

投資信託説明書
(請求目論見書)

使用開始日 2024.12.25

三菱UFJ バランス・イノベーション
(株式抑制型) / (株式重視型) / (新興国投資型)
〈愛称:ファーストラップ(ささえ)〉

追加型投信 / 内外 / 資産複合

この目論見書により行う「三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)」、「三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)」、「三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2024年6月24日に関東財務局長に提出しており、2024年6月25日に効力が生じております。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づき作成され、投資者の請求により交付される目論見書(請求目論見書)です。

発行者名	: 三菱UFJアセットマネジメント株式会社
代表者の役職氏名	: 取締役社長 横川 直
本店の所在の場所	: 東京都港区東新橋一丁目9番1号
縦覧に供する場所	: 該当事項はありません。

目次

第一部【証券情報】	1
(1)【ファンドの名称】	1
(2)【内国投資信託受益証券の形態等】	1
(3)【発行（売出）価額の総額】	1
(4)【発行（売出）価格】	1
(5)【申込手数料】	1
(6)【申込単位】	1
(7)【申込期間】	1
(8)【申込取扱場所】	2
(9)【払込期日】	2
(10)【払込取扱場所】	2
(11)【振替機関に関する事項】	2
(12)【その他】	2
第二部【ファンド情報】	3
第1【ファンドの状況】	3
第2【管理及び運営】	61
第3【ファンドの経理状況】	67
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	347
第三部【委託会社等の情報】	348
第1【委託会社等の概況】	348
約款	379

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）
（以上を総称して、あるいは個別に「ファンド」といいます。）
愛称として「ファーストラップ（ささえ）」を用いることがあります。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。
信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。
基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。
なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

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

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

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

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

(5)【申込手数料】

申込価額（発行価格）×2.2%（税抜2%）を上限として販売会社が定める手数料率

申込手数料は販売会社にご確認ください。

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、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

(6)【申込単位】

販売会社が定める単位

申込単位は販売会社にご確認ください。

(7)【申込期間】

2024年6月25日から2025年6月24日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

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)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

(11) 【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の成長と収益の確保をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、各ファンドについて、5,000億円です。

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

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

商品分類表

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

属性区分表

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

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

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

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

商品分類の定義

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

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

属性区分の定義

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

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

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

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

各ファンドは、世界の株式や債券を主な投資対象とし、投資環境等の変化に合わせて組入比率を変更する投資信託です。

ファンドの目的

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

ファンドの特色

三菱UFJ バランス・イノベーション
(株式抑制型)

三菱UFJ バランス・イノベーション
(株式重視型)

三菱UFJ バランス・イノベーション
(新興国投資型)

投資対象

「三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)」、「三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)」は、マザーファンドへの投資を通じて、国内および先進国の株式、債券および短期金融資産に実質的な投資を行います。
「三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)」は、上記に加え、マザーファンドへの投資を通じて、新興国の株式、債券にも実質的な投資を行います。

◆以下、各ファンドを「株式抑制型」、「株式重視型」、「新興国投資型」という場合があります。

<各ファンドの特徴>

各ファンド	特徴
「株式抑制型」	<ul style="list-style-type: none"> 国内、先進国の株式・債券および短期公社債等に投資するファンドです。 国内株式、先進国株式の組入比率を抑えて、比較的安定的な基準価額の上昇をめざすファンドです。
「株式重視型」	<ul style="list-style-type: none"> 国内、先進国の株式・債券および短期公社債等に投資するファンドで、「株式抑制型」と比較して国内株式、先進国株式の組入比率を高めることが可能です。 「株式抑制型」と比較して、株式相場上昇局面における株式の値上がり益の獲得をめざすファンドで、値動きはより大きくなる傾向があります。
「新興国投資型」	<ul style="list-style-type: none"> 国内、先進国の株式・債券および短期公社債等に加え、新興国の株式・債券にも投資するファンドです。 より一層の値上がり益の獲得をめざすファンドで、3つのファンドの中では最も値動きが大きくなる傾向があります。

1 運用期間、市況動向によっては、上記の傾向とならない場合があります。

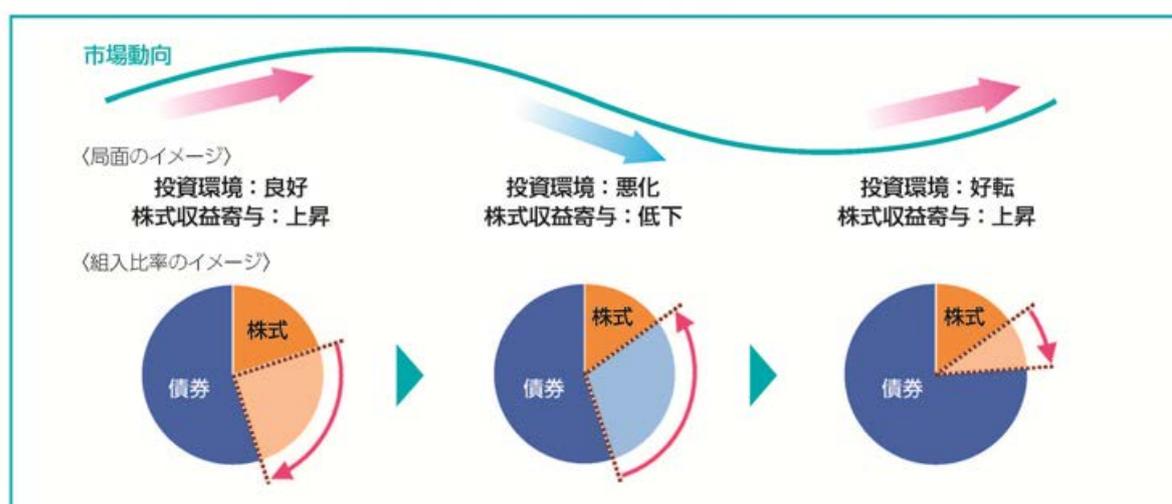
＜各ファンドが投資対象とするマザーファンドと運用目標＞

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

・「新興国投資型」のみ新興国株式および新興国債券への実質的な投資を行います。

■運用方法・運用プロセス

＜(ご参考)「株式抑制型」の組入比率変更のイメージ＞



❗ 上図はファンドの組入比率の変更をご理解いただくために、「株式抑制型」における組入比率の変更をイメージとして示したものであり、上記と同じ条件での「株式重視型」、「新興国投資型」の組入比率とは異なります。また、各投資環境における組入比率については実際の比率と異なり、投資環境等によっては、株式の組入れを行わない場合があります。

- 各資産の組入比率は以下の範囲で決定します。

<各資産の組入比率>

	「株式抑制型」	「株式重視型」	「新興国投資型」
国内株式	0.0%~22.0%	0.0%~42.5%	0.0%~33.0%
先進国株式	0.0%~22.0%	0.0%~42.5%	0.0%~33.0%
新興国株式	投資を行いません	投資を行いません	0.0%~32.0%
国内債券	0.0%~51.0%	0.0%~51.0%	0.0%~32.7%
先進国債券	0.0%~25.0% (原則、25.0%固定とします。)	0.0%~25.0% (原則、13.0%~25.0%とします。)	0.0%~32.7%
新興国債券	投資を行いません	投資を行いません	0.0%~32.7%

❗ 上記以外に短期金融資産を組み入れます。

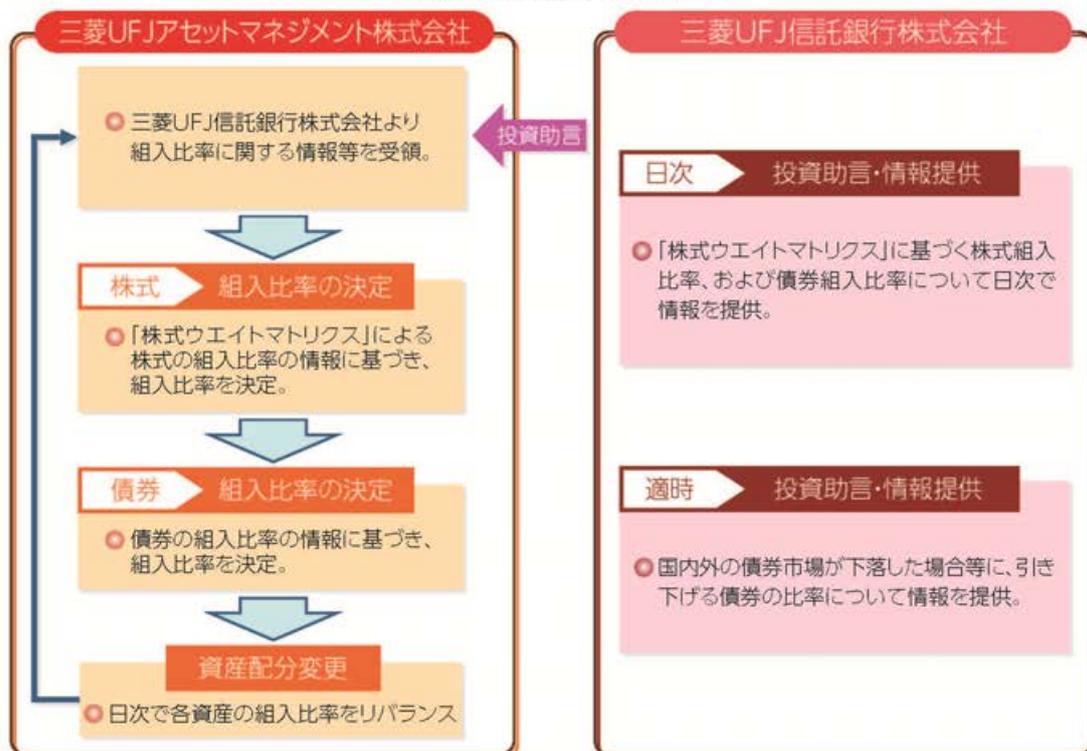
❗ 上記組入比率は、今後、変更となる場合があります。

- 三菱UFJ信託銀行株式会社の投資助言・情報提供に基づき、三菱UFJアセットマネジメント株式会社が各ファンドの運用を行います。

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

- ファンドの運用プロセスは以下のとおりです。

<ファンドの運用プロセス>



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

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

- 株式の組入比率については、投資環境や株式部分の収益寄与に基づいて決定する「株式ウェイトマトリクス」を活用します。
- ◆ 「投資環境」は、株式市場や景気の方向性、信用リスクに対する市場の反応の大きさ、株式市場の値動きの大きさ等を測る複数の指標を用いて計算される相場局面判断インデックスをもとに判断します。なお、「新興国投資型」は上記各指標に加え、新興国通貨の下落率を活用した指標も用います。
- ◆ 「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。
- ❶ 「株式ウェイトマトリクス」は、各ファンドごとおよび各資産（国内株式、先進国株式、新興国株式）ごとに異なります。また、「投資環境」を判断する各指標については、今後変更になる場合があります。

