000.00   | 513,334.90   |  |
| 1.75 GILT 570722  | 1,630,000.00 | 740,768.62   |  |
| 2.5 GILT 650722   | 1,120,000.00 | 604,152.62   |  |
| 3.25 GILT 330131  | 2,370,000.00 | 2,214,100.16 |  |
| 3.25 GILT 440122  | 1,590,000.00 | 1,225,821.15 |  |
| 3.5 GILT 450122   | 1,420,000.00 | 1,122,530.13 |  |
| 3.5 GILT 680722   | 1,160,000.00 | 810,260.00   |  |
| 3.75 GILT 380129  | 2,400,000.00 | 2,158,252.48 |  |
| 3.75 GILT 520722  | 1,240,000.00 | 958,440.86   |  |
| 3.75 GILT 531022  | 2,040,000.00 | 1,560,203.91 |  |
| 4 GILT 290522     | 3,030,000.00 | 3,015,217.68 |  |
| 4 GILT 311022     | 2,210,000.00 | 2,180,062.14 |  |
| 4 GILT 600122     | 1,190,000.00 | 941,081.75   |  |
| 4 GILT 631022     | 1,620,000.00 | 1,268,460.00 |  |
| 4.125 GILT 290722 | 2,650,000.00 | 2,646,499.58 |  |
| 4.125 GILT 310307 | 2,380,000.00 | 2,367,484.97 |  |
| 4.125 GILT 330307 | 1,370,000.00 | 1,347,180.97 |  |
| 4.25 GILT 271207  | 860,000.00   | 862,292.76   |  |
| 4.25 GILT 320607  | 1,920,000.00 | 1,916,045.64 |  |
| 4.25 GILT 340731  | 2,670,000.00 | 2,614,544.10 |  |
| 4.25 GILT 360307  | 1,430,000.00 | 1,378,979.73 |  |
| 4.25 GILT 390907  | 1,270,000.00 | 1,180,755.06 |  |
| 4.25 GILT 401207  | 1,070,000.00 | 982,047.38   |  |
| 4.25 GILT 461207  | 730,000.00   | 633,951.12   |  |
| 4.25 GILT 491207  | 1,950,000.00 | 1,666,058.49 |  |
| 4.25 GILT 551207  | 1,840,000.00 | 1,534,335.11 |  |
| 4.375 GILT 280307 | 1,600,000.00 | 1,606,571.36 |  |
| 4.375 GILT 300307 | 3,750,000.00 | 3,772,890.75 |  |
| 4.375 GILT 400131 | 2,510,000.00 | 2,351,672.30 |  |
| 4.375 GILT 540731 | 2,250,000.00 | 1,918,086.70 |  |
| 4.5 GILT 280607   | 2,560,000.00 | 2,577,744.12 |  |
| 4.5 GILT 340907   | 1,090,000.00 | 1,086,490.20 |  |
| 4.5 GILT 350307   | 2,920,000.00 | 2,894,698.45 |  |
| 4.5 GILT 421207   | 1,360,000.00 | 1,259,200.48 |  |
| 4.625 GILT 340131 | 2,310,000.00 | 2,326,701.30 |  |
| 4.625 GILT 370307 | 800,000.00   | 787,120.00   |  |
| 4.75 GILT 301207  | 1,870,000.00 | 1,915,758.15 |  |
| 4.75 GILT 351022  | 3,490,000.00 | 3,506,926.50 |  |
|                   |              |              |  |

|                    |      |                          |                |                                   |  |
|--------------------|------|--------------------------|----------------|-----------------------------------|--|
|                    |      | 4.75 GILT 381207         | 1,220,000.00   | 1,199,870.00                      |  |
|                    |      | 4.75 GILT 431022         | 2,520,000.00   | 2,381,306.70                      |  |
|                    |      | 4.875 GILT 360731        | 810,000.00     | 817,526.43                        |  |
|                    |      | 5.25 GILT 410131         | 1,270,000.00   | 1,292,121.49                      |  |
|                    |      | 6 GILT 281207            | 1,280,000.00   | 1,337,932.80                      |  |
| イギリスポンド合計          |      |                          | 113,310,000.00 | 95,601,729.75<br>(20,365,080,471) |  |
| シンガ<br>ポールド<br>ル   | 国債証券 | 1.625 SINGAPORGOV 310701 | 500,000.00     | 495,000.00                        |  |
|                    |      | 1.875 SINGAPORGOV 500301 | 640,000.00     | 612,480.00                        |  |
|                    |      | 1.875 SINGAPORGOV 511001 | 420,000.00     | 401,940.00                        |  |
|                    |      | 2.25 SINGAPORGOVT 360801 | 730,000.00     | 741,917.25                        |  |
|                    |      | 2.375 SINGAPORGOV 390701 | 570,000.00     | 585,675.00                        |  |
|                    |      | 2.625 SINGAPORGOV 280501 | 250,000.00     | 254,800.00                        |  |
|                    |      | 2.625 SINGAPORGOV 320801 | 500,000.00     | 519,850.00                        |  |
|                    |      | 2.75 SINGAPORGOVT 350301 | 370,000.00     | 391,275.00                        |  |
|                    |      | 2.75 SINGAPORGOVT 420401 | 420,000.00     | 456,120.00                        |  |
|                    |      | 2.75 SINGAPORGOVT 460301 | 660,000.00     | 725,508.30                        |  |
|                    |      | 2.875 SINGAPORGOV 280801 | 800,000.00     | 821,164.00                        |  |
|                    |      | 2.875 SINGAPORGOV 290701 | 1,250,000.00   | 1,293,375.00                      |  |
|                    |      | 2.875SINGAPORGOVT 300901 | 700,000.00     | 732,070.50                        |  |
|                    |      | 3 SINGAPORGOVT 720801    | 530,000.00     | 644,215.00                        |  |
|                    |      | 3.25 SINGAPORGOVT 540601 | 380,000.00     | 466,085.20                        |  |
|                    |      | 3.375 SINGAPORGOV 330901 | 600,000.00     | 654,300.00                        |  |
|                    |      | 3.375 SINGAPORGOV 340501 | 280,000.00     | 307,160.00                        |  |
| シンガポールドル合計         |      |                          | 9,600,000.00   | 10,102,935.25<br>(1,260,038,084)  |  |
| マレーシ<br>アリン<br>ギット | 国債証券 | 2.632 MALAYSIAGOV 310415 | 3,340,000.00   | 3,225,637.49                      |  |
|                    |      | 3.476 MALAYSIAGOV 350702 | 1,600,000.00   | 1,582,393.34                      |  |
|                    |      | 3.502MALAYSIAGOV 270531  | 1,600,000.00   | 1,605,924.80                      |  |
|                    |      | 3.519 MALAYSIAGOV 280420 | 3,000,000.00   | 3,016,337.10                      |  |
|                    |      | 3.582 MALAYSIAGOV 320715 | 900,000.00     | 901,727.19                        |  |
|                    |      | 3.733 MALAYSIAGO 280615  | 2,300,000.00   | 2,321,743.74                      |  |
|                    |      | 3.757 MALAYSIAGOV 400522 | 1,850,000.00   | 1,832,426.05                      |  |
|                    |      | 3.828 MALAYSIAGOV 340705 | 1,500,000.00   | 1,524,123.75                      |  |
|                    |      | 3.844 MALAYSIAGOV 330415 | 1,530,000.00   | 1,555,535.24                      |  |
|                    |      | 3.885 MALAYSIAGOV 290815 | 2,500,000.00   | 2,544,087.00                      |  |
|                    |      | 3.899 MALAYSIAGOV 271116 | 1,700,000.00   | 1,717,013.77                      |  |
|                    |      | 3.917 MALAYSIAGOV 550715 | 1,280,000.00   | 1,238,297.18                      |  |
|                    |      | 4.054 MALAYSIAGOV 390418 | 1,800,000.00   | 1,844,222.58                      |  |
|                    |      | 4.065 MALAYSIAGOV 500615 | 2,200,000.00   | 2,205,261.52                      |  |
|                    |      | 4.18 MALAYSIAGOV 440516  | 1,800,000.00   | 1,858,031.28                      |  |
|                    |      | 4.232MALAYSIAGOV 310630  | 1,770,000.00   | 1,836,008.96                      |  |
|                    |      | 4.254 MALAYSIAGOV 350531 | 400,000.00     | 418,912.16                        |  |

|                    |      |                          |               |                                  |  |
|--------------------|------|--------------------------|---------------|----------------------------------|--|
|                    |      | 4.457 MALAYSIAGOV 530331 | 1,710,000.00  | 1,815,302.65                     |  |
|                    |      | 4.498 MALAYSIAGOV 300415 | 1,100,000.00  | 1,144,640.09                     |  |
|                    |      | 4.504 MALAYSIAGOV 290430 | 1,700,000.00  | 1,756,322.53                     |  |
|                    |      | 4.642 MALAYSIAGOV 331107 | 2,100,000.00  | 2,243,306.73                     |  |
|                    |      | 4.696 MALAYSIAGOV 421015 | 1,550,000.00  | 1,697,322.69                     |  |
|                    |      | 4.736 MALAYSIAGOV 460315 | 1,100,000.00  | 1,214,032.82                     |  |
|                    |      | 4.762 MALAYSIAGOV 370407 | 2,100,000.00  | 2,281,363.98                     |  |
|                    |      | 4.893 MALAYSIAGOV 380608 | 1,700,000.00  | 1,876,574.07                     |  |
|                    |      | 4.921 MALAYSIAGOV 480706 | 1,240,000.00  | 1,402,214.81                     |  |
|                    |      | 4.935 MALAYSIAGOV 430930 | 600,000.00    | 675,429.06                       |  |
| マレーシアリングット合計       |      |                          | 45,970,000.00 | 47,334,192.58<br>(1,854,279,126) |  |
| ニュー<br>ジーラン<br>ドル  | 国債証券 | 0.25 NZ GOVT 280515      | 1,400,000.00  | 1,322,264.83                     |  |
|                    |      | 1.5 NZ GOVT 310515       | 1,000,000.00  | 896,084.73                       |  |
|                    |      | 1.75 NZ GOVT 410515      | 600,000.00    | 409,119.14                       |  |
|                    |      | 2 NZ GOVT 320515         | 1,300,000.00  | 1,165,044.97                     |  |
|                    |      | 2.75 NZ GOVT 370415      | 730,000.00    | 622,268.79                       |  |
|                    |      | 2.75 NZ GOVT 510515      | 430,000.00    | 293,177.04                       |  |
|                    |      | 3 NZ GOVT 290420         | 800,000.00    | 789,259.12                       |  |
|                    |      | 3.5 NZ GOVT 330414       | 750,000.00    | 723,567.10                       |  |
|                    |      | 4.25 NZ GOVT 340515      | 700,000.00    | 702,468.69                       |  |
|                    |      | 4.25 NZ GOVT 360515      | 880,000.00    | 870,628.00                       |  |
|                    |      | 4.5 NZ GOVT 300515       | 2,350,000.00  | 2,418,796.48                     |  |
|                    |      | 4.5 NZ GOVT 350515       | 1,210,000.00  | 1,228,257.20                     |  |
|                    |      | 5 NZ GOVT 540515         | 320,000.00    | 319,103.34                       |  |
| ニュージーランドドル合計       |      |                          | 12,470,000.00 | 11,760,039.43<br>(1,074,279,601) |  |
| スウェー<br>デンク<br>ローネ | 国債証券 | 0.125 SWD GOVT 310512    | 6,260,000.00  | 5,637,954.62                     |  |
|                    |      | 0.75 SWD GOVT 280512     | 4,000,000.00  | 3,901,054.12                     |  |
|                    |      | 0.75 SWD GOVT 291112     | 7,700,000.00  | 7,339,126.17                     |  |
|                    |      | 1.75 SWD GOVT 331111     | 9,730,000.00  | 9,269,103.81                     |  |
|                    |      | 2.25 SWD GOVT 320601     | 4,400,000.00  | 4,369,222.00                     |  |
|                    |      | 2.25 SWD GOVT 350511     | 2,200,000.00  | 2,145,706.37                     |  |
|                    |      | 2.5 SWD GOVT 361015      | 4,200,000.00  | 4,145,652.00                     |  |
|                    |      | 3.5 SWD GOVT 390330      | 3,350,000.00  | 3,626,881.18                     |  |
| スウェーデンクローネ合計       |      |                          | 41,840,000.00 | 40,434,700.27<br>(670,811,677)   |  |
| ノル<br>ウェーク<br>ローネ  | 国債証券 | 1.25 NORWE GOVT 310917   | 3,100,000.00  | 2,666,676.04                     |  |
|                    |      | 1.375 NORWE GOVT 300819  | 5,480,000.00  | 4,869,678.70                     |  |
|                    |      | 1.75 NORWE GOVT 290906   | 3,500,000.00  | 3,223,230.74                     |  |
|                    |      | 2 NORWE GOVT 280426      | 2,650,000.00  | 2,532,715.29                     |  |
|                    |      | 2.125 NORWE GOVT 320518  | 4,010,000.00  | 3,570,871.67                     |  |