<株式ウェイトマトリクスのイメージ>



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

- 「株式抑制型」は、株式部分以外への投資については、先進国債券に一定の比率で投資を行い、残りは国内債券等に投資します。
「株式重視型」は、株式の実質組入比率に応じて先進国債券の組入比率を決定し、残りは国内債券等に投資します。
「新興国投資型」は、株式部分以外への投資については、国内債券、先進国債券、新興国債券の組入比率が均等になるよう投資を行います。
- なお、国内外の債券市場が下落した場合等に債券の組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等への投資を行う場合があります。

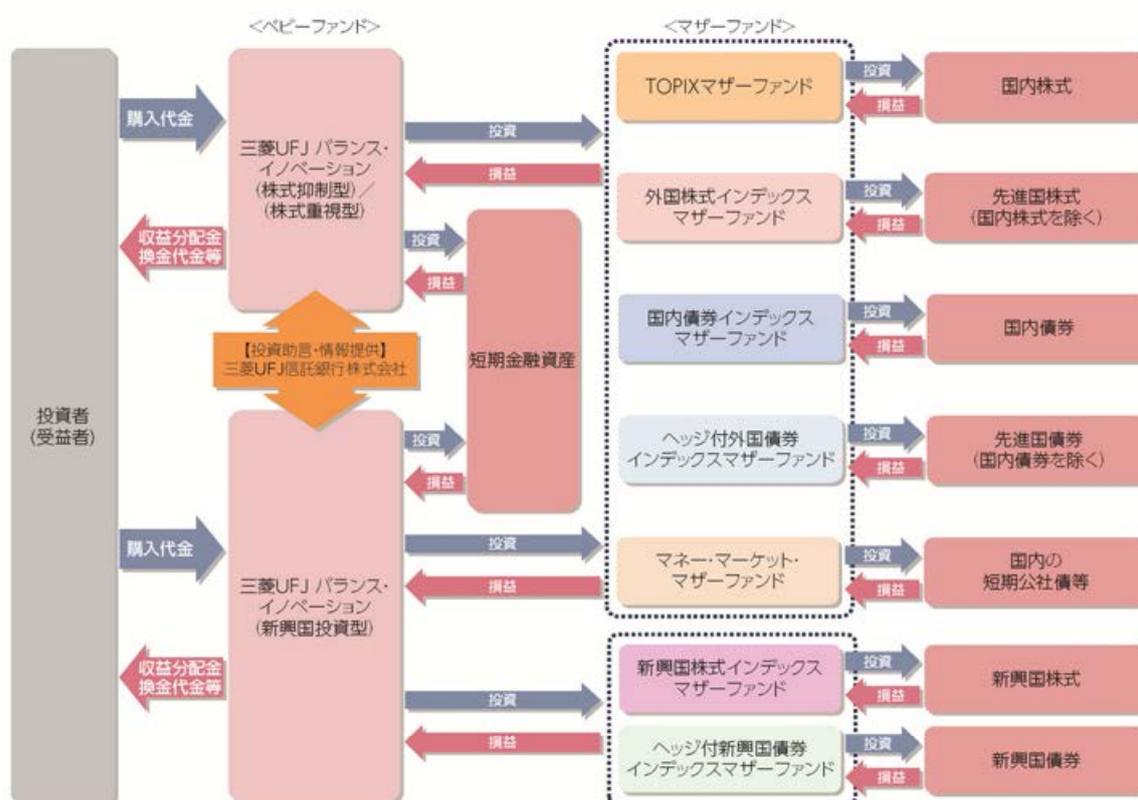
📄 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページでご覧いただけます。
(https://www.am.mufg.jp/investment_policy/fm.html)

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

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

■ ファンドの仕組み

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



- ❗ スイッチングの取扱いについては、スイッチングの取扱いを行わない販売会社もあるため、詳しくは、販売会社にご確認下さい。
- ❗ スイッチングの際の購入時手数料は、販売会社が定めるものとします。また、換金するファンドに対して税金がかかります。

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

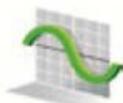
- 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■主な投資制限

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



指数について

・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)(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に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。

・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。

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

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

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

・NOMURA-BPI総合とは、野村フィデューシャリー・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。

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

・JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(米ドルベース)とは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している流動性の高い米ドル建ての新興国国債のパフォーマンスを表す代表的な指数です。JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円ヘッジ・円換算ベース)は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているJPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。

JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスの著作権は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。

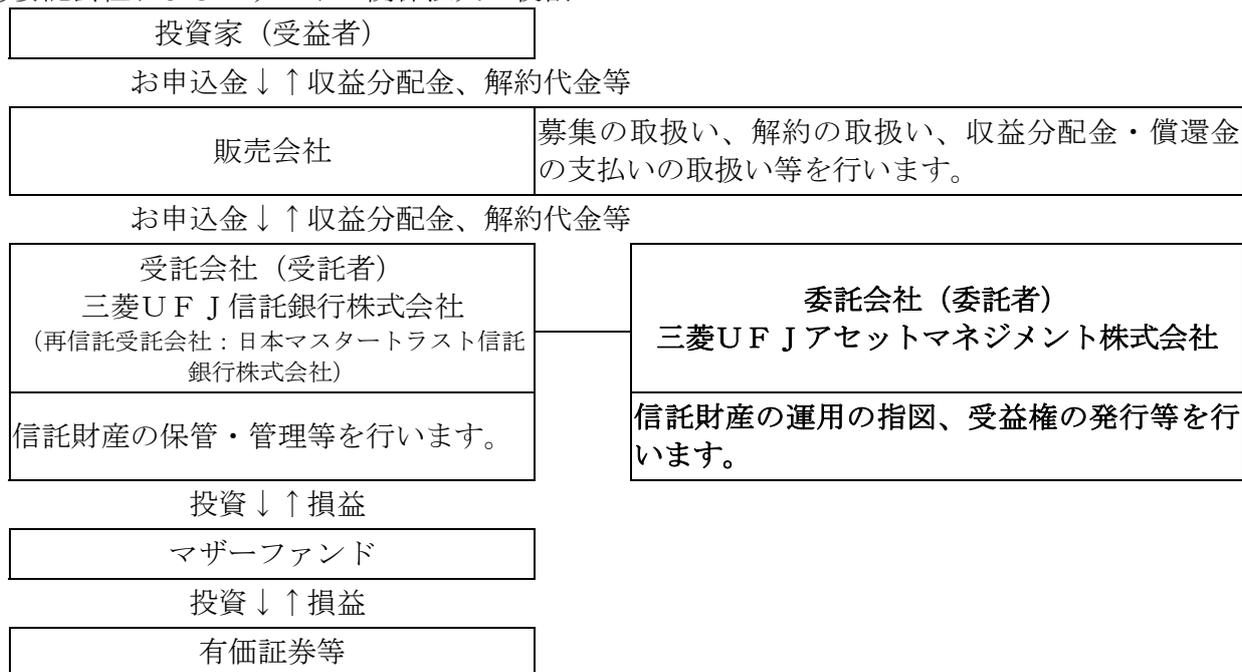
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2013年10月25日	設定日、信託契約締結、運用開始
2020年6月25日	ファンドの投資対象に「国内債券インデックスマザーファンド」を追加
2020年12月25日	ファンドの投資対象から「日本債券インデックスマザーファンド」を削除
2021年12月25日	信託期間を2023年3月24日までから2028年3月24日までに変更

(3) 【ファンドの仕組み】

①委託会社およびファンドの関係法人の役割



②委託会社と関係法人との契約の概要

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

③委託会社の概況（2024年9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

2005年10月	が合併、商号を三菱投信株式会社に変更 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】

「三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）」

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

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

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

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

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

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

「三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）」

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

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

株式の実質組入比率は、相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。

債券の実質組入比率は、株式の実質組入比率に応じて先進国債券の組入比率を決定し、残りの部分は国内債券等を組入れます。

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

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

「三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）」

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

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

株式の実質組入比率は、相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。

債券の実質組入比率は、原則として、国内債券、先進国債券および新興国債券を均等とします。

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

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2)【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

a. 有価証券先物取引等

b. スワップ取引

c. 金利先渡取引および為替先渡取引

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

②有価証券の指図範囲

「三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）／（株式重視型）」

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、国内債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

「三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）」

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、新興国株式インデックスマザーファンド、国内債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

<ファンド共通>

1. 株券または新株引受権証券
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
 11. コマーシャル・ペーパー
 12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から 12. の証券または証書の性質を有するもの
 14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16. において同じ。）で16. で定めるもの以外のもの
 16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16. において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
 19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 21. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
 22. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 24. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいい、1. から 23. に該当するものを除きます。）
 25. 外国の者に対する権利で23. および24. の有価証券の性質を有するもの
- なお、1. の証券または証書ならびに13. および19. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から6. までの証券ならびに16. の証券ならびに13. および19. の証券または証書のうち2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14. および15. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

③金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）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. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、1. から5. に該当

するものを除きます。)

7. 投資事業有限責任組合契約に基づく権利（金融商品取引法第2条第2項第5号に該当するものをいいます。)

8. 外国の者に対する権利で5. から7. の権利の性質を有するもの

④その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

・外国為替予約取引

<マザーファンドの概要>

TOPIXマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

東京証券取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

②投資態度

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

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

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

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

(投資制限)

①株式への投資割合に制限を設けません。

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

③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

⑤外貨建資産への投資は行いません。

⑥有価証券先物取引等を行うことができます。

⑦スワップ取引を行うことができます。

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

外国株式インデックスマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

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

②投資態度

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

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

・株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または

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

・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

(投資制限)

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

国内債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

主としてわが国の公社債に投資を行います。

公社債の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

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

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、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。

マネー・マーケット・マザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、安定した収益の確保をめざして安定運用を行います。

(運用方法)

①投資対象

わが国の公社債等を主要投資対象とします。

②投資態度

わが国の短期公社債等を中心に投資し、利子等収益の確保を図ります。

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

(投資制限)

①株式への投資は行いません。

②外貨建資産への投資は行いません。

③有価証券先物取引等を行うことができます。

④スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

⑤金利先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

⑥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。

新興国株式インデックスマザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、M S C I エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）と

連動した投資成果をめざして運用を行います。

(運用方法)

①投資対象

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

②投資態度

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

株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

①株式への投資割合に制限を設けません。

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

③同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

⑤有価証券先物取引等を行うことができます。

⑥スワップ取引を行うことができます。

⑦金利先渡取引および為替先渡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。

ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円ヘッジ・円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

(運用方法)

①投資対象

新興国の米ドル建ての公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

新興国の米ドル建ての公社債を主要投資対象とし、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円ヘッジ・円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

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

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

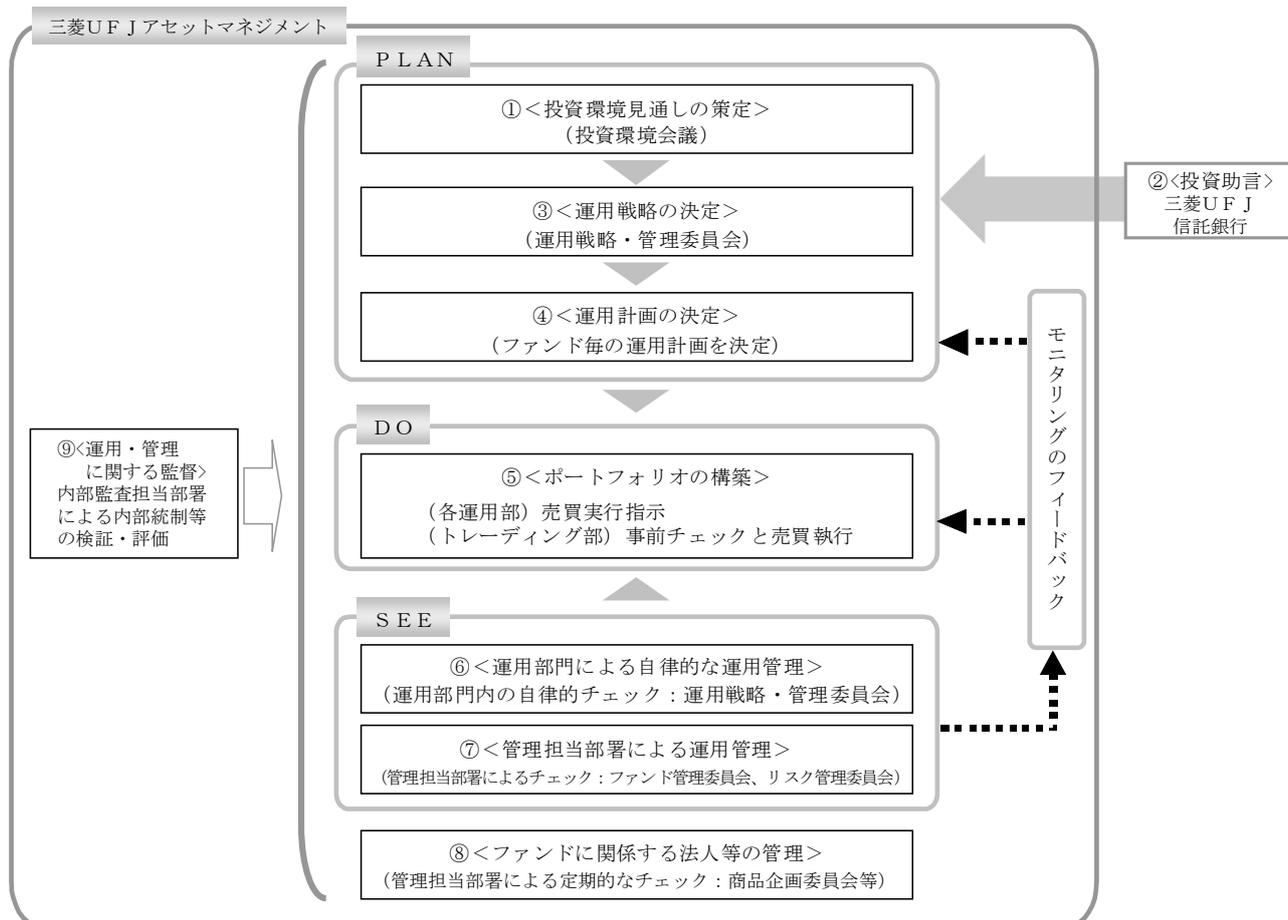
⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

- ⑧有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑨スワップ取引は効率的な運用に資するために行うことができます。
- ⑩金利先渡し取引および為替先渡し取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑪外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- 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。

(3) 【運用体制】



- ①投資環境見通しの策定
投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。
- ②投資助言
当ファンドは、三菱UFJ信託銀行（「助言元」といいます。）から運用戦略または運用計画の立案に資する投資助言を受けています。
- ③運用戦略の決定
運用戦略・管理委員会において、①で策定された投資環境見通し、および②の投資助言に沿って運用戦略を決定します。
- ④運用計画の決定
③で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。
- ⑤ポートフォリオの構築
各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。
- ⑥運用部門による自律的な運用管理
運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかど

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

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.mufg.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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑤信用取引

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

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提

供の指図を行うものとします。

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

⑧資金の借入れ

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

⑨投資する株式等の範囲

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

⑩金利先渡取引および為替先渡取引

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

⑫有価証券の空売り

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または⑦の規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をす

ることができるものとします。

- b. a. の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

⑬特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

⑭デリバティブ取引等

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

⑮信用リスクの分散規制

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

<その他法令等に定められた投資制限>

・同一の法人の発行する株式への投資制限

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

3 【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

(主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。)

①価格変動リスク

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

②為替変動リスク

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

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

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

③信用リスク

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

④流動性リスク

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

⑤カントリーリスク

「三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）」

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

※留意事項

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

(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

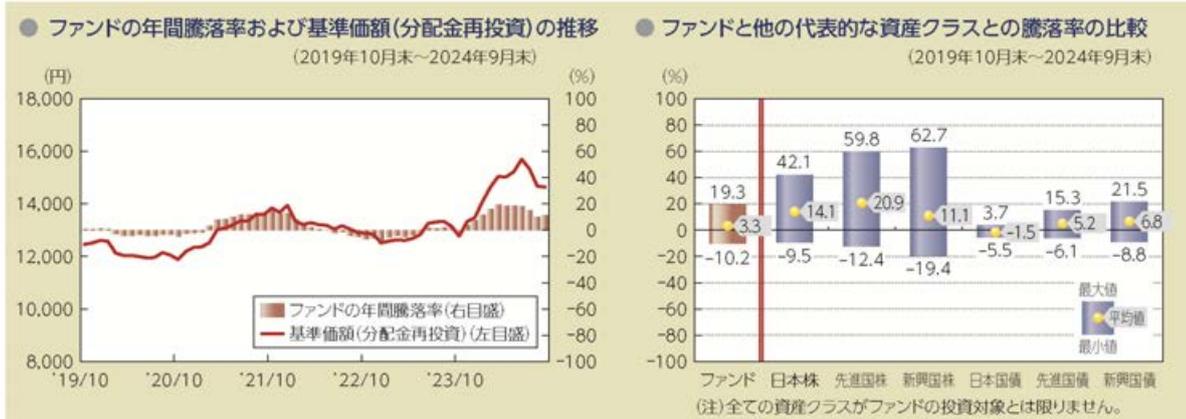
下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

株式抑制型



- 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。

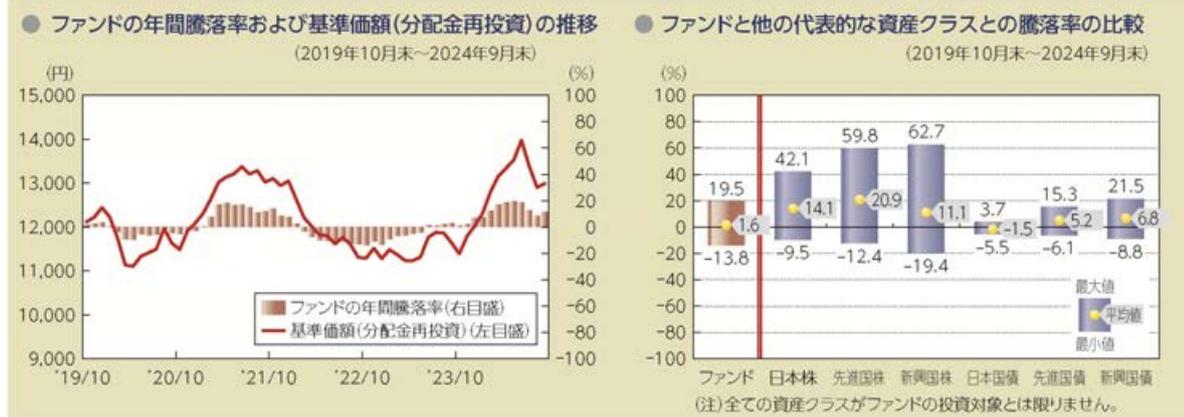
株式重視型



- 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。

新興国投資型



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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