|             |      |                          |                  |                                   |  |
|-------------|------|--------------------------|------------------|-----------------------------------|--|
|             |      | 3 NORWE GOVT 330815      | 4,000,000.00     | 3,711,225.20                      |  |
|             |      | 3.5 NORWE GOVT 421006    | 2,130,000.00     | 1,943,431.17                      |  |
|             |      | 3.625 NORWE GOVT 340413  | 3,800,000.00     | 3,657,025.00                      |  |
|             |      | 3.625 NORWE GOVT 390531  | 2,000,000.00     | 1,878,706.00                      |  |
|             |      | 3.75 NORWE GOVT 350612   | 5,600,000.00     | 5,408,210.13                      |  |
|             |      | 4.125 NORWE GOVT 360603  | 2,200,000.00     | 2,180,970.00                      |  |
| ノルウェークローネ合計 |      |                          | 38,470,000.00    | 35,642,739.94<br>(585,610,217)    |  |
| デンマーククローネ   | 国債証券 | 0 DMK GOVT 311115        | 3,400,000.00     | 2,988,570.65                      |  |
|             |      | 0.25 DMK GOVT 521115     | 5,200,000.00     | 2,591,185.94                      |  |
|             |      | 0.5 DMK GOVT 271115      | 6,900,000.00     | 6,740,691.90                      |  |
|             |      | 0.5 DMK GOVT 291115      | 3,800,000.00     | 3,575,893.06                      |  |
|             |      | 2.25 DMK GOVT 331115     | 5,660,000.00     | 5,535,497.99                      |  |
|             |      | 2.25 DMK GOVT 351115     | 2,000,000.00     | 1,921,658.24                      |  |
|             |      | 4.5 DMK GOVT 391115      | 6,380,000.00     | 7,515,504.10                      |  |
| デンマーククローネ合計 |      |                          | 33,340,000.00    | 30,869,001.88<br>(758,760,066)    |  |
| メキシコペソ      | 国債証券 | 10 MEXICAN BONOS 361120  | 8,340,000.00     | 8,915,023.40                      |  |
|             |      | 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 32,750,000.00    | 32,861,564.84                     |  |
|             |      | 7.5 MEXICAN BONOS 330526 | 29,480,000.00    | 27,619,563.77                     |  |
|             |      | 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 39,000,000.00    | 37,944,589.80                     |  |
|             |      | 7.75 MEXICAN BONO 341123 | 33,260,000.00    | 31,065,121.04                     |  |
|             |      | 7.75 MEXICAN BONO 421113 | 37,170,000.00    | 31,962,282.64                     |  |
|             |      | 8 MEXICAN BONOS 320415   | 4,500,000.00     | 4,366,675.08                      |  |
|             |      | 8 MEXICAN BONOS 350524   | 4,000,000.00     | 3,749,370.96                      |  |
|             |      | 8 MEXICAN BONOS 360221   | 15,000,000.00    | 14,061,900.00                     |  |
|             |      | 8 MEXICAN BONOS 471107   | 18,670,000.00    | 16,152,666.58                     |  |
|             |      | 8 MEXICAN BONOS 530731   | 30,380,000.00    | 25,980,066.11                     |  |
|             |      | 8 MEXICAN BONOS 550429   | 6,200,000.00     | 5,286,878.32                      |  |
|             |      | 8.5 MEXICAN BONOS 290301 | 43,580,000.00    | 44,183,436.56                     |  |
|             |      | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 25,420,000.00    | 25,736,065.92                     |  |
|             |      | 8.5 MEXICAN BONOS 300228 | 27,000,000.00    | 27,177,760.71                     |  |
|             |      | 8.5 MEXICAN BONOS 381118 | 20,480,000.00    | 19,373,530.93                     |  |
| メキシコペソ合計    |      |                          | 375,230,000.00   | 356,436,496.66<br>(3,273,085,061) |  |
| 韓国ウォン       | 国債証券 | 1.125 KOREA TREAS 390910 | 400,000,000.00   | 273,858,592.00                    |  |
|             |      | 1.375 KOREA TREAS 300610 | 800,000,000.00   | 723,992,448.00                    |  |
|             |      | 1.5 KOREA TREASUR 400910 | 650,000,000.00   | 457,075,222.00                    |  |
|             |      | 1.5 KOREA TREASUR 500310 | 1,100,000,000.00 | 632,561,072.00                    |  |
|             |      | 1.875 KOREA TREAS 290610 | 500,000,000.00   | 473,385,125.00                    |  |
|             |      | 1.875 KOREA TREAS 410910 | 450,000,000.00   | 328,080,865.00                    |  |
|             |      | 1.875 KOREA TREAS 510310 | 800,000,000.00   | 496,569,344.00                    |  |

|         |      |                          |                   |                                      |  |
|---------|------|--------------------------|-------------------|--------------------------------------|--|
|         |      | 2 KOREA TREASURY 310610  | 300,000,000.00    | 272,356,557.00                       |  |
|         |      | 2 KOREA TREASURY 460310  | 500,000,000.00    | 343,291,560.00                       |  |
|         |      | 2 KOREA TREASURY 490310  | 900,000,000.00    | 591,518,763.00                       |  |
|         |      | 2.125 KOREA TREAS 470310 | 500,000,000.00    | 346,728,115.00                       |  |
|         |      | 2.375 KOREA TREAS 271210 | 1,300,000,000.00  | 1,279,029,063.00                     |  |
|         |      | 2.375 KOREA TREAS 281210 | 900,000,000.00    | 871,479,909.00                       |  |
|         |      | 2.375 KOREA TREAS 380910 | 100,000,000.00    | 82,001,482.00                        |  |
|         |      | 2.5 KOREA TREASUR 520310 | 650,000,000.00    | 460,419,596.00                       |  |
|         |      | 2.625 KOREA TREAS 280610 | 900,000,000.00    | 882,620,307.00                       |  |
|         |      | 2.625 KOREA TREAS 300310 | 700,000,000.00    | 668,325,343.00                       |  |
|         |      | 2.625 KOREA TREAS 480310 | 700,000,000.00    | 527,481,269.00                       |  |
|         |      | 2.625 KOREA TREAS 550310 | 1,700,000,000.00  | 1,216,544,888.00                     |  |
|         |      | 2.625 KOREA TREAS 550910 | 500,000,000.00    | 357,025,235.00                       |  |
|         |      | 2.75 KOREA TREASU 281210 | 800,000,000.00    | 781,634,048.00                       |  |
|         |      | 2.75 KOREA TREASU 441210 | 700,000,000.00    | 556,008,446.00                       |  |
|         |      | 2.75 KOREA TREASU 450910 | 200,000,000.00    | 159,007,212.00                       |  |
|         |      | 2.75 KOREA TREASU 540910 | 300,000,000.00    | 221,318,514.00                       |  |
|         |      | 3 KOREA TREASURY 280310  | 600,000,000.00    | 593,280,654.00                       |  |
|         |      | 3 KOREA TREASURY 341210  | 850,000,000.00    | 778,660,639.00                       |  |
|         |      | 3.125 KOREA TREAS 520910 | 420,000,000.00    | 336,885,225.00                       |  |
|         |      | 3.25 KOREA TREASU 290310 | 300,000,000.00    | 295,605,762.00                       |  |
|         |      | 3.25 KOREA TREASU 330610 | 350,000,000.00    | 331,463,352.00                       |  |
|         |      | 3.25 KOREA TREASU 351210 | 600,000,000.00    | 553,441,584.00                       |  |
|         |      | 3.25 KOREA TREASU 420910 | 150,000,000.00    | 131,227,432.00                       |  |
|         |      | 3.25 KOREA TREASU 530310 | 800,000,000.00    | 655,893,688.00                       |  |
|         |      | 3.25 KOREA TREASU 540310 | 1,200,000,000.00  | 983,199,648.00                       |  |
|         |      | 3.375 KOREA TREAS 310310 | 400,000,000.00    | 388,884,704.00                       |  |
|         |      | 3.375 KOREA TREAS 320610 | 200,000,000.00    | 192,450,818.00                       |  |
|         |      | 3.5 KOREA TREASUR 280910 | 400,000,000.00    | 398,340,352.00                       |  |
|         |      | 3.5 KOREA TREASUR 340610 | 250,000,000.00    | 238,551,525.00                       |  |
|         |      | 3.5 KOREA TREASUR 560310 | 600,000,000.00    | 515,377,584.00                       |  |
|         |      | 3.625 KOREA TREAS 530910 | 350,000,000.00    | 307,121,780.00                       |  |
|         |      | 3.75 KOREA TREASU 331210 | 300,000,000.00    | 292,385,271.00                       |  |
|         |      | 3.875 KOREA TREAS 430910 | 300,000,000.00    | 282,438,633.00                       |  |
|         |      | 4 KOREA TREASURY 311210  | 300,000,000.00    | 298,816,353.00                       |  |
|         |      | 4.125 KOREA TREAS 331210 | 600,000,000.00    | 599,077,764.00                       |  |
|         |      | 4.25 KOREA TREASU 321210 | 1,180,000,000.00  | 1,188,914,664.00                     |  |
|         |      | 4.75 KOREA TREASU 301210 | 1,000,000,000.00  | 1,027,761,600.00                     |  |
|         |      | 5.5 KOREA TREASUR 291210 | 400,000,000.00    | 420,317,600.00                       |  |
| 韓国ウォン合計 |      |                          | 27,900,000,000.00 | 23,812,409,607.00<br>(2,488,611,115) |  |
|         | 国債証券 | 1 ISRAEL FIXED BO 300331 | 2,100,000.00      | 1,934,347.38                         |  |

|               |      |                          |               |                                  |  |
|---------------|------|--------------------------|---------------|----------------------------------|--|
| イスラエル<br>シェケル |      | 1.3 ISRAEL FIXED 320430  | 3,170,000.00  | 2,825,086.78                     |  |
|               |      | 1.5 ISRAEL FIXED 370531  | 2,800,000.00  | 2,236,714.11                     |  |
|               |      | 2.25 ISRAEL FIXED 280928 | 2,000,000.00  | 1,988,142.10                     |  |
|               |      | 2.8 ISRAEL FIXED 521129  | 2,670,000.00  | 2,091,885.90                     |  |
|               |      | 3.75 ISRAEL FIXED 270930 | 2,620,000.00  | 2,709,018.69                     |  |
|               |      | 3.75 ISRAEL FIXED 290228 | 1,970,000.00  | 2,016,454.37                     |  |
|               |      | 3.75 ISRAEL FIXED 470331 | 2,060,000.00  | 1,974,820.75                     |  |
|               |      | 4 ISRAEL FIXED B0 350330 | 3,500,000.00  | 3,634,263.50                     |  |
|               |      | 4.1 ISRAEL FIXED 280731  | 2,400,000.00  | 2,526,873.12                     |  |
|               |      | 4.15 ISRAEL FIXED 351031 | 620,000.00    | 660,391.69                       |  |
|               |      | 4.6 ISRAEL FIXED 290831  | 2,200,000.00  | 2,366,425.16                     |  |
|               |      | 5.5 ISRAEL FIXED 420131  | 2,550,000.00  | 3,060,672.43                     |  |
| イスラエルシェケル合計   |      |                          | 30,660,000.00 | 30,025,095.98<br>(1,627,387,224) |  |
| ポーランド<br>ズロチ  | 国債証券 | 1.25 POLAND 301025       | 4,400,000.00  | 3,824,922.59                     |  |
|               |      | 1.75 POLAND 320425       | 5,260,000.00  | 4,438,107.26                     |  |
|               |      | 2.5 POLAND 270725        | 5,300,000.00  | 5,230,100.15                     |  |
|               |      | 2.75 POLAND 280425       | 2,990,000.00  | 2,923,921.29                     |  |
|               |      | 2.75 POLAND 291025       | 5,160,000.00  | 4,901,763.87                     |  |
|               |      | 4 POLAND 310725          | 1,700,000.00  | 1,635,910.00                     |  |
|               |      | 4.5 POLAND 300725        | 2,500,000.00  | 2,489,417.92                     |  |
|               |      | 4.5 POLAND 310125        | 3,550,000.00  | 3,520,208.50                     |  |
|               |      | 4.75 POLAND 290725       | 5,500,000.00  | 5,557,644.40                     |  |
|               |      | 5 POLAND 300125          | 5,000,000.00  | 5,084,499.50                     |  |
|               |      | 5 POLAND 341025          | 3,600,000.00  | 3,555,140.07                     |  |
|               |      | 5 POLAND 351025          | 5,090,000.00  | 4,976,137.71                     |  |
|               |      | 5.75 POLAND 290425       | 3,160,000.00  | 3,277,452.77                     |  |
|               |      | 6 POLAND 331025          | 5,200,000.00  | 5,486,656.76                     |  |
|               |      | 7.5 POLAND 280725        | 4,200,000.00  | 4,472,649.72                     |  |
| ポーランドズロチ合計    |      |                          | 62,610,000.00 | 61,374,532.51<br>(2,630,911,397) |  |
| 中国元           | 国債証券 | 1.26 CHINA GOVT 290525   | 20,000,000.00 | 19,982,471.60                    |  |
|               |      | 1.32 CHINA GOVT 290225   | 36,000,000.00 | 36,062,625.60                    |  |
|               |      | 1.4 CHINA GOVT 281125    | 25,000,000.00 | 25,070,330.00                    |  |
|               |      | 1.42 CHINA GOVT 271115   | 12,000,000.00 | 12,037,891.20                    |  |
|               |      | 1.42 CHINA GOVT 280815   | 40,000,000.00 | 40,116,040.00                    |  |
|               |      | 1.43 CHINA GOVT 300125   | 57,000,000.00 | 57,145,236.00                    |  |
|               |      | 1.44 CHINA GOVT 270915   | 24,000,000.00 | 24,070,010.40                    |  |
|               |      | 1.45 CHINA GOVT 280225   | 33,000,000.00 | 33,134,290.20                    |  |
|               |      | 1.46 CHINA GOVT 280525   | 24,000,000.00 | 24,108,604.80                    |  |
|               |      | 1.49 CHINA GOVT 311225   | 25,000,000.00 | 24,981,651.00                    |  |
|               |      | 1.5 CHINA GOVT 310415    | 34,000,000.00 | 34,090,100.00                    |  |

|                        |               |               |  |
|------------------------|---------------|---------------|--|
| 1.54 CHINA GOVT 310125 | 43,000,000.00 | 43,195,662.90 |  |
| 1.55 CHINA GOVT 300725 | 39,000,000.00 | 39,289,965.00 |  |
| 1.61 CHINA GOVT 350215 | 31,000,000.00 | 30,799,938.40 |  |
| 1.62 CHINA GOVT 270815 | 46,000,000.00 | 46,243,409.00 |  |
| 1.63 CHINA GOVT 301025 | 27,000,000.00 | 27,226,465.20 |  |
| 1.65 CHINA GOVT 350515 | 27,000,000.00 | 26,901,108.45 |  |
| 1.66 CHINA GOVT 321225 | 27,000,000.00 | 27,154,410.30 |  |
| 1.66 CHINA GOVT 330325 | 14,000,000.00 | 14,082,626.60 |  |
| 1.67 CHINA GOVT 350525 | 20,000,000.00 | 19,955,389.00 |  |
| 1.72 CHINA GOVT 360515 | 4,000,000.00  | 3,996,473.80  |  |
| 1.74 CHINA GOVT 291015 | 32,000,000.00 | 32,403,968.00 |  |
| 1.75 CHINA GOVT 360225 | 29,000,000.00 | 29,028,567.90 |  |
| 1.78 CHINA GOVT 320915 | 18,000,000.00 | 18,257,148.00 |  |
| 1.78 CHINA GOVT 351115 | 36,000,000.00 | 36,116,049.60 |  |
| 1.79 CHINA GOVT 320325 | 30,000,000.00 | 30,471,090.00 |  |
| 1.83 CHINA GOVT 350825 | 19,000,000.00 | 19,150,423.00 |  |
| 1.87 CHINA GOVT 310915 | 26,000,000.00 | 26,527,620.60 |  |
| 1.91 CHINA GOVT 290715 | 32,000,000.00 | 32,572,137.60 |  |
| 1.92 CHINA GOVT 550115 | 12,000,000.00 | 11,134,847.04 |  |
| 2.04 CHINA GOVT 341125 | 20,000,000.00 | 20,586,918.00 |  |
| 2.05 CHINA GOVT 290415 | 34,000,000.00 | 34,716,652.00 |  |
| 2.11 CHINA GOVT 340825 | 31,000,000.00 | 32,120,054.80 |  |
| 2.12 CHINA GOVT 310625 | 40,000,000.00 | 41,284,344.00 |  |
| 2.27 CHINA GOVT 340525 | 23,000,000.00 | 24,115,909.40 |  |
| 2.28 CHINA GOVT 310325 | 20,000,000.00 | 20,775,238.00 |  |
| 2.35 CHINA GOVT 340225 | 36,000,000.00 | 37,924,527.60 |  |
| 2.37 CHINA GOVT 290115 | 18,000,000.00 | 18,501,568.20 |  |
| 2.38 CHINA GOVT 560115 | 10,000,000.00 | 10,255,490.00 |  |
| 2.4 CHINA GOVT 280715  | 60,000,000.00 | 61,450,152.00 |  |
| 2.44 CHINA GOVT 271015 | 33,000,000.00 | 33,510,830.10 |  |
| 2.48 CHINA GOVT 280925 | 24,000,000.00 | 24,682,435.20 |  |
| 2.5 CHINA GOVT 270725  | 38,000,000.00 | 38,507,254.40 |  |
| 2.52 CHINA GOVT 330825 | 23,000,000.00 | 24,483,863.40 |  |
| 2.54 CHINA GOVT 301225 | 15,000,000.00 | 15,736,113.00 |  |
| 2.55 CHINA GOVT 281015 | 49,000,000.00 | 50,473,738.70 |  |
| 2.6 CHINA GOVT 300915  | 39,000,000.00 | 40,911,062.40 |  |
| 2.6 CHINA GOVT 320901  | 25,000,000.00 | 26,578,922.50 |  |
| 2.62 CHINA GOVT 280415 | 25,000,000.00 | 25,655,775.00 |  |
| 2.62 CHINA GOVT 290925 | 14,000,000.00 | 14,586,502.00 |  |
| 2.62 CHINA GOVT 300625 | 26,000,000.00 | 27,257,672.00 |  |
| 2.64 CHINA GOVT 280115 | 32,000,000.00 | 32,743,846.40 |  |
| 2.67 CHINA GOVT 330525 | 15,000,000.00 | 16,107,625.50 |  |
|                        |               |               |  |