申込価額（発行価格）×2.2%（税抜 2%）を上限として販売会社が定める手数料率

申込手数料は販売会社にご確認ください。

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、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

※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、各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、次に掲げる率を乗じて得た額とし、日々各ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は消費税等相当額を含みます。

	信託報酬率
株式抑制型	年 0.935%（税抜 0.850%）
株式重視型／新興国投資型	年 1.430%（税抜 1.300%）

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。

	配分（税抜）		対価として提供する役務の内容
	株式抑制型	株式重視型／ 新興国投資型	
委託会社	0.485%	0.750%	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	0.330%	0.500%	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	0.035%	0.050%	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、新興国株式インデックスマザーファンド、ヘッジ付新興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%、復興特別所得税 0.315%、地方税 5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません）・申告分離課税を選択することもできます。

2. 解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

※公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に「NISA（少額投資非課税制度）」の適用対象となります。ファンドは、NISAの対象ではありません。

②法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

◇個別元本について

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

②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行

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

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

◇収益分配金について

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

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

※上記は2024年9月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

(参考情報) ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間(以下「当期間」といいます。)(2023年3月28日～2024年3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
株式抑制型	1.44%	1.43%	0.01%
株式重視型	1.44%	1.43%	0.01%
新興国投資型	1.46%	1.43%	0.03%

(比率は年率、表示桁数未満四捨五入)

※「株式抑制型」は当期間後に信託報酬率の変更を行っています。

※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】

【三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)】

(1) 【投資状況】

2024年9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	15,252,796,186	96.26
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	592,018,346	3.74
純資産総額		15,844,814,532	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

2024年9月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックスマザーファンド	8,309,075,971	0.9190	7,636,040,818	0.9166	7,616,099,035	48.07
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	3,489,091,306	1.1166	3,895,919,353	1.1313	3,947,208,994	24.91
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	407,490,487	6.8599	2,795,346,517	7.0862	2,887,559,088	18.22
日本	親投資信託受益証券	TOPIXマザーファンド	244,363,918	3.2061	783,455,158	3.2817	801,929,069	5.06

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	96.26
合計	96.26

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

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2024年9月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第2計算期間末日 (2015年3月25日)	21,743,970,931	21,743,970,931	11,001	11,001
第3計算期間末日 (2016年3月25日)	52,322,002,817	52,322,002,817	10,915	10,915
第4計算期間末日 (2017年3月27日)	46,411,260,274	46,411,260,274	10,781	10,781
第5計算期間末日 (2018年3月26日)	27,872,022,932	27,872,022,932	11,124	11,124
第6計算期間末日 (2019年3月25日)	30,377,735,462	30,377,735,462	11,215	11,215
第7計算期間末日 (2020年3月25日)	28,457,787,754	28,457,787,754	11,015	11,015

第8計算期間末日	(2021年3月25日)	25,856,771,935	25,856,771,935	11,347	11,347
第9計算期間末日	(2022年3月25日)	21,812,432,808	21,812,432,808	11,322	11,322
第10計算期間末日	(2023年3月27日)	19,195,691,228	19,195,691,228	10,819	10,819
第11計算期間末日	(2024年3月25日)	17,469,607,404	17,469,607,404	11,645	11,645
	2023年9月末日	18,035,645,106	—	10,837	—
	10月末日	17,429,041,801	—	10,616	—
	11月末日	17,743,684,034	—	10,972	—
	12月末日	17,537,917,723	—	11,089	—
	2024年1月末日	17,520,019,299	—	11,288	—
	2月末日	17,503,546,130	—	11,495	—
	3月末日	17,429,902,877	—	11,671	—
	4月末日	16,962,887,680	—	11,579	—
	5月末日	16,774,585,730	—	11,594	—
	6月末日	16,839,436,415	—	11,802	—
	7月末日	16,355,756,801	—	11,665	—
	8月末日	15,917,947,225	—	11,406	—
	9月末日	15,844,814,532	—	11,408	—

②【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第2計算期間	0円
第3計算期間	0円
第4計算期間	0円
第5計算期間	0円
第6計算期間	0円
第7計算期間	0円
第8計算期間	0円
第9計算期間	0円
第10計算期間	0円
第11計算期間	0円

③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第2計算期間	8.19
第3計算期間	△0.78
第4計算期間	△1.22
第5計算期間	3.18
第6計算期間	0.81

第7計算期間	△1.78
第8計算期間	3.01
第9計算期間	△0.22
第10計算期間	△4.44
第11計算期間	7.63
第12中間計算期間	△1.88

(注)「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配の額）を控除した額を当該基準価額（分配の額）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2計算期間	21,162,714,048	2,322,836,403	19,766,238,377
第3計算期間	35,213,444,969	7,042,824,390	47,936,858,956
第4計算期間	14,107,298,059	18,996,501,741	43,047,655,274
第5計算期間	4,023,376,097	22,015,232,045	25,055,799,326
第6計算期間	5,274,825,327	3,244,462,370	27,086,162,283
第7計算期間	1,987,264,985	3,238,817,169	25,834,610,099
第8計算期間	525,345,517	3,573,208,348	22,786,747,268
第9計算期間	519,013,721	4,040,116,658	19,265,644,331
第10計算期間	66,798,497	1,589,190,634	17,743,252,194
第11計算期間	28,533,597	2,769,604,805	15,002,180,986
第12中間計算期間	19,034,416	1,115,286,095	13,905,929,307

【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）】

(1)【投資状況】

2024年9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	18,367,877,172	96.36
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	693,827,364	3.64
純資産総額		19,061,704,536	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

2024年9月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
------	----	-----	----	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------

日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	896,636,175	6.9371	6,220,141,149	7.0862	6,353,743,263	33.33
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	4,178,574,896	1.1109	4,641,978,852	1.1313	4,727,221,779	24.80
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	4,386,965,992	0.9156	4,016,706,063	0.9166	4,021,093,028	21.10
日本	親投資信託受益証券	T O P I Xマザーファンド	995,160,771	3.1784	3,163,018,995	3.2817	3,265,819,102	17.13

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	96.36
合計	96.36

(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2024年9月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第2計算期間末日 (2015年3月25日)	24,655,190,688	24,655,190,688	11,765	11,765
第3計算期間末日 (2016年3月25日)	61,738,348,442	61,738,348,442	11,488	11,488
第4計算期間末日 (2017年3月27日)	43,553,330,759	43,553,330,759	11,535	11,535
第5計算期間末日 (2018年3月26日)	27,531,362,672	27,531,362,672	12,321	12,321
第6計算期間末日 (2019年3月25日)	31,437,259,282	31,437,259,282	12,534	12,534
第7計算期間末日 (2020年3月25日)	28,750,760,854	28,750,760,854	12,010	12,010
第8計算期間末日 (2021年3月25日)	26,855,099,280	26,855,099,280	12,862	12,862
第9計算期間末日 (2022年3月25日)	22,691,860,863	22,691,860,863	13,219	13,219
第10計算期間末日 (2023年3月27日)	19,985,923,195	19,985,923,195	12,488	12,488
第11計算期間末日 (2024年3月25日)	20,538,508,706	20,538,508,706	14,991	14,991
2023年9月末日	19,643,343,231	—	13,151	—
10月末日	18,914,109,765	—	12,772	—

11 月末日	19,510,867,416	—	13,325	—
12 月末日	19,311,176,555	—	13,481	—
2024 年 1 月末日	19,839,904,249	—	14,099	—
2 月末日	20,225,912,445	—	14,645	—
3 月末日	20,536,319,152	—	15,044	—
4 月末日	20,364,865,944	—	15,023	—
5 月末日	20,453,760,992	—	15,226	—
6 月末日	20,853,450,677	—	15,698	—
7 月末日	20,215,148,704	—	15,327	—
8 月末日	19,200,559,999	—	14,677	—
9 月末日	19,061,704,536	—	14,635	—

② 【分配の推移】

	1 万口当たりの分配金
第 2 計算期間	0 円
第 3 計算期間	0 円
第 4 計算期間	0 円
第 5 計算期間	0 円
第 6 計算期間	0 円
第 7 計算期間	0 円
第 8 計算期間	0 円
第 9 計算期間	0 円
第 10 計算期間	0 円
第 11 計算期間	0 円

③ 【収益率の推移】

	収益率 (%)
第 2 計算期間	14.31
第 3 計算期間	△2.35
第 4 計算期間	0.40
第 5 計算期間	6.81
第 6 計算期間	1.72
第 7 計算期間	△4.18
第 8 計算期間	7.09
第 9 計算期間	2.77
第 10 計算期間	△5.52
第 11 計算期間	20.04
第 12 中間計算期間	△2.37

(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2計算期間	25,095,132,460	5,444,511,240	20,955,742,188
第3計算期間	43,638,216,569	10,852,980,012	53,740,978,745
第4計算期間	5,975,078,368	21,959,271,960	37,756,785,153
第5計算期間	5,921,593,950	21,334,148,864	22,344,230,239
第6計算期間	5,496,470,932	2,758,727,653	25,081,973,518
第7計算期間	2,340,829,162	3,484,699,835	23,938,102,845
第8計算期間	424,139,994	3,482,947,344	20,879,295,495
第9計算期間	528,655,909	4,242,306,956	17,165,644,448
第10計算期間	255,946,355	1,417,067,402	16,004,523,401
第11計算期間	139,732,101	2,443,677,046	13,700,578,456
第12中間計算期間	53,243,343	711,812,285	13,042,009,514