|       |      |                        |                  |                                      |  |
|-------|------|------------------------|------------------|--------------------------------------|--|
|       |      | 2.67 CHINA GOVT 331125 | 27,000,000.00    | 29,058,347.70                        |  |
|       |      | 2.68 CHINA GOVT 300521 | 32,000,000.00    | 33,567,395.20                        |  |
|       |      | 2.69 CHINA GOVT 320815 | 21,000,000.00    | 22,385,529.60                        |  |
|       |      | 2.75 CHINA GOVT 290615 | 12,000,000.00    | 12,522,403.20                        |  |
|       |      | 2.75 CHINA GOVT 320217 | 16,000,000.00    | 17,096,585.60                        |  |
|       |      | 2.76 CHINA GOVT 320515 | 10,000,000.00    | 10,708,292.00                        |  |
|       |      | 2.79 CHINA GOVT 291215 | 7,000,000.00     | 7,356,444.90                         |  |
|       |      | 2.8 CHINA GOVT 290324  | 14,000,000.00    | 14,597,669.80                        |  |
|       |      | 2.8 CHINA GOVT 321115  | 18,000,000.00    | 19,403,397.00                        |  |
|       |      | 2.85 CHINA GOVT 270604 | 29,000,000.00    | 29,508,607.80                        |  |
|       |      | 2.88 CHINA GOVT 330225 | 25,000,000.00    | 27,181,620.00                        |  |
|       |      | 2.91 CHINA GOVT 281014 | 4,000,000.00     | 4,160,309.60                         |  |
|       |      | 3 CHINA GOVT 531015    | 16,000,000.00    | 18,508,203.20                        |  |
|       |      | 3.01 CHINA GOVT 280513 | 21,000,000.00    | 21,770,271.60                        |  |
|       |      | 3.02 CHINA GOVT 310527 | 4,000,000.00     | 4,315,490.00                         |  |
|       |      | 3.12 CHINA GOVT 521025 | 9,000,000.00     | 10,537,969.50                        |  |
|       |      | 3.19 CHINA GOVT 530415 | 10,000,000.00    | 11,874,477.00                        |  |
|       |      | 3.28 CHINA GOVT 271203 | 18,000,000.00    | 18,611,775.00                        |  |
|       |      | 3.32 CHINA GOVT 520415 | 12,000,000.00    | 14,493,501.60                        |  |
|       |      | 3.39 CHINA GOVT 500316 | 19,000,000.00    | 22,941,221.30                        |  |
|       |      | 3.53 CHINA GOVT 511018 | 10,000,000.00    | 12,463,472.00                        |  |
|       |      | 3.72 CHINA GOVT 510412 | 11,000,000.00    | 14,044,604.20                        |  |
|       |      | 3.81 CHINA GOVT 500914 | 20,000,000.00    | 25,694,700.00                        |  |
|       |      | 3.86 CHINA GOVT 490722 | 16,000,000.00    | 20,614,811.20                        |  |
|       |      | 4.08 CHINA GOVT 481022 | 12,000,000.00    | 15,880,375.20                        |  |
| 中国元合計 |      |                        | 1,885,000,000.00 | 1,957,570,519.99<br>(46,499,347,103) |  |
| ユーロ   | 国債証券 | 0 AUSTRIA GOVT 281020  | 530,000.00       | 499,338.70                           |  |
|       |      | 0 AUSTRIA GOVT 300220  | 1,070,000.00     | 971,959.64                           |  |
|       |      | 0 AUSTRIA GOVT 310220  | 1,270,000.00     | 1,119,919.02                         |  |
|       |      | 0 AUSTRIA GOVT 401020  | 630,000.00       | 388,241.91                           |  |
|       |      | 0 BEL GOVT 271022      | 800,000.00       | 773,639.61                           |  |
|       |      | 0 BEL GOVT 311022      | 920,000.00       | 790,446.44                           |  |
|       |      | 0 BUND 271115          | 2,180,000.00     | 2,106,920.95                         |  |
|       |      | 0 BUND 281115          | 1,530,000.00     | 1,442,477.88                         |  |
|       |      | 0 BUND 290815          | 2,380,000.00     | 2,201,234.63                         |  |
|       |      | 0 BUND 300215          | 2,270,000.00     | 2,072,013.43                         |  |
|       |      | 0 BUND 300815          | 2,250,000.00     | 2,027,870.55                         |  |
|       |      | 0 BUND 300815          | 750,000.00       | 676,018.50                           |  |
|       |      | 0 BUND 310215          | 2,200,000.00     | 1,955,805.50                         |  |
|       |      | 0 BUND 310815          | 1,520,000.00     | 1,331,990.44                         |  |
|       |      | 0 BUND 310815          | 850,000.00       | 745,026.70                           |  |

|                          |              |              |  |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| 0 BUND 320215            | 2,310,000.00 | 1,995,152.77 |  |
| 0 BUND 350515            | 1,760,000.00 | 1,372,002.28 |  |
| 0 BUND 360515            | 1,910,000.00 | 1,438,642.08 |  |
| 0 BUND 500815            | 4,130,000.00 | 1,834,608.97 |  |
| 0 BUND 500815            | 350,000.00   | 156,050.65   |  |
| 0 BUND 520815            | 2,570,000.00 | 1,066,905.30 |  |
| 0 FINNISH GOVT 300915    | 710,000.00   | 633,543.65   |  |
| 0 IRISH GOVT 311018      | 570,000.00   | 495,160.18   |  |
| 0 NETH GOVT 290115       | 1,280,000.00 | 1,200,096.00 |  |
| 0 NETH GOVT 300715       | 1,450,000.00 | 1,305,455.30 |  |
| 0 NETH GOVT 310715       | 1,300,000.00 | 1,137,605.64 |  |
| 0 NETH GOVT 380115       | 890,000.00   | 622,473.56   |  |
| 0 NETH GOVT 520115       | 1,720,000.00 | 722,454.18   |  |
| 0 O.A.T 291125           | 3,510,000.00 | 3,194,480.83 |  |
| 0 O.A.T 301125           | 3,580,000.00 | 3,155,766.42 |  |
| 0 O.A.T 311125           | 3,870,000.00 | 3,293,989.20 |  |
| 0 O.A.T 320525           | 3,970,000.00 | 3,315,347.00 |  |
| 0 SPAIN GOVT 280131      | 2,550,000.00 | 2,449,842.68 |  |
| 0.1 BEL GOVT 300622      | 170,000.00   | 153,096.22   |  |
| 0.1 SPAIN GOVT 310430    | 2,000,000.00 | 1,760,574.80 |  |
| 0.125 FINNISH GOV 310915 | 500,000.00   | 435,267.00   |  |
| 0.125 FINNISH GOV 360415 | 500,000.00   | 371,937.58   |  |
| 0.125 FINNISH GOV 520415 | 330,000.00   | 133,740.13   |  |
| 0.2 IRISH GOVT 301018    | 700,000.00   | 631,423.45   |  |
| 0.25 AUSTRIA GOVT 361020 | 550,000.00   | 410,504.60   |  |
| 0.25 BUND 280815         | 2,590,000.00 | 2,470,549.20 |  |
| 0.25 BUND 290215         | 2,300,000.00 | 2,169,223.72 |  |
| 0.25 FINNISH GOVT 400915 | 390,000.00   | 248,311.92   |  |
| 0.25 ITALY GOVT 280315   | 2,100,000.00 | 2,015,842.50 |  |
| 0.25 NETH GOVT 290715    | 1,210,000.00 | 1,128,340.12 |  |
| 0.3 PORTUGUESE 311017    | 800,000.00   | 703,938.40   |  |
| 0.35 BEL GOVT 320622     | 1,400,000.00 | 1,201,436.04 |  |
| 0.35 IRISH GOVT 321018   | 400,000.00   | 344,069.00   |  |
| 0.4 BEL GOVT 400622      | 1,040,000.00 | 663,591.18   |  |
| 0.4 IRISH GOVT 350515    | 550,000.00   | 441,603.38   |  |
| 0.45 ITALY GOVT 290215   | 990,000.00   | 932,924.76   |  |
| 0.475 PORTUGUESE 301018  | 920,000.00   | 838,611.29   |  |
| 0.5 AUSTRIA GOVT 290220  | 1,070,000.00 | 1,012,772.12 |  |
| 0.5 BUND 270815          | 1,760,000.00 | 1,720,973.76 |  |
| 0.5 BUND 280215          | 2,000,000.00 | 1,936,349.00 |  |
| 0.5 FINNISH GOVT 270915  | 100,000.00   | 97,540.44    |  |
| 0.5 FINNISH GOVT 280915  | 660,000.00   | 630,856.05   |  |
|                          |              |              |  |

|                          |              |              |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 0.5 FINNISH GOVT 290915  | 760,000.00   | 709,831.17   |
| 0.5 FINNISH GOVT 430415  | 400,000.00   | 244,277.08   |
| 0.5 ITALY GOVT 280715    | 1,000,000.00 | 956,959.50   |
| 0.5 NETH GOVT 320715     | 1,090,000.00 | 955,380.64   |
| 0.5 NETH GOVT 400115     | 1,040,000.00 | 731,342.28   |
| 0.5 O.A.T 290525         | 4,480,000.00 | 4,201,120.00 |
| 0.5 O.A.T 400525         | 2,670,000.00 | 1,701,970.80 |
| 0.5 O.A.T 440625         | 1,730,000.00 | 949,513.96   |
| 0.5 O.A.T 720525         | 1,040,000.00 | 271,325.86   |
| 0.5 SPAIN GOVT 300430    | 1,990,000.00 | 1,833,359.57 |
| 0.5 SPAIN GOVT 311031    | 2,380,000.00 | 2,108,665.72 |
| 0.55 IRISH GOVT 410422   | 260,000.00   | 176,671.31   |
| 0.6 ITALY GOVT 310801    | 1,690,000.00 | 1,498,788.75 |
| 0.6 SPAIN GOVT 291031    | 1,880,000.00 | 1,757,271.72 |
| 0.65 BEL GOVT 710622     | 530,000.00   | 162,255.16   |
| 0.7 AUSTRIA GOVT 710420  | 500,000.00   | 178,401.00   |
| 0.7 PORTUGUESE 271015    | 700,000.00   | 684,013.40   |
| 0.7 SPAIN GOVT 320430    | 2,060,000.00 | 1,821,523.02 |
| 0.75 AUSTRIA GOVT 280220 | 1,150,000.00 | 1,116,204.37 |
| 0.75 AUSTRIA GOVT 510320 | 720,000.00   | 383,759.00   |
| 0.75 FINNISH GOVT 310415 | 400,000.00   | 363,976.68   |
| 0.75 NETH GOVT 270715    | 850,000.00   | 834,803.27   |
| 0.75 NETH GOVT 280715    | 1,200,000.00 | 1,157,823.00 |
| 0.75 O.A.T 280225        | 6,600,000.00 | 6,394,212.00 |
| 0.75 O.A.T 280525        | 5,460,000.00 | 5,264,818.65 |
| 0.75 O.A.T 281125        | 4,500,000.00 | 4,295,566.11 |
| 0.75 O.A.T 520525        | 2,190,000.00 | 985,248.15   |
| 0.75 O.A.T 530525        | 2,440,000.00 | 1,064,794.65 |
| 0.75 SLOVAKIA GOV 300409 | 690,000.00   | 639,891.02   |
| 0.8 BEL GOVT 270622      | 940,000.00   | 924,468.33   |
| 0.8 BEL GOVT 280622      | 1,350,000.00 | 1,303,822.68 |
| 0.8 SPAIN GOVT 270730    | 2,100,000.00 | 2,060,488.50 |
| 0.8 SPAIN GOVT 290730    | 1,740,000.00 | 1,644,562.74 |
| 0.85 AUSTRIA GOVT 200630 | 270,000.00   | 84,154.00    |
| 0.85 SPAIN GOVT 370730   | 1,190,000.00 | 910,303.59   |
| 0.9 AUSTRIA GOVT 320220  | 910,000.00   | 820,041.04   |
| 0.9 BEL GOVT 290622      | 2,440,000.00 | 2,317,554.60 |
| 0.9 IRISH GOVT 280515    | 920,000.00   | 893,257.67   |
| 0.9 ITALY GOVT 310401    | 2,120,000.00 | 1,925,784.68 |
| 0.9 PORTUGUESE 351012    | 600,000.00   | 492,170.10   |
| 0.95 ITALY GOVT 270915   | 2,020,000.00 | 1,980,508.49 |
| 0.95 ITALY GOVT 300801   | 990,000.00   | 915,903.45   |
| 0.95 ITALY GOVT 311201   | 1,480,000.00 | 1,325,449.52 |