【三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)】

(1)【投資状況】

2024年9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	3,935,352,813	97.88
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	85,333,385	2.12
純資産総額		4,020,686,198	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

2024年9月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド	1,387,131,324	0.9153	1,269,641,301	0.9507	1,318,745,749	32.80
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	1,155,848,245	1.1173	1,291,431,361	1.1313	1,307,611,119	32.52
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	1,426,563,394	0.9109	1,299,556,584	0.9166	1,307,588,006	32.52
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	173,160	6.5625	1,136,363	7.0862	1,227,046	0.03
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックスマザーファンド	44,810	3.6788	164,848	4.0369	180,893	0.00

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	97.88
合計	97.88

(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2024年9月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第2計算期間末日 (2015年3月25日)	1,066,640,671	1,066,640,671	10,816	10,816
第3計算期間末日 (2016年3月25日)	1,296,388,956	1,296,388,956	10,811	10,811
第4計算期間末日 (2017年3月27日)	1,185,983,561	1,185,983,561	11,276	11,276
第5計算期間末日 (2018年3月26日)	8,838,464,673	8,838,464,673	12,488	12,488
第6計算期間末日 (2019年3月25日)	9,471,549,757	9,471,549,757	12,185	12,185
第7計算期間末日 (2020年3月25日)	8,417,184,461	8,417,184,461	11,099	11,099
第8計算期間末日 (2021年3月25日)	7,842,260,783	7,842,260,783	12,768	12,768
第9計算期間末日 (2022年3月25日)	5,200,930,166	5,200,930,166	12,033	12,033
第10計算期間末日 (2023年3月27日)	4,350,134,203	4,350,134,203	11,131	11,131
第11計算期間末日 (2024年3月25日)	4,514,210,743	4,514,210,743	13,118	13,118
2023年9月末日	4,354,505,955	—	11,640	—
10月末日	4,229,235,786	—	11,391	—
11月末日	4,331,088,904	—	11,792	—
12月末日	4,340,248,573	—	12,033	—
2024年1月末日	4,344,168,504	—	12,313	—
2月末日	4,463,763,620	—	12,795	—
3月末日	4,499,034,994	—	13,160	—

4 月末日	4, 485, 822, 199	—	13, 337	—
5 月末日	4, 402, 354, 756	—	13, 520	—
6 月末日	4, 451, 788, 837	—	13, 977	—
7 月末日	4, 173, 367, 063	—	13, 385	—
8 月末日	4, 013, 765, 841	—	12, 904	—
9 月末日	4, 020, 686, 198	—	12, 988	—

②【分配の推移】

	1 万口当たりの分配金
第 2 計算期間	0 円
第 3 計算期間	0 円
第 4 計算期間	0 円
第 5 計算期間	0 円
第 6 計算期間	0 円
第 7 計算期間	0 円
第 8 計算期間	0 円
第 9 計算期間	0 円
第 10 計算期間	0 円
第 11 計算期間	0 円

③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第 2 計算期間	7.78
第 3 計算期間	△0.04
第 4 計算期間	4.30
第 5 計算期間	10.74
第 6 計算期間	△2.42
第 7 計算期間	△8.91
第 8 計算期間	15.03
第 9 計算期間	△5.75
第 10 計算期間	△7.49
第 11 計算期間	17.85
第 12 中間計算期間	△0.80

(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 2 計算期間	1, 152, 904, 287	291, 375, 437	986, 209, 120

第3計算期間	551,196,595	338,236,484	1,199,169,231
第4計算期間	468,990,819	616,395,704	1,051,764,346
第5計算期間	7,312,217,505	1,286,533,821	7,077,448,030
第6計算期間	1,589,895,766	894,060,789	7,773,283,007
第7計算期間	619,203,622	808,866,213	7,583,620,416
第8計算期間	97,832,324	1,539,250,882	6,142,201,858
第9計算期間	79,829,486	1,899,825,819	4,322,205,525
第10計算期間	31,065,353	445,103,881	3,908,166,997
第11計算期間	30,738,192	497,568,827	3,441,336,362
第12中間計算期間	5,150,826	349,052,397	3,097,434,791

(参考)

TOPIXマザーファンド

投資状況

2024年9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	1,476,908,429,160	98.38
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	24,279,792,618	1.62
純資産総額		1,501,188,221,778	100.00

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

その他の資産の投資状況

2024年9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	24,251,100,000	1.62

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

2024年9月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	21,084,000	3,599.46	75,891,187,579	2,542.50	53,606,070,000	3.57
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	13,887,500	2,616.56	36,337,510,794	2,777.50	38,572,531,250	2.57
日本	株式	日立製作所	電気機器	9,626,200	2,835.01	27,290,410,775	3,781.00	36,396,662,200	2.42

日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	23,788,700	1,580.14	37,589,662,520	1,453.50	34,576,875,450	2.30
日本	株式	キーエンス	電気機器	396,800	70,169.22	27,843,149,491	68,360.00	27,125,248,000	1.81
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	2,936,400	6,719.30	19,730,577,334	8,705.00	25,561,362,000	1.70
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	8,147,500	3,019.39	24,600,480,025	3,045.00	24,809,137,500	1.65
日本	株式	三菱商事	卸売業	8,057,700	3,502.94	28,225,644,102	2,952.50	23,790,359,250	1.58
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	2,820,800	6,658.92	18,783,491,574	7,678.00	21,658,102,400	1.44
日本	株式	信越化学工業	化学	3,562,600	6,676.49	23,785,686,603	5,977.00	21,293,660,200	1.42
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	839,400	37,932.95	31,840,921,068	25,290.00	21,228,426,000	1.41
日本	株式	三井物産	卸売業	6,286,200	3,555.15	22,348,427,736	3,178.00	19,977,543,600	1.33
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	3,813,800	4,781.74	18,236,618,530	5,231.00	19,949,987,800	1.33
日本	株式	任天堂	その他製品	2,504,000	8,276.49	20,724,347,138	7,636.00	19,120,544,000	1.27
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	118,323,100	179.51	21,241,236,365	146.80	17,369,831,080	1.16
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,962,200	9,151.55	17,957,178,241	8,427.00	16,535,459,400	1.10
日本	株式	第一三共	医薬品	3,465,300	4,902.92	16,990,109,434	4,709.00	16,318,097,700	1.09
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	5,272,600	3,052.27	16,093,443,059	2,936.00	15,480,353,600	1.03
日本	株式	HOYA	精密機器	780,800	19,053.53	14,876,997,869	19,785.00	15,448,128,000	1.03
日本	株式	三菱重工業	機械	7,005,200	1,397.70	9,791,199,298	2,117.50	14,833,511,000	0.99
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	3,520,600	4,339.19	15,276,553,571	4,103.00	14,445,021,800	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	9,397,400	1,852.87	17,412,236,091	1,507.50	14,166,580,500	0.94
日本	株式	KDDI	情報・通信業	2,925,800	4,511.94	13,201,042,964	4,594.00	13,441,125,200	0.90
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	63,639,000	201.48	12,822,599,799	187.20	11,913,220,800	0.79
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	236,000	45,533.72	10,745,958,053	47,420.00	11,191,120,000	0.75
日本	株式	富士通	電気機器	3,686,200	2,514.56	9,269,177,056	2,935.50	10,820,840,100	0.72
日本	株式	三菱電機	電気機器	4,387,900	2,543.62	11,161,178,370	2,303.50	10,107,527,650	0.67
日本	株式	村田製作所	電気機器	3,542,900	2,875.78	10,188,614,395	2,806.50	9,943,148,850	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	2,373,100	4,015.91	9,530,172,960	4,179.00	9,917,184,900	0.66
日本	株式	ダイキン工業	機械	478,200	20,505.57	9,805,767,781	20,075.00	9,599,865,000	0.64

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年9月30日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.27
	建設業	2.19
	食料品	3.22
	繊維製品	0.39
	パルプ・紙	0.15
	化学	5.74
	医薬品	4.57

	石油・石炭製品	0.55
	ゴム製品	0.59
	ガラス・土石製品	0.67
	鉄鋼	0.85
	非鉄金属	0.79
	金属製品	0.51
	機械	5.45
	電気機器	17.39
	輸送用機器	7.10
	精密機器	2.39
	その他製品	2.47
	電気・ガス業	1.35
	陸運業	2.35
	海運業	0.79
	空運業	0.38
	倉庫・運輸関連業	0.15
	情報・通信業	7.44
	卸売業	7.25
	小売業	4.44
	銀行業	7.29
	証券、商品先物取引業	0.80
	保険業	2.99
	その他金融業	1.19
	不動産業	1.92
	サービス業	4.67
	小計	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

2024年9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 24年12月限	買建	916	円	23,688,249,300	24,251,100,000	1.62