|                          |              |              |  |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| 0.95 ITALY GOVT 320601   | 2,240,000.00 | 1,980,137.60 |  |
| 0.95 ITALY GOVT 370301   | 1,440,000.00 | 1,098,644.40 |  |
| 1 BEL GOVT 310622        | 1,620,000.00 | 1,481,259.57 |  |
| 1 BUND 380515            | 2,480,000.00 | 1,977,795.04 |  |
| 1 PORTUGUESE 520412      | 550,000.00   | 297,676.50   |  |
| 1 SLOVAKIA GOVERN 320514 | 660,000.00   | 589,053.00   |  |
| 1 SPAIN GOVT 420730      | 1,440,000.00 | 970,943.64   |  |
| 1 SPAIN GOVT 501031      | 1,580,000.00 | 862,695.92   |  |
| 1.1 IRISH GOVT 290515    | 820,000.00   | 786,777.84   |  |
| 1.125 FINNISH GOV 340415 | 650,000.00   | 565,229.60   |  |
| 1.15 PORTUGUESE 420411   | 450,000.00   | 318,239.32   |  |
| 1.2 SPAIN GOVT 401031    | 1,320,000.00 | 966,185.88   |  |
| 1.25 BEL GOVT 330422     | 630,000.00   | 562,527.16   |  |
| 1.25 BUND 480815         | 3,280,000.00 | 2,201,264.56 |  |
| 1.25 O.A.T 340525        | 4,020,000.00 | 3,440,124.04 |  |
| 1.25 O.A.T 360525        | 4,630,000.00 | 3,743,107.29 |  |
| 1.25 O.A.T 380525        | 2,340,000.00 | 1,779,713.91 |  |
| 1.25 SPAIN GOVT 301031   | 2,000,000.00 | 1,879,523.00 |  |
| 1.3 IRISH GOVT 330515    | 420,000.00   | 381,116.40   |  |
| 1.3 OBL 271015           | 670,000.00   | 659,800.64   |  |
| 1.3 OBL 271015           | 1,150,000.00 | 1,132,660.87 |  |
| 1.35 IRISH GOVT 310318   | 480,000.00   | 452,718.14   |  |
| 1.35 ITALY GOVT 300401   | 2,220,000.00 | 2,102,283.39 |  |
| 1.375 FINNISH GOV 470415 | 420,000.00   | 279,036.65   |  |
| 1.4 BEL GOVT 530622      | 740,000.00   | 407,049.26   |  |
| 1.4 SPAIN GOVT 280430    | 1,100,000.00 | 1,077,067.84 |  |
| 1.4 SPAIN GOVT 280730    | 1,620,000.00 | 1,581,527.82 |  |
| 1.45 BEL GOVT 370622     | 640,000.00   | 522,116.44   |  |
| 1.45 ITALY GOVT 360301   | 1,050,000.00 | 870,386.47   |  |
| 1.45 SPAIN GOVT 271031   | 1,850,000.00 | 1,823,166.80 |  |
| 1.45 SPAIN GOVT 290430   | 2,070,000.00 | 2,004,790.05 |  |
| 1.45 SPAIN GOVT 711031   | 580,000.00   | 276,102.93   |  |
| 1.5 AUSTRIA GOVT 470220  | 650,000.00   | 453,609.81   |  |
| 1.5 AUSTRIA GOVT 861102  | 340,000.00   | 163,833.04   |  |
| 1.5 FINNISH GOVT 320915  | 630,000.00   | 579,888.41   |  |
| 1.5 IRISH GOVT 500515    | 570,000.00   | 387,590.02   |  |
| 1.5 ITALY GOVT 450430    | 1,100,000.00 | 723,030.00   |  |
| 1.5 O.A.T 310525         | 5,260,000.00 | 4,914,804.61 |  |
| 1.5 O.A.T 500525         | 1,890,000.00 | 1,112,888.70 |  |
| 1.6 BEL GOVT 470622      | 650,000.00   | 424,982.54   |  |
| 1.65 ITALY GOVT 301201   | 1,680,000.00 | 1,590,356.88 |  |
| 1.65 ITALY GOVT 320301   | 2,020,000.00 | 1,870,981.57 |  |
|                          |              |              |  |

|                          |              |              |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 1.65 PORTUGUESE 320716   | 500,000.00   | 467,597.11   |
| 1.7 BEL GOVT 500622      | 880,000.00   | 554,293.45   |
| 1.7 BUND 320815          | 1,800,000.00 | 1,704,211.20 |
| 1.7 IRISH GOVT 370515    | 650,000.00   | 566,153.90   |
| 1.7 ITALY GOVT 510901    | 1,300,000.00 | 784,108.00   |
| 1.75 O.A.T 390625        | 2,490,000.00 | 1,968,157.00 |
| 1.75 O.A.T 660525        | 1,350,000.00 | 690,400.12   |
| 1.8 BUND 530815          | 2,660,000.00 | 1,906,035.62 |
| 1.8 BUND 530815          | 710,000.00   | 510,350.84   |
| 1.8 ITALY GOVT 410301    | 950,000.00   | 723,556.81   |
| 1.85 AUSTRIA GOVT 490523 | 750,000.00   | 547,778.43   |
| 1.85 SPAIN GOVT 350730   | 1,480,000.00 | 1,324,403.08 |
| 1.875 SLOVAKIA GO 370309 | 300,000.00   | 255,044.28   |
| 1.9 BEL GOVT 380622      | 670,000.00   | 560,464.40   |
| 1.9 SCHATS 270916        | 4,200,000.00 | 4,168,735.20 |
| 1.9 SPAIN GOVT 521031    | 1,300,000.00 | 866,160.29   |
| 1.95 PORTUGUESE 290615   | 1,200,000.00 | 1,178,903.10 |
| 1.95 SPAIN GOVT 300730   | 2,030,000.00 | 1,971,287.83 |
| 2 IRISH GOVT 450218      | 880,000.00   | 709,834.40   |
| 2 ITALY GOVT 280201      | 2,250,000.00 | 2,227,800.37 |
| 2 NETH GOVT 540115       | 1,150,000.00 | 858,632.02   |
| 2 O.A.T 321125           | 4,210,000.00 | 3,930,013.95 |
| 2 O.A.T 480525           | 1,860,000.00 | 1,275,127.65 |
| 2 SCHATS 271216          | 2,010,000.00 | 1,994,633.05 |
| 2 SLOVAKIA GOVERN 471017 | 480,000.00   | 335,041.20   |
| 2.05 ITALY GOVT 270801   | 1,820,000.00 | 1,810,026.85 |
| 2.1 AUSTRIA GOVT 170920  | 450,000.00   | 270,713.25   |
| 2.1 BUND 291115          | 2,120,000.00 | 2,089,175.20 |
| 2.1 OBL 290412           | 1,430,000.00 | 1,413,277.22 |
| 2.125 PORTUGUESE 281017  | 820,000.00   | 813,176.80   |
| 2.15 BEL GOVT 660622     | 540,000.00   | 321,333.71   |
| 2.15 ITALY GOVT 520901   | 770,000.00   | 511,549.50   |
| 2.15 ITALY GOVT 720301   | 600,000.00   | 359,234.40   |
| 2.2 BUND 340215          | 2,050,000.00 | 1,971,700.25 |
| 2.2 OBL 280413           | 2,310,000.00 | 2,296,784.49 |
| 2.2 OBL 301010           | 2,100,000.00 | 2,067,514.05 |
| 2.25 BEL GOVT 570622     | 660,000.00   | 432,304.45   |
| 2.25 ITALY GOVT 360901   | 1,240,000.00 | 1,099,593.25 |
| 2.25 PORTUGUESE 340418   | 630,000.00   | 596,811.34   |
| 2.3 BUND 330215          | 3,640,000.00 | 3,552,123.12 |
| 2.35 ITALY GOVT 290115   | 1,220,000.00 | 1,207,663.36 |
| 2.35 SPAIN GOVT 290331   | 540,000.00   | 535,470.75   |
| 2.35 SPAIN GOVT 330730   | 1,130,000.00 | 1,082,721.38 |

|                          |              |              |  |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| 2.4 AUSTRIA GOVT 340523  | 740,000.00   | 710,264.95   |  |
| 2.4 BUND 301115          | 1,470,000.00 | 1,458,581.77 |  |
| 2.4 IRISH GOVT 300515    | 380,000.00   | 377,011.50   |  |
| 2.4 ITALY GOVT 290315    | 1,400,000.00 | 1,386,186.20 |  |
| 2.4 O.A.T 280924         | 3,890,000.00 | 3,863,742.50 |  |
| 2.4 O.A.T 290924         | 850,000.00   | 839,811.68   |  |
| 2.4 OBL 281019           | 2,710,000.00 | 2,702,201.97 |  |
| 2.4 OBL 300418           | 2,050,000.00 | 2,037,728.70 |  |
| 2.4 SPAIN GOVT 280531    | 2,200,000.00 | 2,191,830.14 |  |
| 2.45 ITALY GOVT 330901   | 1,650,000.00 | 1,566,020.36 |  |
| 2.45 ITALY GOVT 500901   | 1,210,000.00 | 879,134.57   |  |
| 2.5 AUSTRIA GOVT 291020  | 700,000.00   | 696,363.67   |  |
| 2.5 BUND 321115          | 1,840,000.00 | 1,819,691.99 |  |
| 2.5 BUND 350215          | 2,500,000.00 | 2,440,977.50 |  |
| 2.5 BUND 350215          | 1,300,000.00 | 1,269,898.50 |  |
| 2.5 BUND 440704          | 2,400,000.00 | 2,141,673.60 |  |
| 2.5 BUND 460815          | 2,360,000.00 | 2,072,452.88 |  |
| 2.5 BUND 540815          | 2,020,000.00 | 1,690,557.18 |  |
| 2.5 FINNISH GOVT 300415  | 40,000.00    | 39,686.98    |  |
| 2.5 ITALY GOVT 321201    | 1,550,000.00 | 1,489,868.91 |  |
| 2.5 NETH GOVT 300115     | 1,050,000.00 | 1,046,078.25 |  |
| 2.5 NETH GOVT 310115     | 200,000.00   | 198,652.60   |  |
| 2.5 NETH GOVT 330115     | 1,070,000.00 | 1,053,219.19 |  |
| 2.5 NETH GOVT 330715     | 890,000.00   | 872,761.59   |  |
| 2.5 NETH GOVT 340715     | 1,040,000.00 | 1,013,591.28 |  |
| 2.5 NETH GOVT 350715     | 930,000.00   | 899,306.74   |  |
| 2.5 O.A.T 270924         | 130,000.00   | 129,761.20   |  |
| 2.5 O.A.T 300525         | 5,150,000.00 | 5,085,924.98 |  |
| 2.5 O.A.T 430525         | 2,320,000.00 | 1,883,596.40 |  |
| 2.5 OBL 291011           | 950,000.00   | 948,565.50   |  |
| 2.5 OBL 310416           | 1,820,000.00 | 1,811,192.56 |  |
| 2.5 SPAIN GOVT 270531    | 1,880,000.00 | 1,879,246.90 |  |
| 2.55 SPAIN GOVT 321031   | 1,850,000.00 | 1,810,047.77 |  |
| 2.6 BEL GOVT 301022      | 850,000.00   | 842,768.42   |  |
| 2.6 BUND 330815          | 2,240,000.00 | 2,221,189.60 |  |
| 2.6 BUND 340815          | 2,170,000.00 | 2,140,902.47 |  |
| 2.6 BUND 350815          | 2,370,000.00 | 2,325,176.77 |  |
| 2.6 BUND 410515          | 1,850,000.00 | 1,719,900.13 |  |
| 2.6 IRISH GOVT 341018    | 540,000.00   | 527,843.11   |  |
| 2.625 FINNISH GOV 320415 | 550,000.00   | 543,102.72   |  |
| 2.625 FINNISH GOV 420704 | 350,000.00   | 310,409.73   |  |
| 2.65 ITALY GOVT 271201   | 1,490,000.00 | 1,490,182.82 |  |
|                          |              |              |  |

|                          |              |              |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 2.65 ITALY GOVT 280615   | 1,750,000.00 | 1,748,162.50 |
| 2.7 BEL GOVT 291022      | 650,000.00   | 649,842.66   |
| 2.7 ITALY GOVT 271015    | 1,200,000.00 | 1,200,756.72 |
| 2.7 ITALY GOVT 301001    | 1,000,000.00 | 990,121.25   |
| 2.7 ITALY GOVT 470301    | 1,250,000.00 | 995,136.25   |
| 2.7 O.A.T 310225         | 4,560,000.00 | 4,512,481.36 |
| 2.7 SPAIN GOVT 300131    | 1,780,000.00 | 1,779,116.48 |
| 2.7 SPAIN GOVT 481031    | 1,600,000.00 | 1,323,222.78 |
| 2.75 BEL GOVT 390422     | 610,000.00   | 554,826.73   |
| 2.75 FINNISH GOVT 280704 | 590,000.00   | 592,102.40   |
| 2.75 FINNISH GOVT 380415 | 340,000.00   | 320,522.37   |
| 2.75 NETH GOVT 360715    | 830,000.00   | 813,539.44   |
| 2.75 NETH GOVT 470115    | 1,450,000.00 | 1,313,078.31 |
| 2.75 O.A.T 271025        | 520,000.00   | 520,624.10   |
| 2.75 O.A.T 290225        | 4,480,000.00 | 4,480,369.60 |
| 2.75 O.A.T 300225        | 4,200,000.00 | 4,188,122.40 |
| 2.8 AUSTRIA GOVT 320920  | 370,000.00   | 368,787.60   |
| 2.8 ITALY GOVT 281201    | 1,960,000.00 | 1,964,970.56 |
| 2.8 ITALY GOVT 290615    | 760,000.00   | 760,203.30   |
| 2.8 ITALY GOVT 670301    | 740,000.00   | 530,116.07   |
| 2.85 BEL GOVT 341022     | 1,570,000.00 | 1,527,507.03 |
| 2.85 ITALY GOVT 310201   | 1,400,000.00 | 1,391,531.75 |
| 2.875 FINNISH GOV 290415 | 400,000.00   | 402,553.48   |
| 2.875 PORTUGUESE 331014  | 310,000.00   | 307,806.05   |
| 2.875 PORTUGUESE 341020  | 500,000.00   | 493,214.37   |
| 2.9 AUSTRIA GOVT 290523  | 750,000.00   | 756,277.50   |
| 2.9 AUSTRIA GOVT 330220  | 1,580,000.00 | 1,580,230.99 |
| 2.9 AUSTRIA GOVT 340220  | 940,000.00   | 936,220.26   |
| 2.9 BUND 360215          | 2,970,000.00 | 2,978,102.16 |
| 2.9 BUND 560815          | 1,900,000.00 | 1,717,907.80 |
| 2.9 SPAIN GOVT 461031    | 1,660,000.00 | 1,442,932.16 |
| 2.95 AUSTRIA GOVT 350220 | 1,100,000.00 | 1,092,835.21 |
| 2.95 FINNISH GOVT 550415 | 430,000.00   | 367,746.75   |
| 2.95 ITALY GOVT 300701   | 1,120,000.00 | 1,121,359.34 |
| 2.95 ITALY GOVT 380901   | 1,250,000.00 | 1,151,806.25 |
| 3 BEL GOVT 330622        | 1,670,000.00 | 1,662,791.42 |
| 3 BEL GOVT 340622        | 1,060,000.00 | 1,047,330.55 |
| 3 FINNISH GOVT 330915    | 530,000.00   | 531,378.63   |
| 3 FINNISH GOVT 340915    | 720,000.00   | 716,816.69   |
| 3 FINNISH GOVT 350915    | 250,000.00   | 247,215.87   |
| 3 IRISH GOVT 431018      | 400,000.00   | 380,152.00   |
| 3 ITALY GOVT 290801      | 1,750,000.00 | 1,761,758.25 |
| 3 ITALY GOVT 291001      | 1,700,000.00 | 1,708,338.50 |

|                          |              |              |  |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| 3 0.A.T 330525           | 3,730,000.00 | 3,678,640.69 |  |
| 3 0.A.T 341125           | 3,510,000.00 | 3,407,832.67 |  |
| 3 0.A.T 490625           | 1,650,000.00 | 1,354,507.26 |  |
| 3 0.A.T 540525           | 1,830,000.00 | 1,431,723.37 |  |
| 3 PORTUGUESE 350615      | 630,000.00   | 624,202.13   |  |
| 3 SPAIN GOVT 330131      | 810,000.00   | 810,928.01   |  |
| 3.1 BEL GOVT 350622      | 950,000.00   | 934,792.04   |  |
| 3.1 IRISH GOVT 360618    | 350,000.00   | 351,983.80   |  |
| 3.1 ITALY GOVT 400301    | 900,000.00   | 826,544.25   |  |
| 3.1 SPAIN GOVT 310730    | 1,890,000.00 | 1,915,653.34 |  |
| 3.15 AUSTRIA GOVT 440620 | 730,000.00   | 694,857.55   |  |
| 3.15 AUSTRIA GOVT 531020 | 750,000.00   | 683,760.75   |  |
| 3.15 IRISH GOVT 551018   | 290,000.00   | 266,388.20   |  |
| 3.15 ITALY GOVT 311115   | 1,800,000.00 | 1,807,146.90 |  |
| 3.15 ITALY GOVT 330315   | 1,500,000.00 | 1,491,434.24 |  |
| 3.15 SPAIN GOVT 330430   | 1,760,000.00 | 1,777,824.40 |  |
| 3.15 SPAIN GOVT 350430   | 2,120,000.00 | 2,112,676.12 |  |
| 3.2 AUSTRIA GOVT 360220  | 600,000.00   | 604,234.38   |  |
| 3.2 AUSTRIA GOVT 390715  | 440,000.00   | 433,686.44   |  |
| 3.2 FINNISH GOVT 450415  | 290,000.00   | 272,786.20   |  |
| 3.2 0.A.T 350525         | 4,230,000.00 | 4,147,130.07 |  |
| 3.2 SPAIN GOVT 351031    | 2,190,000.00 | 2,183,214.49 |  |
| 3.25 BUND 420704         | 1,660,000.00 | 1,662,739.00 |  |
| 3.25 ITALY GOVT 320715   | 1,320,000.00 | 1,326,448.20 |  |
| 3.25 ITALY GOVT 321115   | 1,390,000.00 | 1,393,670.99 |  |
| 3.25 ITALY GOVT 380301   | 1,000,000.00 | 954,338.00   |  |
| 3.25 ITALY GOVT 460901   | 1,690,000.00 | 1,478,152.15 |  |
| 3.25 NETH GOVT 440115    | 1,030,000.00 | 1,016,579.85 |  |
| 3.25 0.A.T 450525        | 2,500,000.00 | 2,221,897.50 |  |
| 3.25 0.A.T 550525        | 1,770,000.00 | 1,446,454.62 |  |
| 3.25 PORTUGUESE 360613   | 320,000.00   | 320,420.00   |  |
| 3.25 SPAIN GOVT 340430   | 1,580,000.00 | 1,594,971.29 |  |
| 3.3 BEL GOVT 540622      | 760,000.00   | 644,331.04   |  |
| 3.3 SPAIN GOVT 360430    | 2,020,000.00 | 2,022,919.30 |  |
| 3.35 FINNISH GOVT 360915 | 200,000.00   | 202,273.80   |  |
| 3.35 ITALY GOVT 290701   | 1,790,000.00 | 1,817,386.45 |  |
| 3.35 ITALY GOVT 350301   | 1,820,000.00 | 1,808,803.81 |  |
| 3.375 PORTUGUESE 400615  | 330,000.00   | 324,074.87   |  |
| 3.4 BEL GOVT 360622      | 600,000.00   | 599,213.59   |  |
| 3.4 BUND 470515          | 250,000.00   | 251,848.79   |  |
| 3.4 ITALY GOVT 280401    | 850,000.00   | 860,418.45   |  |
| 3.45 AUSTRIA GOVT 301020 | 680,000.00   | 700,501.93   |  |
|                          |              |              |  |

|                          |              |              |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 3.45 BEL GOVT 420622     | 100,000.00   | 94,730.55    |
| 3.45 BEL GOVT 430622     | 510,000.00   | 480,319.54   |
| 3.45 ITALY GOVT 310715   | 1,050,000.00 | 1,070,624.62 |
| 3.45 ITALY GOVT 360201   | 1,730,000.00 | 1,714,812.75 |
| 3.45 ITALY GOVT 480301   | 1,320,000.00 | 1,179,367.20 |
| 3.45 SPAIN GOVT 341031   | 1,930,000.00 | 1,971,571.23 |
| 3.45 SPAIN GOVT 430730   | 1,670,000.00 | 1,604,611.29 |
| 3.45 SPAIN GOVT 660730   | 1,160,000.00 | 1,026,062.99 |
| 3.5 BEL GOVT 550622      | 680,000.00   | 594,298.01   |
| 3.5 ITALY GOVT 300301    | 1,540,000.00 | 1,575,198.24 |
| 3.5 ITALY GOVT 310215    | 1,510,000.00 | 1,543,026.72 |
| 3.5 NETH GOVT 560115     | 580,000.00   | 585,987.05   |
| 3.5 O.A.T 331125         | 3,620,000.00 | 3,669,467.30 |
| 3.5 O.A.T 351125         | 4,110,000.00 | 4,104,193.90 |
| 3.5 PORTUGUESE 380618    | 400,000.00   | 403,985.48   |
| 3.5 SPAIN GOVT 290531    | 2,250,000.00 | 2,303,379.22 |
| 3.5 SPAIN GOVT 410131    | 1,020,000.00 | 1,001,834.85 |
| 3.55 FINNISH GOVT 410415 | 310,000.00   | 310,179.61   |
| 3.55 SPAIN GOVT 331031   | 1,820,000.00 | 1,878,567.60 |
| 3.6 ITALY GOVT 351001    | 1,620,000.00 | 1,629,478.94 |
| 3.6 O.A.T 420525         | 1,570,000.00 | 1,494,857.44 |
| 3.625 PORTUGUESE 540612  | 350,000.00   | 334,218.19   |
| 3.625 SLOVAKIA GO 290116 | 700,000.00   | 714,630.07   |
| 3.625 SLOVAKIA GO 330608 | 770,000.00   | 790,905.42   |
| 3.625 SLOVAKIA GO 371104 | 350,000.00   | 348,051.79   |
| 3.65 ITALY GOVT 350801   | 1,400,000.00 | 1,415,988.84 |
| 3.7 ITALY GOVT 300615    | 1,300,000.00 | 1,337,942.45 |
| 3.75 AUSTRIA GOVT 560320 | 270,000.00   | 272,092.33   |
| 3.75 BEL GOVT 450622     | 900,000.00   | 871,815.98   |
| 3.75 NETH GOVT 420115    | 1,460,000.00 | 1,538,550.19 |
| 3.75 O.A.T 560525        | 1,730,000.00 | 1,546,506.24 |
| 3.75 SLOVAKIA GOV 350223 | 600,000.00   | 616,077.78   |
| 3.8 AUSTRIA GOVT 620126  | 290,000.00   | 295,333.24   |
| 3.8 ITALY GOVT 280801    | 1,820,000.00 | 1,860,022.71 |
| 3.8 ITALY GOVT 360701    | 590,000.00   | 599,728.98   |
| 3.8 O.A.T 370625         | 760,000.00   | 769,065.66   |
| 3.85 ITALY GOVT 291215   | 1,050,000.00 | 1,084,190.83 |
| 3.85 ITALY GOVT 340701   | 1,360,000.00 | 1,403,276.15 |
| 3.85 ITALY GOVT 350201   | 1,600,000.00 | 1,646,960.00 |
| 3.85 ITALY GOVT 401001   | 1,330,000.00 | 1,318,024.68 |
| 3.85 ITALY GOVT 490901   | 1,160,000.00 | 1,095,169.92 |
| 3.875 PORTUGUESE 300215  | 300,000.00   | 312,893.70   |
| 3.9 SPAIN GOVT 390730    | 1,240,000.00 | 1,283,854.95 |

|                          |              |              |  |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| 3.95 ITALY GOVT 411001   | 940,000.00   | 934,749.38   |  |
| 3.95 SPAIN GOVT 561031   | 470,000.00   | 462,551.09   |  |
| 4 BEL GOVT 320328        | 1,120,000.00 | 1,183,621.60 |  |
| 4 BUND 370104            | 1,730,000.00 | 1,896,888.77 |  |
| 4 ITALY GOVT 301115      | 2,050,000.00 | 2,136,766.25 |  |
| 4 ITALY GOVT 350430      | 850,000.00   | 885,320.64   |  |
| 4 ITALY GOVT 370201      | 2,460,000.00 | 2,545,284.51 |  |
| 4 NETH GOVT 370115       | 1,440,000.00 | 1,564,810.56 |  |
| 4 O.A.T 381025           | 2,190,000.00 | 2,239,394.34 |  |
| 4 O.A.T 550425           | 1,760,000.00 | 1,656,323.68 |  |
| 4 O.A.T 600425           | 1,570,000.00 | 1,455,118.39 |  |
| 4 SPAIN GOVT 541031      | 1,220,000.00 | 1,221,979.93 |  |
| 4.05 ITALY GOVT 371030   | 1,590,000.00 | 1,642,597.99 |  |
| 4.1 ITALY GOVT 290201    | 1,300,000.00 | 1,343,030.00 |  |
| 4.1 ITALY GOVT 460430    | 700,000.00   | 693,697.37   |  |
| 4.1 O.A.T 460525         | 800,000.00   | 794,698.79   |  |
| 4.1 PORTUGUESE 370415    | 830,000.00   | 891,306.04   |  |
| 4.1 PORTUGUESE 450215    | 530,000.00   | 557,176.01   |  |
| 4.15 AUSTRIA GOVT 370315 | 1,110,000.00 | 1,206,901.89 |  |
| 4.15 ITALY GOVT 391001   | 1,300,000.00 | 1,339,074.75 |  |
| 4.2 ITALY GOVT 340301    | 1,350,000.00 | 1,426,977.00 |  |
| 4.2 SPAIN GOVT 370131    | 1,830,000.00 | 1,965,932.40 |  |
| 4.25 BEL GOVT 410328     | 1,130,000.00 | 1,188,604.96 |  |
| 4.25 BUND 390704         | 1,240,000.00 | 1,393,323.52 |  |
| 4.3 ITALY GOVT 541001    | 1,300,000.00 | 1,288,469.00 |  |
| 4.35 BEL GOVT 560622     | 610,000.00   | 616,794.54   |  |
| 4.35 ITALY GOVT 331101   | 1,590,000.00 | 1,696,826.53 |  |
| 4.4 ITALY GOVT 330501    | 1,700,000.00 | 1,820,611.60 |  |
| 4.4 O.A.T 570525         | 690,000.00   | 688,580.32   |  |
| 4.45 ITALY GOVT 430901   | 1,090,000.00 | 1,140,070.78 |  |
| 4.5 ITALY GOVT 531001    | 790,000.00   | 809,817.15   |  |
| 4.5 O.A.T 410425         | 2,860,000.00 | 3,045,445.26 |  |
| 4.65 ITALY GOVT 551001   | 530,000.00   | 553,235.56   |  |
| 4.7 SPAIN GOVT 410730    | 1,330,000.00 | 1,490,700.02 |  |
| 4.75 BUND 280704         | 920,000.00   | 960,279.89   |  |
| 4.75 BUND 340704         | 1,350,000.00 | 1,542,796.20 |  |
| 4.75 BUND 400704         | 1,890,000.00 | 2,232,371.03 |  |
| 4.75 ITALY GOVT 280901   | 1,560,000.00 | 1,627,114.32 |  |
| 4.75 ITALY GOVT 440901   | 1,350,000.00 | 1,465,639.65 |  |
| 4.75 O.A.T 350425        | 2,810,000.00 | 3,088,014.93 |  |
| 4.9 SPAIN GOVT 400730    | 1,730,000.00 | 1,977,856.06 |  |
| 5 BEL GOVT 350328        | 1,320,000.00 | 1,491,749.16 |  |
|                          |              |              |  |

|       |                          |                |                                      |  |
|-------|--------------------------|----------------|--------------------------------------|--|
|       | 5 ITALY GOVT 340801      | 2,250,000.00   | 2,506,190.62                         |  |
|       | 5 ITALY GOVT 390801      | 1,750,000.00   | 1,960,698.25                         |  |
|       | 5 ITALY GOVT 400901      | 1,910,000.00   | 2,140,053.77                         |  |
|       | 5.15 SPAIN GOVT 281031   | 1,100,000.00   | 1,162,825.62                         |  |
|       | 5.15 SPAIN GOVT 441031   | 1,170,000.00   | 1,382,226.53                         |  |
|       | 5.25 ITALY GOVT 291101   | 1,400,000.00   | 1,508,255.00                         |  |
|       | 5.5 BEL GOVT 280328      | 1,360,000.00   | 1,426,594.57                         |  |
|       | 5.5 BUND 310104          | 2,340,000.00   | 2,627,688.25                         |  |
|       | 5.5 NETH GOVT 280115     | 1,200,000.00   | 1,254,045.00                         |  |
|       | 5.5 O.A.T 290425         | 3,390,000.00   | 3,641,368.50                         |  |
|       | 5.625 BUND 280104        | 1,850,000.00   | 1,934,888.17                         |  |
|       | 5.75 ITALY GOVT 330201   | 1,950,000.00   | 2,241,924.75                         |  |
|       | 5.75 O.A.T 321025        | 2,760,000.00   | 3,170,475.48                         |  |
|       | 5.75 SPAIN GOVT 320730   | 2,250,000.00   | 2,605,674.37                         |  |
|       | 6 ITALY GOVT 310501      | 2,240,000.00   | 2,542,755.48                         |  |
|       | 6 SPAIN GOVT 290131      | 2,050,000.00   | 2,222,930.82                         |  |
|       | 6.25 AUSTRIA GOVT 270715 | 900,000.00     | 934,404.48                           |  |
|       | 6.25 BUND 300104         | 1,250,000.00   | 1,404,047.37                         |  |
|       | 6.5 BUND 270704          | 850,000.00     | 884,070.12                           |  |
|       | 6.5 ITALY GOVT 271101    | 1,660,000.00   | 1,743,873.16                         |  |
| ユーロ合計 |                          | 602,610,000.00 | 560,756,538.60<br>(103,016,583,706)  |  |
| 合計    |                          |                | 360,481,381,257<br>(360,481,381,257) |  |

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

| 種類         | 銘柄数        | 組入債券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|------------|------------|--------------|-------------------------|
| アメリカドル     | 国債証券 266銘柄 | 100.00%      | 44.95%                  |
| カナダドル      | 国債証券 39銘柄  | 100.00%      | 2.13%                   |
| オーストラリアドル  | 国債証券 28銘柄  | 100.00%      | 1.30%                   |
| イギリスポンド    | 国債証券 64銘柄  | 100.00%      | 5.65%                   |
| シンガポールドル   | 国債証券 17銘柄  | 100.00%      | 0.35%                   |
| マレーシアリンギット | 国債証券 27銘柄  | 100.00%      | 0.51%                   |
| ニュージーランドドル | 国債証券 13銘柄  | 100.00%      | 0.30%                   |
| スウェーデンクローネ | 国債証券 8銘柄   | 100.00%      | 0.19%                   |
| ノルウェークローネ  | 国債証券 11銘柄  | 100.00%      | 0.16%                   |
| デンマーククローネ  | 国債証券 7銘柄   | 100.00%      | 0.21%                   |
| メキシコペソ     | 国債証券 16銘柄  | 100.00%      | 0.91%                   |
| 韓国ウォン      | 国債証券 46銘柄  | 100.00%      | 0.69%                   |
| イスラエルシェケル  | 国債証券 13銘柄  | 100.00%      | 0.45%                   |

|          |      |       |         |        |
|----------|------|-------|---------|--------|
| ポーランドズロチ | 国債証券 | 15銘柄  | 100.00% | 0.73%  |
| 中国元      | 国債証券 | 78銘柄  | 100.00% | 12.90% |
| ユーロ      | 国債証券 | 417銘柄 | 100.00% | 28.58% |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