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

外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

2024年9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	4,541,226,733,942	72.52
	イギリス	239,257,216,589	3.82
	カナダ	197,650,120,750	3.16
	フランス	173,530,347,689	2.77
	スイス	164,219,821,255	2.62
	ドイツ	146,695,019,963	2.34
	オーストラリア	116,358,841,935	1.86
	オランダ	98,858,905,883	1.58
	デンマーク	55,125,129,110	0.88
	スウェーデン	54,907,118,444	0.88
	スペイン	44,493,432,810	0.71
	イタリア	35,426,429,397	0.57
	香港	29,904,804,948	0.48
	シンガポール	18,069,231,108	0.29
	フィンランド	16,635,758,821	0.27
	ベルギー	12,806,497,077	0.20
	ノルウェー	9,253,491,188	0.15
	イスラエル	5,719,091,553	0.09
	アイルランド	4,865,345,778	0.08
	オーストリア	3,020,305,033	0.05
	ルクセンブルク	3,010,959,595	0.05
ニュージーランド	2,794,129,790	0.04	
ポルトガル	2,542,106,415	0.04	
バミューダ	790,538,962	0.01	
	小計	5,977,161,378,035	95.45
投資証券	アメリカ	105,277,928,306	1.68
	オーストラリア	8,144,818,542	0.13
	フランス	2,382,275,903	0.04
	イギリス	1,986,049,527	0.03
	シンガポール	1,759,989,870	0.03
	香港	1,178,006,009	0.02
	ベルギー	442,044,419	0.01
	カナダ	299,163,421	0.00
	小計	121,470,275,997	1.94
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	163,131,047,283	2.61
純資産総額		6,261,762,701,315	100.00

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

その他の資産の投資状況

2024年9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	123,326,498,785	1.97
	買建	カナダ	5,604,854,875	0.09
	買建	ドイツ	18,373,218,593	0.29
	買建	オーストラリア	4,910,472,303	0.08
	買建	イギリス	6,352,267,101	0.10
	買建	スイス	4,228,187,184	0.07

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

2024年9月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	9,444,464	26,691.32	252,085,278,460	32,512.46	307,062,821,299	4.90
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4,577,719	59,443.75	272,116,821,533	61,091.29	279,658,780,025	4.47
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	15,950,677	13,322.38	212,501,133,033	17,327.42	276,384,111,565	4.41
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	6,073,316	26,663.96	161,938,691,089	26,828.95	162,940,740,492	2.60
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・エンターテインメント	1,421,055	68,369.41	97,156,702,593	80,979.29	115,076,028,930	1.84
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・エンターテインメント	3,807,117	24,015.74	91,430,769,332	23,400.58	89,088,759,253	1.42
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・エンターテインメント	3,276,487	23,688.13	77,613,862,501	23,591.84	77,298,362,636	1.23
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	2,868,239	19,444.22	55,770,691,606	24,648.04	70,696,480,214	1.13
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1,862,326	24,831.16	46,243,717,281	37,175.45	69,232,817,898	1.11
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	523,962	110,720.41	58,013,288,270	125,286.96	65,645,609,646	1.05

			ンス						
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	858,047	59,238.73	50,829,615,425	65,294.69	56,025,915,530	0.89
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1,861,600	28,506.65	53,067,992,343	30,044.66	55,931,148,364	0.89
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	597,201	73,712.81	44,021,368,970	83,047.45	49,596,020,486	0.79
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	2,908,489	16,770.53	48,776,910,696	16,530.98	48,080,198,502	0.77
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	1,020,157	39,933.42	40,738,358,293	39,275.01	40,066,680,559	0.64
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	537,834	65,258.28	35,098,125,760	70,457.23	37,894,297,712	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	1,529,454	23,843.58	36,467,661,164	24,770.79	37,885,786,143	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	643,912	49,563.86	31,914,766,494	57,024.91	36,719,028,291	0.59
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	287,513	113,535.44	32,642,915,028	126,404.54	36,342,949,257	0.58
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,559,841	21,479.47	33,504,563,970	23,036.62	35,933,467,497	0.57
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,091,145	19,007.98	39,748,451,816	17,029.17	35,610,463,700	0.57
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	2,867,301	8,808.81	25,257,527,929	11,386.99	32,649,954,767	0.52
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,146,187	23,219.57	26,613,980,594	27,802.37	31,866,722,743	0.51
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	259,399	137,708.67	35,721,493,230	120,736.33	31,318,885,600	0.50
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	279,769	87,950.85	24,605,922,764	100,960.06	28,245,496,565	0.45
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	2,651,680	9,091.68	24,108,249,085	10,246.58	27,170,669,021	0.43
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,644,252	18,429.52	30,302,785,626	16,226.97	26,681,233,960	0.43
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	1,073,958	17,047.61	18,308,420,404	24,084.26	25,865,483,916	0.41
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	4,567,914	5,513.74	25,186,298,278	5,623.56	25,687,947,590	0.41
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	629,849	38,936.00	24,523,803,722	39,484.82	24,869,478,927	0.40

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年9月30日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	エネルギー	3.96
	素材	3.66
	資本財	7.03
	商業・専門サービス	1.54
	運輸	1.55
	自動車・自動車部品	1.69
	耐久消費財・アパレル	1.31
	消費者サービス	1.89
	メディア・娯楽	6.18
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.73
	生活必需品流通・小売り	1.74
	食品・飲料・タバコ	3.07
	家庭用品・パーソナル用品	1.57
	ヘルスケア機器・サービス	4.00
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.59
	銀行	5.43
	金融サービス	6.64
	保険	3.07
	ソフトウェア・サービス	9.51
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.38
電気通信サービス	1.17	
公益事業	2.72	
半導体・半導体製造装置	8.74	
不動産管理・開発	0.29	
	小計	95.45
投資証券	—	1.94
合計		97.39

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

2024年9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 EMINI2412	買建	2,984	アメリカドル	852,835,766.4	121,725,248,938	864,054,500	123,326,498,785	1.97
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602412	買建	184	カナダドル	52,684,506	5,561,903,298	53,091,360	5,604,854,875	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 2412	買建	2,261	ユーロ	111,073,688.45	17,708,478,149	115,243,170	18,373,218,593	0.29
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2412	買建	241	オーストラリアドル	49,461,962.75	4,883,379,582	49,736,375	4,910,472,303	0.08
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2412	買建	397	イギリスポンド	33,265,436.25	6,354,696,286	33,252,720	6,352,267,101	0.10
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX2412	買建	203	スイスフラン	24,554,345.55	4,167,117,982	24,914,190	4,228,187,184	0.07

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

新興国株式インデックスマザーファンド

投資状況

2024年9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	香港	197,708,322,876	20.34
	インド	188,711,382,939	19.42
	台湾	172,753,007,132	17.77
	韓国	102,359,178,729	10.53
	ブラジル	40,034,446,103	4.12
	サウジアラビア	36,630,494,833	3.77
	中国	35,816,842,569	3.68
	南アフリカ	30,411,083,895	3.13
	アメリカ	29,542,652,784	3.04
	メキシコ	17,183,744,827	1.77
	インドネシア	16,203,098,786	1.67
	マレーシア	14,679,396,996	1.51
	タイ	14,289,628,589	1.47
	アラブ首長国連邦	10,819,059,303	1.11
	ポーランド	8,261,979,105	0.85
	カタール	7,219,126,029	0.74
	クウェート	6,435,862,128	0.66
	トルコ	5,719,186,851	0.59
	フィリピン	5,431,183,416	0.56
ギリシャ	4,530,723,132	0.47	

	チリ	3,799,847,515	0.39
	ハンガリー	2,332,099,527	0.24
	チェコ	1,134,428,676	0.12
	コロンビア	829,300,652	0.09
	小計	952,836,077,392	98.03
投資証券	メキシコ	872,048,651	0.09
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	18,276,635,494	1.88
純資産総額		971,984,761,537	100.00

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

その他の資産の投資状況

2024年9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	16,803,511,552	1.73

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

2024年9月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・ 半導体製 造装置	19,845,000	3,713.61	73,696,736,803	4,513.60	89,572,392,000	9.22
香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディ ア・娯楽	5,286,000	6,838.28	36,147,151,715	8,042.38	42,512,052,396	4.37
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロ ジー・ハ ードウェ アおよび 機器	3,851,220	8,631.44	33,241,600,644	7,023.48	27,048,966,646	2.78
香港	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	12,285,600	1,433.15	17,607,228,366	1,882.92	23,132,863,380	2.38
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギ ー	2,470,138	4,858.28	12,000,632,287	5,219.51	12,892,930,989	1.33
香港	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サ ービス	4,060,720	2,192.71	8,904,012,570	3,023.70	12,278,407,185	1.26
アメリカ	株式	PDD HOLDINGS INC	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	563,475	18,655.11	10,511,693,552	19,322.78	10,887,907,630	1.12
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	3,454,554	2,611.70	9,022,282,276	2,997.03	10,353,407,156	1.07
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	4,138,686	1,931.22	7,992,727,487	2,234.28	9,247,008,188	0.95

韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	445,689	19,955.51	8,893,951,834	20,107.71	8,961,789,619	0.92
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	2,692,108	2,505.40	6,744,820,066	3,260.54	8,777,732,549	0.90
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	10,012,272	777.95	7,789,131,612	862.09	8,631,555,662	0.89
香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	77,548,550	103.12	7,997,301,310	110.03	8,533,155,512	0.88
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	1,234,236	5,043.13	6,224,424,770	5,687.13	7,019,267,988	0.72
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	2,093,060	2,326.90	4,870,361,294	2,966.16	6,208,363,408	0.64
香港	株式	JD.COM INC-CLASS A	一般消費財・サービス流通・小売り	2,060,533	2,246.53	4,629,062,777	2,792.24	5,753,502,664	0.59
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	1,578,850	3,029.32	4,782,856,826	3,357.49	5,300,974,665	0.55
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	714,623	6,706.44	4,792,578,746	7,367.87	5,265,254,365	0.54
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	144,675	31,376.87	4,539,448,992	35,193.38	5,091,602,570	0.52
香港	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	12,271,800	353.99	4,344,124,523	403.22	4,948,253,604	0.51
香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	55,794,350	82.51	4,603,851,558	86.52	4,827,477,807	0.50
アメリカ	株式	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	銀行	2,416,284	2,135.62	5,160,279,121	1,979.66	4,783,433,107	0.49
ブラジル	株式	VALE SA	素材	2,822,829	1,664.98	4,699,970,776	1,678.68	4,738,648,502	0.49
香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	5,198,500	748.43	3,890,746,781	892.78	4,641,127,227	0.48
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	44,470,200	90.02	4,003,537,792	101.17	4,499,272,485	0.46
香港	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	1,614,095	2,770.94	4,472,566,651	2,678.34	4,323,104,887	0.44
香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	62,449,000	68.39	4,271,346,610	68.52	4,279,011,725	0.44
インド	株式	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	自動車・自動車部品	750,495	3,878.86	2,911,070,251	5,444.04	4,085,725,925	0.42
香港	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	804,500	4,126.88	3,320,079,495	5,066.44	4,075,955,807	0.42
香港	株式	TRIP.COM GROUP LTD	消費者サービス	462,679	7,629.17	3,529,860,214	8,707.37	4,028,721,871	0.41