## ２【ファンドの現況】

### 【ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）】

#### 【純資産額計算書】

2026年 6月30日現在

(単位：円)

|                      |                 |
|----------------------|-----------------|
| I 資産総額               | 37,493,755,669  |
| II 負債総額              | 490,155,935     |
| III 純資産総額（I－II）      | 37,003,599,734  |
| IV 発行済口数             | 33,247,422,700口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 1.1130          |
| （10,000口当たり）         | (11,130)        |

(参考)

### TOPIXマザーファンド

#### 純資産額計算書

2026年 6月30日現在

(単位：円)

|                      |                   |
|----------------------|-------------------|
| I 資産総額               | 3,005,856,662,149 |
| II 負債総額              | 80,108,294,328    |
| III 純資産総額（I－II）      | 2,925,748,367,821 |
| IV 発行済口数             | 568,487,358,513口  |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 5.1465            |
| （10,000口当たり）         | (51,465)          |

### 外国株式インデックスマザーファンド

#### 純資産額計算書

2026年 6月30日現在

(単位：円)

|                      |                    |
|----------------------|--------------------|
| I 資産総額               | 15,843,026,388,825 |
| II 負債総額              | 3,858,543,338      |
| III 純資産総額（I－II）      | 15,839,167,845,487 |
| IV 発行済口数             | 1,489,827,294,276口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 10.6315            |
| （10,000口当たり）         | (106,315)          |

### 国内債券インデックスマザーファンド

#### 純資産額計算書

2026年 6月30日現在

(単位：円)

|        |                 |
|--------|-----------------|
| I 資産総額 | 157,941,575,324 |
|--------|-----------------|

|                      |                  |
|----------------------|------------------|
| II 負債総額              | 1,771,250,726    |
| III 純資産総額（I－II）      | 156,170,324,598  |
| IV 発行済口数             | 189,614,642,404口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 0.8236           |
| （10,000口当たり）         | （8,236）          |

## 日本短期債券マザーファンド

### 純資産額計算書

2026年 6月30日現在

（単位：円）

|                      |                 |
|----------------------|-----------------|
| I 資産総額               | 15,723,775,807  |
| II 負債総額              | 495,341,509     |
| III 純資産総額（I－II）      | 15,228,434,298  |
| IV 発行済口数             | 13,486,919,026口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 1.1291          |
| （10,000口当たり）         | （11,291）        |

## 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

2026年 6月30日現在

（単位：円）

|                      |                  |
|----------------------|------------------|
| I 資産総額               | 368,263,124,170  |
| II 負債総額              | 4,543,350,548    |
| III 純資産総額（I－II）      | 363,719,773,622  |
| IV 発行済口数             | 329,981,325,821口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 1.1022           |
| （10,000口当たり）         | （11,022）         |

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### （1）名義書換等

該当事項はありません。

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

### （2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

### （3）譲渡制限の内容

該当事項はありません。

#### （４）受益権の譲渡

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

#### （５）受益権の譲渡の対抗要件

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

#### （６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### （1）資本金の額等

2026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

当社は監査等委員会設置会社です。会社の機関としては、株主総会の他、取締役会、代表取締役、監査等委員会を設置しています。

###### 株主総会

株主総会は、取締役・会計監査人の選任・解任、剰余金の配当の承認、定款変更の承認等を行います。

###### 取締役会

取締役会は、株主総会で選任された取締役で構成され、経営の基本方針の決定、内部統制システムの整備、取締役の職務の執行の監督、代表取締役の選定・解職などを行います。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・決定する任意の機関として、経営会議を設置しています。

###### 代表取締役

代表取締役は、取締役会の決議により取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から選定され、当社を代表します。

###### 監査等委員会

監査等委員会は、株主総会で選任された監査等委員である取締役で構成され、取締役の職務執行について監査を行うほか、各監査等委員である取締役は、取締役として取締役会の決議に参加します。

###### ・投資運用の意思決定機構

###### ①投資環境見通しの策定

各運用部は国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

###### ②運用戦略の決定

①で策定された投資環境見通しに沿って、各運用部は運用戦略を決定します。

###### ③運用計画の決定

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

###### ④ポートフォリオの構築

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

###### ⑤運用部門による自律的な運用管理

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、運用部門内の管理担当部署は逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また、運用モニタリング会議を通じて運用状況のモニタリングを行い、運用部門内での自律的牽制により運用改善を図ります。

###### ⑥管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署は、（a）運用に関するパフォーマンス測定・分析のほか、（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。

###### ⑦ファンドに係る法人等の管理

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

#### ⑧運用・管理に関する監督

内部監査担当部署は、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。

2026年 6月30日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

| 商品分類       | 本 数<br>(本) | 純資産総額<br>(百万円) |
|------------|------------|----------------|
| 追加型株式投資信託  | 788        | 64,380,039     |
| 追加型公社債投資信託 | 17         | 1,655,821      |
| 単位型株式投資信託  | 43         | 261,385        |
| 単位型公社債投資信託 | 34         | 97,287         |
| 合 計        | 882        | 66,394,531     |

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、百万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41期事業年度（自 2025年4月1日 至 2026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：百万円）

|            | 第40期<br>(2025年3月31日現在) | 第41期<br>(2026年3月31日現在) |
|------------|------------------------|------------------------|
| (資産の部)     |                        |                        |
| 流動資産       |                        |                        |
| 現金及び預金     | 37,354                 | 38,323                 |
| 有価証券       | 700                    | 3,347                  |
| 前払費用       | 770                    | 937                    |
| 未収入金       | 25                     | 0                      |
| 未収委託者報酬    | 24,418                 | 29,726                 |
| 未収収益 ※2    | 1,005                  | ※2 1,081               |
| 金銭の信託      | 1,650                  | 3,151                  |
| その他        | 398                    | 526                    |
| 流動資産合計     | 66,325                 | 77,094                 |
| 固定資産       |                        |                        |
| 有形固定資産     |                        |                        |
| 建物 ※1      | 2,762                  | ※1 2,581               |
| 器具備品 ※1    | 1,045                  | ※1 1,542               |
| 土地         | 628                    | 628                    |
| 建設仮勘定      | 747                    | 6                      |
| 有形固定資産合計   | 5,184                  | 4,758                  |
| 無形固定資産     |                        |                        |
| ソフトウェア     | 4,452                  | 4,732                  |
| ソフトウェア仮勘定  | 1,003                  | 861                    |
| 無形固定資産合計   | 5,456                  | 5,594                  |
| 投資その他の資産   |                        |                        |
| 投資有価証券     | 10,302                 | 17,107                 |
| 関係会社株式     | 159                    | 159                    |
| 投資不動産 ※1   | 1,712                  | ※1 1,641               |
| 長期差入保証金    | 690                    | 689                    |
| 繰延税金資産     | 1,640                  | 1,362                  |
| その他        | 45                     | 45                     |
| 貸倒引当金      | △23                    | △23                    |
| 投資その他の資産合計 | 14,526                 | 20,981                 |
| 固定資産合計     | 25,166                 | 31,334                 |
| 資産合計       | 91,491                 | 108,428                |

(単位：百万円)

|           | 第40期<br>(2025年3月31日現在) | 第41期<br>(2026年3月31日現在) |
|-----------|------------------------|------------------------|
| (負債の部)    |                        |                        |
| 流動負債      |                        |                        |
| 預り金       | 474                    | 567                    |
| 未払金       |                        |                        |
| 未払収益分配金   | 114                    | 130                    |
| 未払償還金     | 151                    | 166                    |
| 未払手数料     | 8,878                  | 11,249                 |
| その他未払金 ※2 | 819                    | ※2 1,817               |
| 未払費用 ※2   | 10,352                 | ※2 11,814              |
| 未払消費税等    | 1,211                  | 1,352                  |

|           |        |        |
|-----------|--------|--------|
| 未払法人税等    | 3,187  | 4,562  |
| 賞与引当金     | 1,308  | 1,636  |
| 役員賞与引当金   | 259    | 307    |
| その他       | 1      | 0      |
| 流動負債合計    | 26,761 | 33,606 |
| 固定負債      |        |        |
| 退職給付引当金   | 1,654  | 1,726  |
| 役員退職慰労引当金 | 25     | 11     |
| 時効後支払損引当金 | 244    | 240    |
| 資産除去債務    | 1,444  | 1,460  |
| その他       | 29     | 29     |
| 固定負債合計    | 3,398  | 3,467  |
| 負債合計      | 30,159 | 37,074 |
| (純資産の部)   |        |        |
| 株主資本      |        |        |
| 資本金       | 2,000  | 2,000  |
| 資本剰余金     |        |        |
| 資本準備金     | 3,572  | 3,572  |
| その他資本剰余金  | 41,160 | 41,160 |
| 資本剰余金合計   | 44,732 | 44,732 |
| 利益剰余金     |        |        |
| 利益準備金     | 342    | 342    |
| その他利益剰余金  |        |        |
| 繰越利益剰余金   | 12,846 | 21,587 |
| 利益剰余金合計   | 13,189 | 21,929 |
| 株主資本合計    | 59,921 | 68,662 |

(単位：百万円)

|              | 第40期<br>(2025年3月31日現在) | 第41期<br>(2026年3月31日現在) |
|--------------|------------------------|------------------------|
| 評価・換算差額等     |                        |                        |
| その他有価証券評価差額金 | 1,410                  | 2,691                  |
| 評価・換算差額等合計   | 1,410                  | 2,691                  |
| 純資産合計        | 61,332                 | 71,354                 |
| 負債純資産合計      | 91,491                 | 108,428                |

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

|         | 第40期<br>(自 2024年4月1日<br>至 2025年3月31日) | 第41期<br>(自 2025年4月1日<br>至 2026年3月31日) |
|---------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益    |                                       |                                       |
| 委託者報酬   | 114,618                               | 127,568                               |
| 投資顧問料   | 3,645                                 | 4,011                                 |
| その他営業収益 | 2                                     | 0                                     |

|           |         |         |
|-----------|---------|---------|
| 営業収益合計    | 118,266 | 131,580 |
| 営業費用      |         |         |
| 支払手数料     | 39,884  | 45,876  |
| 広告宣伝費     | 692     | 624     |
| 公告費       | 0       | 0       |
| 調査費       |         |         |
| 調査費       | 4,604   | 5,304   |
| 委託調査費     | 32,816  | 34,202  |
| 事務委託費     | 2,486   | 2,110   |
| 営業雑経費     |         |         |
| 通信費       | 156     | 139     |
| 印刷費       | 389     | 366     |
| 協会費       | 88      | 103     |
| 諸会費       | 23      | 27      |
| 事務機器関連費   | 2,925   | 3,252   |
| 営業費用合計    | 84,071  | 92,006  |
| 一般管理費     |         |         |
| 給料        |         |         |
| 役員報酬      | 469     | 502     |
| 給料・手当     | 7,985   | 8,390   |
| 賞与引当金繰入   | 1,308   | 1,636   |
| 役員賞与引当金繰入 | 259     | 307     |
| 福利厚生費     | 1,538   | 1,613   |
| 交際費       | 12      | 13      |
| 旅費交通費     | 132     | 195     |
| 租税公課      | 478     | 709     |
| 不動産賃借料    | 644     | 634     |
| 退職給付費用    | 377     | 379     |
| 固定資産減価償却費 | 2,383   | 2,609   |
| 諸経費       | 1,174   | 1,198   |
| 一般管理費合計   | 16,765  | 18,192  |
| 営業利益      | 17,429  | 21,380  |

(単位：百万円)

|             | 第40期<br>(自 2024年4月1日<br>至 2025年3月31日) | 第41期<br>(自 2025年4月1日<br>至 2026年3月31日) |
|-------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業外収益       |                                       |                                       |
| 受取配当金       | 107                                   | 171                                   |
| 有価証券利息      | -                                     | 8                                     |
| 受取利息        | 12                                    | 81                                    |
| 投資有価証券償還益   | 29                                    | 6                                     |
| 収益分配金等時効完成分 | 4                                     | 57                                    |
| 受取賃貸料       | 214                                   | 204                                   |
| その他         | 22                                    | 34                                    |
| 営業外収益合計     | 390                                   | 563                                   |
| 営業外費用       |                                       |                                       |
| 投資有価証券償還損   | 7                                     | 10                                    |
| 時効後支払損引当金繰入 | 15                                    | -                                     |
| 事務過誤費       | 7                                     | 23                                    |
| 賃貸関連費用      | 188                                   | 182                                   |

|              |          |          |
|--------------|----------|----------|
| 投資事業組合運用損    | -        | 19       |
| その他          | 9        | 0        |
| 営業外費用合計      | 227      | 236      |
| 経常利益         | 17,592   | 21,707   |
| 特別利益         |          |          |
| 投資有価証券売却益    | 739      | 326      |
| 特別利益合計       | 739      | 326      |
| 特別損失         |          |          |
| 投資有価証券売却損    | 138      | 14       |
| 投資有価証券評価損    | -        | 37       |
| 固定資産除却損      | ※2 18    | ※2 2     |
| 固定資産売却損      | ※1 6     | -        |
| 減損損失         | ※4 1,306 | -        |
| 事業譲渡関連損失     | ※5 491   | -        |
| 特別損失合計       | 1,961    | 54       |
| 税引前当期純利益     | 16,371   | 21,979   |
| 法人税、住民税及び事業税 | ※3 5,356 | ※3 6,780 |
| 法人税等調整額      | △344     | △312     |
| 法人税等合計       | 5,011    | 6,468    |
| 当期純利益        | 11,359   | 15,510   |

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

(単位：百万円)

|                         | 株主資本  |           |              |             |
|-------------------------|-------|-----------|--------------|-------------|
|                         | 資本金   | 資本剰余金     |              |             |
|                         |       | 資本<br>準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本<br>剰余金合計 |
| 当期首残高                   | 2,000 | 3,572     | 41,160       | 44,732      |
| 当期変動額                   |       |           |              |             |
| 剰余金の配当                  |       |           |              |             |
| 当期純利益                   |       |           |              |             |
| 別途積立金の取崩                |       |           |              |             |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額（純額） |       |           |              |             |
| 当期変動額合計                 | —     | —         | —            | —           |
| 当期末残高                   | 2,000 | 3,572     | 41,160       | 44,732      |

|        | 利益剰余金     |           |             |             | 株主資本合計  |
|--------|-----------|-----------|-------------|-------------|---------|
|        | 利益<br>準備金 | その他利益剰余金  |             | 利益剰余金<br>合計 |         |
|        |           | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>剰余金 |             |         |
| 当期首残高  | 342       | 6,998     | 40,236      | 47,577      | 94,310  |
| 当期変動額  |           |           |             |             |         |
| 剰余金の配当 |           |           | △45,747     | △45,747     | △45,747 |
| 当期純利益  |           |           | 11,359      | 11,359      | 11,359  |

|                         |     |        |         |         |         |
|-------------------------|-----|--------|---------|---------|---------|
| 別途積立金の取崩                |     | △6,998 | 6,998   | —       | —       |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額（純額） |     |        |         |         |         |
| 当期変動額合計                 | —   | △6,998 | △27,390 | △34,388 | △34,388 |
| 当期末残高                   | 342 | —      | 12,846  | 13,189  | 59,921  |

|                         | 評価・換算差額等             |                | 純資産合計   |
|-------------------------|----------------------|----------------|---------|
|                         | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>差額等合計 |         |
| 当期首残高                   | 1,937                | 1,937          | 96,247  |
| 当期変動額                   |                      |                |         |
| 剰余金の配当                  |                      |                | △45,747 |
| 当期純利益                   |                      |                | 11,359  |
| 別途積立金の取崩                |                      |                | —       |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額（純額） | △527                 | △527           | △527    |
| 当期変動額合計                 | △527                 | △527           | △34,915 |
| 当期末残高                   | 1,410                | 1,410          | 61,332  |

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

（単位：百万円）

|                         | 株主資本  |           |              |             |
|-------------------------|-------|-----------|--------------|-------------|
|                         | 資本金   | 資本剰余金     |              |             |
|                         |       | 資本<br>準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本<br>剰余金合計 |
| 当期首残高                   | 2,000 | 3,572     | 41,160       | 44,732      |
| 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<br>当期変動額（純額） |       |           |              |             |
| 当期変動額合計                 | —     | —         | —            | —           |
| 当期末残高                   | 2,000 | 3,572     | 41,160       | 44,732      |

|                         | 利益剰余金     |          |             | 株主資本合計 |
|-------------------------|-----------|----------|-------------|--------|
|                         | 利益<br>準備金 | その他利益剰余金 | 利益剰余金<br>合計 |        |
| 繰越利益<br>剰余金             |           |          |             |        |
| 当期首残高                   | 342       | 12,846   | 13,189      | 59,921 |
| 当期変動額                   |           |          |             |        |
| 剰余金の配当                  |           | △6,770   | △6,770      | △6,770 |
| 当期純利益                   |           | 15,510   | 15,510      | 15,510 |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額(純額) |           |          |             |        |
| 当期変動額合計                 | —         | 8,740    | 8,740       | 8,740  |
| 当期末残高                   | 342       | 21,587   | 21,929      | 68,662 |

|                         | 評価・換算差額等             |                | 純資産合計  |
|-------------------------|----------------------|----------------|--------|
|                         | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>差額等合計 |        |
| 当期首残高                   | 1,410                | 1,410          | 61,332 |
| 当期変動額                   |                      |                |        |
| 剰余金の配当                  |                      |                | △6,770 |
| 当期純利益                   |                      |                | 15,510 |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額(純額) | 1,281                | 1,281          | 1,281  |
| 当期変動額合計                 | 1,281                | 1,281          | 10,021 |
| 当期末残高                   | 2,691                | 2,691          | 71,354 |

## [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及び投資事業有限責任組合等への出資以外のもの

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。

投資事業有限責任組合等への出資（金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるもの）

組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な直近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

## 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 3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。

#### ① 退職給付見込額の期間帰属方法

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

#### ② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（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。

### (未適用の会計基準等)

「リースに関する会計基準」（企業会計基準第34号 2024年9月13日 企業会計基準委員会）

「リースに関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第33号 2024年9月13日 企業会計基準委員会）等

### (1)概要

企業会計基準委員会において、日本基準を国際的に整合性のあるものとする取組みの一環として、借手の全てのリースについて資産及び負債を認識するリースに関する会計基準の開発に向けて、国際的な会計基準を踏まえた検討が行われ、基本的な方針として、IFRS第16号の単一の会計処理モデルを基礎とするものの、IFRS第16号の全ての定めを採り入れるのではなく、主要な定めのみを採り入れることにより、簡素で利便性が高く、かつ、IFRS第16号の定めを個別財務諸表に用いても、基本的に修正が不要となることを目指したリース会計基準等が公表されました。

借手の会計処理として、借手のリースの費用配分の方法については、IFRS第16号と同様に、リースがファイナンス・リースであるかオペレーティング・リースであるかにかかわらず、全てのリースについて使用権資産に係る減価償却費及びリース負債に係る利息相当額を計上する単一の会計処理モデルが適用されます。

## (2)適用予定日

2028年3月期の期首から適用します。

## (3)当該会計基準等の適用による影響

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

「後発事象に関する会計基準」（企業会計基準第41号 2026年1月9日 企業会計基準委員会）

「後発事象に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第35号 2026年1月9日 企業会計基準委員会）

## (1)概要

「後発事象に関する会計基準」等は、後発事象の定義、会計処理及び開示等を取り扱う包括的な会計基準を設定することを優先的な課題とし、日本公認会計士協会 監査・保証基準委員会 監査基準報告書560 実務指針第1号「後発事象に関する監査上の取扱い」で示されている会計に関する内容を原則として踏襲して企業会計基準委員会に移管することを基本的な方針として、表現の見直し及び後発事象の評価期間の整理を行うとともに、財務諸表の公表の承認に関する注記を新たに求める等、後発事象に関する会計処理及び開示について定めたものであります。

## (2)適用予定日

2028年3月期の期首から適用します。

## (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40期<br>(2025年3月31日現在) | 第41期<br>(2026年3月31日現在) |
|-------|------------------------|------------------------|
| 建物    | 682百万円                 | 862百万円                 |
| 器具備品  | 2,168百万円               | 1,144百万円               |
| 投資不動産 | 288百万円                 | 359百万円                 |

## ※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40期<br>(2025年3月31日現在) | 第41期<br>(2026年3月31日現在) |
|--------|------------------------|------------------------|
| 未収収益   | 16百万円                  | 37百万円                  |
| その他未払金 | 43百万円                  | 215百万円                 |
| 未払費用   | 29百万円                  | 183百万円                 |

## (損益計算書関係)

## ※1.固定資産売却損の内訳

|      | 第40期<br>(自 2024年4月1日<br>至 2025年3月31日) | 第41期<br>(自 2025年4月1日<br>至 2026年3月31日) |
|------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 器具備品 | 6百万円                                  | —                                     |
| 計    | 6百万円                                  | —                                     |

## ※2.固定資産除却損の内訳

|        | 第40期<br>(自 2024年4月1日<br>至 2025年3月31日) | 第41期<br>(自 2025年4月1日<br>至 2026年3月31日) |
|--------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 建物     | —                                     | 2百万円                                  |
| 器具備品   | 2百万円                                  | 0百万円                                  |
| ソフトウェア | —                                     | —                                     |
| 電話加入権  | 15百万円                                 | —                                     |
| 計      | 18百万円                                 | 2百万円                                  |

## ※3.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40期<br>(自 2024年4月1日<br>至 2025年3月31日) | 第41期<br>(自 2025年4月1日<br>至 2026年3月31日) |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 法人税、住民税及び事業税 | 42百万円                                 | 251百万円                                |

## ※4.減損損失

第40期（自 2024年4月1日 至 2025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       |
|-----------|---------------|--------|----------|
| 東京都港区（本社） | インターネット直販サービス | ソフトウェア | 1,306百万円 |

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。

現行のソフトウェアについて、利用終了が見込まれたため、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おりません。

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

該当事項はありません。

## ※5.事業譲渡関連損失

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

吸収分割に伴うものであり、データ移管に伴うシステム対応費用であります。

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

該当事項はありません。

## (株主資本等変動計算書関係)

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

## 1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2.配当に関する事項

## (1)配当金支払額

2024年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|   |          |            |
|---|----------|------------|
| ① | 配当金の総額   | 45,747百万円  |
| ② | 1株当たり配当額 | 216,218円   |
| ③ | 基準日      | 2024年3月31日 |
| ④ | 効力発生日    | 2024年6月27日 |

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

2025年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|   |          |            |
|---|----------|------------|
| ① | 配当金の総額   | 6,770百万円   |
| ② | 配当の原資    | 利益剰余金      |
| ③ | 1株当たり配当額 | 31,998円    |
| ④ | 基準日      | 2025年3月31日 |
| ⑤ | 効力発生日    | 2025年6月27日 |

## 第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

2025年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|            |            |
|------------|------------|
| ① 配当金の総額   | 6,770百万円   |
| ② 1株当たり配当額 | 31,998円    |
| ③ 基準日      | 2025年3月31日 |
| ④ 効力発生日    | 2025年6月27日 |

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

2026年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

|            |            |
|------------|------------|
| ① 配当金の総額   | 12,408百万円  |
| ② 配当の原資    | 利益剰余金      |
| ③ 1株当たり配当額 | 58,647円    |
| ④ 基準日      | 2026年3月31日 |
| ⑤ 効力発生日    | 2026年6月26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40期<br>(2025年3月31日現在) | 第41期<br>(2026年3月31日現在) |
|-----|------------------------|------------------------|
| 1年内 | 681百万円                 | 171百万円                 |
| 1年超 | 170百万円                 | 4百万円                   |
| 合計  | 851百万円                 | 176百万円                 |

## (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）及び国債で運用し、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、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号2021年6月17日。以下、「時価算定適用指針」という。）第24-16項を適用した投資事業有限責任組合等への出資は、次表には含まれておりません（（注3）参照）。

## 第40期(2025年3月31日現在)

|            | 貸借対照表<br>計上額（百万円） | 時価（百万円） | 差額（百万円） |
|------------|-------------------|---------|---------|
| (1) 現金及び預金 | 37,354            | 37,352  | △1      |

|     |        |        |        |    |
|-----|--------|--------|--------|----|
| (2) | 有価証券   | 700    | 700    | —  |
| (3) | 金銭の信託  | 1,650  | 1,650  | —  |
| (4) | 投資有価証券 | 10,099 | 10,099 | —  |
|     | 資産計    | 49,805 | 49,803 | △1 |

- (注1) 「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) 現金及び預金に含まれるコーラブル預金（定期預金）（貸借対照表計上額1,000百万円）の時価は、取引先金融機関から提示された価格によっております。その他の現金及び預金（貸借対照表計上額36,354百万円）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、当該帳簿価額によっております。
- (注3) 市場価格のない株式等、時価算定適用指針第24-16項の取扱いを適用した投資事業有限責任組合等への出資  
 関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額159百万円）は、市場価格がないため、記載しておりません。また投資有価証券のうち、時価算定適用指針第24-16項の取扱いを適用した投資事業有限責任組合等への出資（当事業年度の貸借対照表計上額202百万円）は上記に含めておりません。
- (注4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明  
 金融商品の時価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5) 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40期(2025年3月31日現在)

(単位：百万円)

|                   | 1年以内   | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超 |
|-------------------|--------|-------------|--------------|------|
| 現金及び預金            | 37,354 | —           | —            | —    |
| 金銭の信託             | 1,650  | —           | —            | —    |
| 未収委託者報酬           | 24,418 | —           | —            | —    |
| 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              | 700    | 3,248       | 268          | 11   |
| 合計                | 64,124 | 3,248       | 268          | 11   |

## 第41期(2026年3月31日現在)

|            | 貸借対照表<br>計上額（百万円） | 時価（百万円） | 差額（百万円） |
|------------|-------------------|---------|---------|
| (1) 有価証券   | 3,347             | 3,347   | —       |
| (2) 金銭の信託  | 3,151             | 3,151   | —       |
| (3) 投資有価証券 | 16,751            | 16,751  | —       |
| 資産計        | 23,250            | 23,250  | —       |

- (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) 投資有価証券には、時価算定適用指針第24-3項の基準価額を時価とみなす取扱いを適用した投資信託が含まれております。
- (注3) 市場価格のない株式等、時価算定適用指針第24-16項の取扱いを適用した投資事業有限責任組合等への出資  
 関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額159百万円）は、市場価格がないため、記載しておりません。また投資有価証券のうち、時価算定適用指針第24-16項の取扱いを適用した投資事業有限責任組合等への出資（当事業年度の貸借対照表計上額355百万円）は上記に含めておりません。
- (注4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明  
 金融商品の時価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5) 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41期(2026年3月31日現在)

(単位：百万円)

|                   | 1年以内   | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超  |
|-------------------|--------|-------------|--------------|-------|
| 現金及び預金            | 38,323 | —           | —            | —     |
| 金銭の信託             | 3,151  | —           | —            | —     |
| 未収委託者報酬           | 29,726 | —           | —            | —     |
| 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 |        |             |              |       |
| 国債                | 1,999  | —           | —            | —     |
| 投資信託              | 1,348  | 2,241       | 1,919        | 1,996 |
| 合計                | 74,548 | 2,241       | 1,919        | 1,996 |

## 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。

なお、時価算定適用指針第24-3項の取扱いを適用した投資信託は、次表には含めておりません（(1)＊参照）。

- 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。

## (1) 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40期(2025年3月31日現在)

| 区分     | 時価（百万円） |       |      |        |
|--------|---------|-------|------|--------|
|        | レベル1    | レベル2  | レベル3 | 合計     |
| 有価証券   | —       | 700   | —    | 700    |
| 金銭の信託  | —       | 1,650 | —    | 1,650  |
| 投資有価証券 | 2,601   | 7,498 | —    | 10,099 |
| 資産計    | 2,601   | 9,849 | —    | 12,450 |

(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41期(2026年3月31日現在)

| 区分        | 時価（百万円） |        |      |        |
|-----------|---------|--------|------|--------|
|           | レベル1    | レベル2   | レベル3 | 合計     |
| 有価証券      | 1,999   | 1,348  | —    | 3,347  |
| 金銭の信託     | —       | 3,151  | —    | 3,151  |
| 投資有価証券(＊) | 5,740   | 10,711 | —    | 16,451 |
| 資産計       | 7,739   | 15,210 | —    | 22,950 |

（※）時価算定適用指針第24-3項の取扱いを適用した投資信託（貸借対照表計上額 300百万円）

は、上記には含めておりません。

（注1）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）及び国債は相場価格を用いて評価しております。ETF及び国債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、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合に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。時価算定適用指針第24-3項の取扱いを適用し、基準価額を時価とみなした投資信託はレベルを付しておりません。

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。

（注2）時価算定適用指針第24-3項の取扱いを適用した投資信託に関する情報

期首残高から期末残高への調整表

（単位：百万円）

| 区分              | 期首残高 | 当期の損益に計上した額 | その他有価証券評価差額金に計上した額 | 購入、売却及び償還による変動額 | 基準価額を時価とみなすこととした額 | 基準価額を時価とみなさないこととした額 | 期末残高 | 当期の損益に計上した額のうち貸借対照表日において保有する投資信託の評価損益 |
|-----------------|------|-------------|--------------------|-----------------|-------------------|---------------------|------|---------------------------------------|
| 投資有価証券（その他有価証券） | —    | —           | 0                  | 300             | —                 | —                   | 300  | —                                     |

（注）決算日における解約等に関する制限の主な内容は、解約不可とされるものが300百万円であります。

（2）時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

第40期（2025年3月31日現在）

| 区分     | 時価（百万円） |      |      |     |
|--------|---------|------|------|-----|
|        | レベル1    | レベル2 | レベル3 | 合計  |
| 現金及び預金 | —       | 998  | —    | 998 |
| 資産計    | —       | 998  | —    | 998 |

（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

現金及び預金

コーラブル預金（定期預金）は、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。

その他の現金及び預金（貸借対照表計上額36,354百万円）は、上記に含めておりません。

第41期(2026年3月31日現在)