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年9月30日現在

種類	業種	投資比率 (%)
----	----	----------

株式	エネルギー	4.72
	素材	6.56
	資本財	4.67
	商業・専門サービス	0.03
	運輸	1.86
	自動車・自動車部品	3.82
	耐久消費財・アパレル	1.16
	消費者サービス	2.78
	メディア・娯楽	6.30
	一般消費財・サービス流通・小売り	5.66
	生活必需品流通・小売り	1.28
	食品・飲料・タバコ	2.99
	家庭用品・パーソナル用品	0.74
	ヘルスケア機器・サービス	0.91
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.56
	銀行	16.73
	金融サービス	2.92
	保険	2.93
	ソフトウェア・サービス	2.49
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.79
	電気通信サービス	2.78
	公益事業	2.74
	半導体・半導体製造装置	12.15
不動産管理・開発	1.48	
小計	98.03	
投資証券	—	0.09
合計		98.12

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

2024年9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	ニューヨーク証券取引所	MINI MS 2412	買建	1,974	アメリカドル	110,740,685.4	15,806,018,026	117,729,360	16,803,511,552	1.73

(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

2024年9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	247,710,984,520	84.69
地方債証券	日本	14,932,393,730	5.11
特殊債券	日本	12,174,661,611	4.16
社債券	日本	16,781,084,300	5.74
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	881,669,875	0.30
純資産総額		292,480,794,036	100.00

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

その他の資産の投資状況

2024年9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 (%)
債券先物取引	買建	日本	289,300,000	0.10

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

2024年9月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	4,230,000,000	99.28	4,199,887,000	99.27	4,199,374,800	0.005000	2026/9/20	1.44
日本	国債証券	第372回利付国債(10年)	3,600,000,000	99.05	3,565,978,700	100.33	3,612,060,000	0.800000	2033/9/20	1.23
日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	3,400,000,000	99.45	3,381,538,000	99.53	3,384,122,000	0.005000	2026/3/20	1.16
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	3,460,000,000	96.47	3,338,072,500	97.38	3,369,382,600	0.100000	2030/12/20	1.15
日本	国債証券	第373回利付国債(10年)	3,270,000,000	97.00	3,172,142,400	98.28	3,213,821,400	0.600000	2033/12/20	1.10
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	3,300,000,000	96.00	3,168,179,000	97.17	3,206,775,000	0.400000	2033/6/20	1.10
日本	国債証券	第171回利付国債(5年)	3,190,000,000	99.55	3,175,650,400	99.56	3,176,027,800	0.400000	2029/6/20	1.09
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	3,090,000,000	99.06	3,061,027,000	99.18	3,064,816,500	0.005000	2026/12/20	1.05
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	3,090,000,000	97.28	3,006,031,000	97.72	3,019,609,800	0.100000	2030/6/20	1.03

日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	3,030,000,000	97.48	2,953,920,400	98.56	2,986,368,000	0.500000	2032/12/20	1.02
日本	国債証券	第156回利付国債(5年)	2,960,000,000	99.07	2,932,472,000	99.38	2,941,648,000	0.200000	2027/12/20	1.01
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	3,000,000,000	95.44	2,863,498,300	96.72	2,901,840,000	0.200000	2032/6/20	0.99
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	2,940,000,000	96.33	2,832,363,400	97.19	2,857,386,000	0.100000	2031/3/20	0.98
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	2,940,000,000	95.39	2,804,589,500	96.50	2,837,276,400	0.100000	2031/12/20	0.97
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	2,860,000,000	96.03	2,746,647,500	96.99	2,773,914,000	0.100000	2031/6/20	0.95
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	2,770,000,000	95.31	2,640,087,000	96.44	2,671,498,800	0.200000	2032/9/20	0.91
日本	国債証券	第374回利付国債(10年)	2,670,000,000	98.51	2,630,469,100	99.78	2,664,126,000	0.800000	2034/3/20	0.91
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	2,670,000,000	99.30	2,651,310,000	99.40	2,654,033,400	0.005000	2026/6/20	0.91
日本	国債証券	第163回利付国債(5年)	2,610,000,000	99.62	2,600,161,000	99.86	2,606,424,300	0.400000	2028/9/20	0.89
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	2,660,000,000	95.76	2,547,243,100	97.00	2,580,279,800	0.200000	2032/3/20	0.88
日本	国債証券	第455回利付国債(2年)	2,580,000,000	99.58	2,569,410,000	99.69	2,572,027,800	0.005000	2025/12/1	0.88
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	2,550,000,000	97.08	2,475,540,000	97.56	2,487,984,000	0.100000	2030/9/20	0.85
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	2,540,000,000	96.04	2,439,416,000	96.75	2,457,500,800	0.100000	2031/9/20	0.84
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	2,370,000,000	98.89	2,343,731,500	98.99	2,346,086,700	0.005000	2027/6/20	0.80
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	2,380,000,000	96.70	2,301,697,800	98.28	2,339,135,400	0.500000	2033/3/20	0.80
日本	国債証券	第460回利付国債(2年)	2,200,000,000	100.02	2,200,512,000	99.93	2,198,614,000	0.300000	2026/5/1	0.75
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	2,210,000,000	97.19	2,147,969,200	97.84	2,162,374,500	0.100000	2030/3/20	0.74
日本	国債証券	第151回利付国債(5年)	2,150,000,000	98.94	2,127,256,000	99.09	2,130,564,000	0.005000	2027/3/20	0.73
日本	国債証券	第158回利付国債(5年)	2,110,000,000	99.02	2,089,459,800	98.95	2,087,992,700	0.100000	2028/3/20	0.71
日本	国債証券	第375回利付国債(10年)	1,980,000,000	101.84	2,016,532,400	102.24	2,024,431,200	1.100000	2034/6/20	0.69

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	84.69
地方債証券	5.11
特殊債券	4.16
社債券	5.74
合計	99.70

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

2024年9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(%)
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物24年12月限	買建	2	円	289,061,870	289,300,000	0.10

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

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

2024年9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	166,752,939,426	45.43
	中国	39,445,390,475	10.75
	フランス	27,328,633,561	7.45
	イタリア	25,078,455,715	6.83
	ドイツ	21,730,399,058	5.92
	イギリス	19,553,588,868	5.33
	スペイン	16,472,557,121	4.49
	カナダ	7,287,114,809	1.99
	ベルギー	5,682,771,066	1.55
	オランダ	4,867,186,614	1.33
	オーストラリア	4,851,727,075	1.32
	オーストリア	4,160,079,935	1.13
	メキシコ	2,589,899,866	0.71
	フィンランド	1,905,603,096	0.52
	マレーシア	1,903,550,346	0.52
	ポーランド	1,869,061,270	0.51
	アイルランド	1,726,886,767	0.47
	シンガポール	1,603,023,267	0.44
	イスラエル	1,069,422,682	0.29
	ニュージーランド	918,832,831	0.25
デンマーク	916,182,154	0.25	
スウェーデン	566,736,893	0.15	
ノルウェー	559,021,610	0.15	
	小計	358,839,064,505	97.76
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	8,205,805,863	2.24
純資産総額		367,044,870,368	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