該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

第40期（2025年3月31日現在）及び第41期（2026年3月31日現在）

関連会社株式（貸借対照表計上額は159百万円）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40期(2025年3月31日現在)

|                          | 種類  | 貸借対照表<br>計上額（百万円） | 取得原価<br>（百万円） | 差額（百万円） |
|--------------------------|-----|-------------------|---------------|---------|
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えるもの  | 株式  | —                 | —             | —       |
|                          | 債券  | —                 | —             | —       |
|                          | その他 | 9,857             | 7,508         | 2,348   |
|                          | 小計  | 9,857             | 7,508         | 2,348   |
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えないもの | 株式  | —                 | —             | —       |
|                          | 債券  | —                 | —             | —       |
|                          | その他 | 2,593             | 2,884         | △290    |
|                          | 小計  | 2,593             | 2,884         | △290    |
| 合計                       |     | 12,450            | 10,392        | 2,058   |

（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1,650百万円、取得原価は1,650百万円）を含めております。

第41期(2026年3月31日現在)

|                          | 種類  | 貸借対照表<br>計上額（百万円） | 取得原価<br>（百万円） | 差額（百万円） |
|--------------------------|-----|-------------------|---------------|---------|
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えるもの  | 株式  | —                 | —             | —       |
|                          | 債券  | —                 | —             | —       |
|                          | その他 | 17,489            | 13,219        | 4,269   |
|                          | 小計  | 17,489            | 13,219        | 4,269   |
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えないもの | 株式  | —                 | —             | —       |
|                          | 債券  | 1,999             | 1,999         | △0      |
|                          | その他 | 3,762             | 4,091         | △328    |
|                          | 小計  | 5,761             | 6,090         | △329    |
| 合計                       |     | 23,250            | 19,309        | 3,940   |

（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3,151百万円、取得原価は3,150百万円）を含めております。

## 3. 売却したその他有価証券

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

| 種類  | 売却額（百万円） | 売却益の合計額（百万円） | 売却損の合計額（百万円） |
|-----|----------|--------------|--------------|
| 株式  | —        | —            | —            |
| 債券  | —        | —            | —            |
| その他 | 4,044    | 739          | 138          |
| 合計  | 4,044    | 739          | 138          |

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

| 種類  | 売却額（百万円） | 売却益の合計額（百万円） | 売却損の合計額（百万円） |
|-----|----------|--------------|--------------|
| 株式  | —        | —            | —            |
| 債券  | —        | —            | —            |
| その他 | 1,780    | 326          | 14           |
| 合計  | 1,780    | 326          | 14           |

## 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度においては、減損処理を行っておりません。

当事業年度において、有価証券について37百万円（その他有価証券のその他37百万円）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40期<br>(自 2024年4月1日<br>至 2025年3月31日) | 第41期<br>(自 2025年4月1日<br>至 2026年3月31日) |
|------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 退職給付債務の期首残高      | 3,652 百万円                             | 3,437 百万円                             |
| 勤務費用             | 180                                   | 178                                   |
| 利息費用             | 47                                    | 67                                    |
| 数理計算上の差異の<br>発生額 | △207                                  | △239                                  |
| 退職給付の支払額         | △236                                  | △286                                  |
| 過去勤務費用の発生額       | —                                     | —                                     |
| 退職給付債務の期末残高      | 3,437                                 | 3,157                                 |

#### （2）年金資産の期首残高と期末残高の調整表

|                    | 第40期<br>(自 2024年4月1日<br>至 2025年3月31日) | 第41期<br>(自 2025年4月1日<br>至 2026年3月31日) |
|--------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 年金資産の期首残高          | 2,492 百万円                             | 2,350 百万円                             |
| 期待運用収益             | 44                                    | 42                                    |
| 数理計算上の差異の<br>発生額   | △62                                   | 144                                   |
| 事業主からの拠出額          | —                                     | —                                     |
| 退職給付の支払額           | △116                                  | △154                                  |
| 退職給付制度終了に伴う<br>調整額 | △8                                    | —                                     |
| 年金資産の期末残高          | 2,350                                 | 2,383                                 |

#### （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の調整表

|                             | 第40期<br>(2025年3月31日現在) | 第41期<br>(2026年3月31日現在) |
|-----------------------------|------------------------|------------------------|
| 積立型制度の<br>退職給付債務            | 2,018 百万円              | 1,762 百万円              |
| 年金資産                        | △2,350                 | △2,383                 |
|                             | △332                   | △620                   |
| 非積立型制度の退職給付債務               | 1,418                  | 1,394                  |
| 未積立退職給付債務                   | 1,086                  | 773                    |
| 未認識数理計算上の差異                 | 660                    | 979                    |
| 未認識過去勤務費用                   | △92                    | △27                    |
| 貸借対照表に計上された負債<br>と<br>資産の純額 | 1,654                  | 1,726                  |
| 退職給付引当金                     | 1,654                  | 1,726                  |
| 貸借対照表に計上された負債<br>と<br>資産の純額 | 1,654                  | 1,726                  |

#### （4）退職給付費用及びその内訳項目の金額

|                     | 第40期<br>(自 2024年4月1日<br>至 2025年3月31日) | 第41期<br>(自 2025年4月1日<br>至 2026年3月31日) |
|---------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 勤務費用                | 180 百万円                               | 178 百万円                               |
| 利息費用                | 47                                    | 67                                    |
| 期待運用収益              | △44                                   | △42                                   |
| 数理計算上の差異の<br>費用処理額  | △43                                   | △64                                   |
| 過去勤務費用の費用処理額        | 65                                    | 65                                    |
| その他                 | △0                                    | 1                                     |
| 確定給付制度に係る<br>退職給付費用 | 204                                   | 205                                   |

(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。

#### (5)年金資産に関する事項

##### ①年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

|     | 第40期<br>(2025年3月31日現在) | 第41期<br>(2026年3月31日現在) |
|-----|------------------------|------------------------|
| 債券  | 64.7 %                 | 67.8 %                 |
| 株式  | 33.2                   | 29.2                   |
| その他 | 2.1                    | 3.0                    |
| 合計  | 100                    | 100                    |

##### ②長期期待運用収益率の設定方法

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

#### (6)数理計算上の計算基礎に関する事項

##### 主要な数理計算上の計算基礎

|           | 第40期<br>(2025年3月31日現在) | 第41期<br>(2026年3月31日現在) |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 割引率       | 2.07～2.11%             | 2.89～2.97%             |
| 長期期待運用収益率 | 1.8%                   | 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172百万円、当事業年度173百万円であります。

#### (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40期<br>(2025年3月31日現在) | 第41期<br>(2026年3月31日現在) |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 繰延税金資産    |                        |                        |
| 減損損失      | 392百万円                 | 385百万円                 |
| 投資有価証券評価損 | 28                     | 40                     |
| 未払事業税     | 173                    | 245                    |
| 賞与引当金     | 400                    | 515                    |
| 役員賞与引当金   | 48                     | 67                     |
| 役員退職慰労引当金 | 8                      | 3                      |
| 退職給付引当金   | 521                    | 544                    |
| 減価償却超過額   | 291                    | 297                    |
| 資産除去債務    | 52                     | 87                     |
| 時効後支払損引当金 | 77                     | 75                     |
| その他       | 296                    | 339                    |

|              |       |        |
|--------------|-------|--------|
| 繰延税金資産 小計    | 2,290 | 2,603  |
| 評価性引当額       | —     | —      |
| 繰延税金資産 合計    | 2,290 | 2,603  |
| 繰延税金負債       |       |        |
| その他有価証券評価差額金 | △648  | △1,238 |
| その他          | △1    | △2     |
| 繰延税金負債 合計    | △649  | △1,241 |
| 繰延税金資産の純額    | 1,640 | 1,362  |

## 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40期（2025年3月31日現在）及び第41期（2026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。

### （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40期<br>(2025年3月31日現在) | 第41期<br>(2026年3月31日現在) |
|----------------|------------------------|------------------------|
| 期首残高           | 1,428百万円               | 1,444百万円               |
| 有形固定資産の取得に伴う増加 | —                      | —                      |
| 時の経過による調整額     | 15百万円                  | 15百万円                  |
| 期末残高           | 1,444百万円               | 1,460百万円               |

### （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.収益及び費用の計上基準」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40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）及び第41期（自 2025年4月1日 至 2026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40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）及び第41期（自 2025年4月1日 至 2026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40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

| 種類  | 会社等の名称                       | 所在地             | 資本金              | 事業の内容       | 議決権等の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係 | 取引の内容                                 | 取引金額<br>(注3) | 科目         | 期末残高<br>(注3) |
|-----|------------------------------|-----------------|------------------|-------------|------------------------|---------------|---------------------------------------|--------------|------------|--------------|
| 親会社 | (株)三菱UFJ<br>フィナンシャル・<br>グループ | 東京都<br>千代田<br>区 | 2,141,513<br>百万円 | 銀行持株<br>会社業 | 被所有<br>直接<br>100.0%    | グループ通算<br>制度  | グループ<br>通算制度に<br>伴う通算税<br>効果額<br>(注1) | 42<br>百万円    | その他<br>未払金 | 43<br>百万円    |
|     |                              |                 |                  |             |                        | 経営管理          | 経営管理<br>手数料<br>(注2)                   | 508<br>百万円   |            |              |
|     |                              |                 |                  |             |                        | 役員の兼任         |                                       |              |            |              |

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

| 種類  | 会社等の名称                       | 所在地             | 資本金              | 事業の内容       | 議決権等の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係 | 取引の内容                                 | 取引金額<br>(注3) | 科目         | 期末残高<br>(注3) |
|-----|------------------------------|-----------------|------------------|-------------|------------------------|---------------|---------------------------------------|--------------|------------|--------------|
| 親会社 | (株)三菱UFJ<br>フィナンシャル・<br>グループ | 東京都<br>千代田<br>区 | 2,141,513<br>百万円 | 銀行持株<br>会社業 | 被所有<br>直接<br>100.0%    | グループ通算<br>制度  | グループ<br>通算制度に<br>伴う通算税<br>効果額<br>(注1) | 251<br>百万円   | その他<br>未払金 | 215<br>百万円   |
|     |                              |                 |                  |             |                        | 経営管理          | 経営管理<br>手数料<br>(注2)                   | 647<br>百万円   |            |              |
|     |                              |                 |                  |             |                        | 役員の兼任         |                                       |              |            |              |

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 1. グループ通算制度に基づく通算税効果額であります。

2. 経営管理手数料については、経営管理契約に基づく取引条件によっております。

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

おります。

## (2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

| 種類          | 会社等の名称               | 所在地     | 資本金              | 事業の内容   | 議決権等の所有<br>(被所有)割合 | 関連当事者との関係                     | 取引の内容                     | 取引金額<br>(注4) | 科目     | 期末残高<br>(注4) |
|-------------|----------------------|---------|------------------|---------|--------------------|-------------------------------|---------------------------|--------------|--------|--------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ信託銀行(株)         | 東京都千代田区 | 324,279<br>百万円   | 信託業、銀行業 | なし                 | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払<br>(注1) | 5,310<br>百万円 | 未払手数料  | 952<br>百万円   |
|             |                      |         |                  |         |                    | 投資の助言<br>役員の兼任                | 投資助言料<br>(注2)             | 451<br>百万円   | 未払費用   | 237<br>百万円   |
| 同一の親会社を持つ会社 | (株)三菱UFJ銀行           | 東京都千代田区 | 1,711,958<br>百万円 | 銀行業     | なし                 | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払<br>(注1) | 4,747<br>百万円 | 未払手数料  | 1,115<br>百万円 |
|             |                      |         |                  |         |                    | 取引銀行                          | コーラブル預金の預入<br>(注3)        | 1,000<br>百万円 | 現金及び預金 | 1,000<br>百万円 |
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJモルガン・スタンレー証券(株) | 東京都千代田区 | 40,500<br>百万円    | 証券業     | なし                 | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払<br>(注1) | 8,404<br>百万円 | 未払手数料  | 1,572<br>百万円 |

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

| 種類          | 会社等の名称       | 所在地     | 資本金            | 事業の内容   | 議決権等の所有<br>(被所有)割合 | 関連当事者との関係                     | 取引の内容                     | 取引金額<br>(注4) | 科目    | 期末残高<br>(注4) |
|-------------|--------------|---------|----------------|---------|--------------------|-------------------------------|---------------------------|--------------|-------|--------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ信託銀行(株) | 東京都千代田区 | 324,279<br>百万円 | 信託業、銀行業 | なし                 | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払<br>(注1) | 5,693<br>百万円 | 未払手数料 | 1,169<br>百万円 |
|             |              |         |                |         |                    | 投資の助言<br>役員の兼任                | 投資助言料<br>(注2)             | 460<br>百万円   | 未払費用  | 262<br>百万円   |

|             |                      |         |                  |     |    |                               |                           |              |       |              |
|-------------|----------------------|---------|------------------|-----|----|-------------------------------|---------------------------|--------------|-------|--------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | (株)三菱UFJ銀行           | 東京都千代田区 | 1,711,958<br>百万円 | 銀行業 | なし | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払<br>(注1) | 5,038<br>百万円 | 未払手数料 | 1,350<br>百万円 |
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJモルガン・スタンレー証券(株) | 東京都千代田区 | 40,500<br>百万円    | 証券業 | なし | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払<br>(注1) | 9,745<br>百万円 | 未払手数料 | 1,832<br>百万円 |

## 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. 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。
3. 預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。
4. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

## 2. 親会社に関する注記

株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

## （1株当たり情報）

|              | 第40期<br>(自 2024年4月1日<br>至 2025年3月31日) | 第41期<br>(自 2025年4月1日<br>至 2026年3月31日) |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 1株当たり純資産額    | 289,876.37円                           | 337,242.83円                           |
| 1株当たり当期純利益金額 | 53,688.15円                            | 73,309.88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40期<br>(自 2024年4月1日<br>至 2025年3月31日) | 第41期<br>(自 2025年4月1日<br>至 2026年3月31日) |
|-------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 当期純利益金額（百万円）            | 11,359                                | 15,510                                |
| 普通株主に帰属しない金額<br>（百万円）   | —                                     | —                                     |
| 普通株式に係る当期純利益金額<br>（百万円） | 11,359                                | 15,510                                |
| 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。

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

## 5【その他】

- ①定款の変更等  
定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
- ②訴訟事件その他重要事項  
該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### （1）受託会社

- ①名称：三菱UFJ信託銀行株式会社  
（再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）
- ②資本金の額：324,279百万円（2026年3月末現在）
- ③事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### （2）販売会社

| ①名称           | ②資本金の額<br>(2026年3月末現在) | ③事業の内容              |
|---------------|------------------------|---------------------|
| 三菱UFJ信託銀行株式会社 | 324,279 百万円            | 銀行業務および信託業務を営んでいます。 |

### 2【関係業務の概要】

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

### 3【資本関係】

該当ありません。（2026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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

| 提出年月日       | 提出書類          |
|-------------|---------------|
| 2025年 9月24日 | 有価証券届出書       |
| 2025年 9月24日 | 有価証券報告書       |
| 2026年 3月24日 | 有価証券届出書の訂正届出書 |
| 2026年 3月24日 | 半期報告書         |

# 独立監査人の監査報告書

2026年6月5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 鶴見将史

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2025年4月1日から2026年3月31日までの第41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2026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及び監査等委員会の責任

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。

監査等委員会の責任は、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、監査等委員会に対して、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、監査等委員会に対して、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

2026年9月2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」に掲げられているダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）の2025年6月26日から2026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、ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）の2026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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、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。