2024年9月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限(年/月/日)	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	4.375 T-NOTE 340515	12,150,000	14,557.97	1,768,793,729	14,998.91	1,822,368,281	4.375000	2034/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	4.5 T-NOTE 331115	11,500,000	14,676.92	1,687,846,478	15,122.68	1,739,109,295	4.500000	2033/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	3.875 T-NOTE 330815	10,540,000	13,952.25	1,470,567,755	14,439.14	1,521,886,048	3.875000	2033/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	4 T-NOTE 340215	10,200,000	14,076.00	1,435,752,873	14,566.26	1,485,759,092	4.000000	2034/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 310815	11,260,000	11,661.48	1,313,083,439	12,230.73	1,377,180,690	1.250000	2031/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	4.125 T-NOTE 321115	9,170,000	14,275.85	1,309,095,866	14,731.01	1,350,834,376	4.125000	2032/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 320515	9,900,000	13,034.42	1,290,408,275	13,537.60	1,340,222,988	2.875000	2032/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	3.375 T-NOTE 330515	9,350,000	13,435.17	1,256,188,853	13,925.65	1,302,048,567	3.375000	2033/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	3.5 T-NOTE 330215	9,190,000	13,602.35	1,250,056,593	14,072.00	1,293,217,460	3.500000	2033/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 311115	10,470,000	11,685.30	1,223,451,444	12,268.92	1,284,556,529	1.375000	2031/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 310215	10,300,000	11,771.04	1,212,417,473	12,317.15	1,268,666,755	1.125000	2031/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 320815	9,410,000	12,823.80	1,206,720,348	13,382.88	1,259,329,845	2.750000	2032/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 301115	10,320,000	11,593.95	1,196,496,455	12,184.45	1,257,436,142	0.875000	2030/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 310515	9,780,000	12,077.81	1,181,210,072	12,624.91	1,234,716,640	1.625000	2031/5/15	0.34
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300815	10,200,000	11,458.36	1,168,753,168	12,068.76	1,231,014,475	0.625000	2030/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 320215	9,510,000	12,069.24	1,147,785,561	12,647.77	1,202,803,269	1.875000	2032/2/15	0.33
アメリカ	国債証券	4.125 T-NOTE 270215	8,080,000	14,266.33	1,152,719,909	14,466.46	1,168,890,460	4.125000	2027/2/15	0.32
アメリカ	国債証券	4.375 T-NOTE 260731	8,000,000	14,381.18	1,150,495,147	14,468.13	1,157,451,099	4.375000	2026/7/31	0.32
中国	国債証券	2.46 CHINA GOVT 260215	54,000,000	2,051.92	1,108,040,840	2,059.15	1,111,942,503	2.460000	2026/2/15	0.30
フランス	国債証券	0.75 O.A.T 280525	7,170,000	14,849.29	1,064,694,106	15,049.99	1,079,084,476	0.750000	2028/5/25	0.29
アメリカ	国債証券	4.625 T-BOND 540515	6,940,000	14,873.62	1,032,229,882	15,548.64	1,079,076,267	4.625000	2054/5/15	0.29
アメリカ	国債証券	4.25 T-NOTE 290630	7,000,000	14,474.73	1,013,231,421	14,732.69	1,031,288,366	4.250000	2029/6/30	0.28
アメリカ	国債証券	4.75 T-BOND 531115	6,470,000	15,157.92	980,717,812	15,838.29	1,024,737,423	4.750000	2053/11/15	0.28
フランス	国債証券	2.5 O.A.T 300525	6,370,000	15,860.11	1,010,289,417	15,925.09	1,014,428,462	2.500000	2030/5/25	0.28
アメリカ	国債証券	4.5 T-NOTE 290531	6,650,000	14,667.71	975,403,370	14,886.57	989,957,019	4.500000	2029/5/31	0.27
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 270131	7,200,000	13,225.66	952,247,722	13,629.59	981,331,199	1.500000	2027/1/31	0.27

アメリカ	国債証券	4.5 T-NOTE 270415	6,500,000	14,131.98	918,578,879	14,613.93	949,905,785	4.500000	2027/4/15	0.26
アメリカ	国債証券	4 T-NOTE 290731	6,450,000	14,446.84	931,821,794	14,586.33	940,818,728	4.000000	2029/7/31	0.26
アメリカ	国債証券	4.25 T-NOTE 290228	6,340,000	14,226.00	901,928,540	14,710.94	932,674,032	4.250000	2029/2/28	0.25
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 280215	6,650,000	13,579.97	903,068,597	13,932.34	926,500,848	2.750000	2028/2/15	0.25

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.76
合計	97.76

(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。

ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド

投資状況

2024年9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	6,836,471,430	94.81
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	374,614,650	5.19
純資産総額		7,211,086,080	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

2024年9月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	FRN ARGENTINA 300709	1,536,000	7,492.32	115,082,058	8,649.43	132,855,368	0.750000	2030/7/9	1.84
アメリカ	国債証券	FRN ARGENTINA 350709	1,920,000	5,991.99	115,046,304	6,811.69	130,784,601	4.125000	2035/7/9	1.81
アメリカ	国債証券	4.4 QATAR 500416	800,000	12,642.66	101,141,333	13,292.30	106,338,475	4.400000	2050/4/16	1.47

アメリカ	国債証券	FRN ECUADOR 350731	1,250,000	7,561.83	94,522,942	8,130.03	101,625,405	5.500000	2035/7/31	1.41
アメリカ	国債証券	5.125 HAZINE MUST 260622	600,000	13,966.08	83,796,497	14,268.20	85,609,203	5.125000	2026/6/22	1.19
アメリカ	国債証券	3.75 QATAR 300416	600,000	13,808.74	82,852,481	14,134.65	84,807,954	3.750000	2030/4/16	1.18
アメリカ	国債証券	2.875 BRAZIL 250606	600,000	13,869.02	83,214,150	14,083.23	84,499,430	2.875000	2025/6/6	1.17
アメリカ	国債証券	5.5 POLAND 540318	570,000	13,936.65	79,438,951	14,627.63	83,377,494	5.500000	2054/3/18	1.16
アメリカ	国債証券	1.25 CHINA GOVT I 261026	600,000	13,369.51	80,217,115	13,617.14	81,702,878	1.250000	2026/10/26	1.13
アメリカ	国債証券	FRN ARGENTINA 380109	1,000,000	6,578.46	65,784,614	7,443.36	74,433,695	5.000000	2038/1/9	1.03
アメリカ	国債証券	5.125 POLAND 340918	500,000	14,218.24	71,091,244	14,701.92	73,509,625	5.125000	2034/9/18	1.02
アメリカ	国債証券	4.75 BRAZIL 500114	600,000	10,655.03	63,930,194	10,947.00	65,682,025	4.750000	2050/1/14	0.91
アメリカ	国債証券	9.875 TURKEY 280115	400,000	15,770.80	63,083,235	16,194.58	64,778,354	9.875000	2028/1/15	0.90
アメリカ	国債証券	8.75 COLOMBIA 531114	400,000	15,055.51	60,222,068	15,711.11	62,844,478	8.750000	2053/11/14	0.87
アメリカ	国債証券	4.875 POLAND 331004	430,000	14,048.25	60,407,476	14,552.27	62,574,803	4.875000	2033/10/4	0.87
アメリカ	国債証券	8.6 TURKEY 270924	400,000	15,318.35	61,273,418	15,600.38	62,401,527	8.600000	2027/9/24	0.87
アメリカ	国債証券	5.75 URUGUAY 341028	400,000	15,161.31	60,645,264	15,502.64	62,010,579	5.750000	2034/10/28	0.86
アメリカ	国債証券	4.5 DOMINICAN 300130	450,000	13,143.29	59,144,814	13,683.52	61,575,863	4.500000	2030/1/30	0.85
アメリカ	国債証券	4.875 DOMINICAN 320923	450,000	12,825.71	57,715,730	13,587.89	61,145,532	4.875000	2032/9/23	0.85
アメリカ	国債証券	5.5 POLAND 530404	410,000	14,167.74	58,087,741	14,652.23	60,074,158	5.500000	2053/4/4	0.83
アメリカ	国債証券	5.875 DOMINICAN 600130	450,000	12,287.14	55,292,175	13,339.54	60,027,956	5.875000	2060/1/30	0.83
アメリカ	国債証券	6.25 BRAZIL 310318	400,000	14,549.89	58,199,585	14,911.14	59,644,576	6.250000	2031/3/18	0.83
アメリカ	国債証券	6.125 HUNGARY 280522	400,000	14,712.60	58,850,434	14,903.83	59,615,324	6.125000	2028/5/22	0.83
アメリカ	国債証券	7.5 COLOMBIA 340202	400,000	14,581.65	58,326,615	14,852.98	59,411,945	7.500000	2034/2/2	0.82
アメリカ	国債証券	7.125 TURKEY 320717	400,000	14,270.85	57,083,436	14,737.73	58,950,944	7.125000	2032/7/17	0.82
アメリカ	国債証券	6.125 BRAZIL 320122	400,000	14,236.24	56,944,988	14,701.92	58,807,686	6.125000	2032/1/22	0.82
アメリカ	国債証券	5.75 SAUDI INTERN 540116	400,000	14,127.41	56,509,662	14,673.90	58,695,600	5.750000	2054/1/16	0.81
アメリカ	国債証券	6 MEXICO 360507	400,000	14,193.07	56,772,285	14,630.71	58,522,860	6.000000	2036/5/7	0.81
アメリカ	国債証券	5 SAUDI INTERNATI 340116	400,000	14,035.14	56,140,562	14,628.85	58,515,418	5.000000	2034/1/16	0.81
アメリカ	国債証券	6.4 PANAMA 350214	400,000	13,839.10	55,356,403	14,612.73	58,450,955	6.400000	2035/2/14	0.81

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	94.81
合計	94.81

(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》

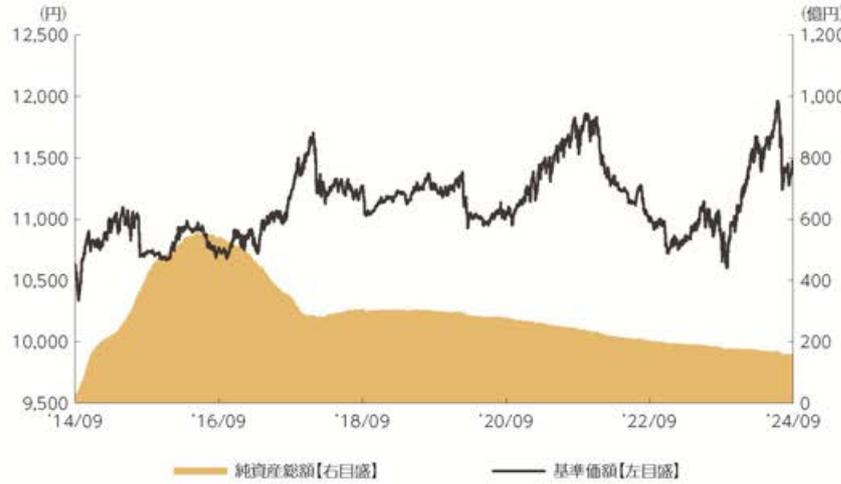


運用実績

2024年9月30日現在

株式抑制型

■基準価額・純資産の推移 2014年9月30日～2024年9月30日



●基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	11,408円
純資産総額	158.4億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024年 3月	0円
2023年 3月	0円
2022年 3月	0円
2021年 3月	0円
2020年 3月	0円
2019年 3月	0円
設定来累計	0円

●分配金は1万口当たり、税引前

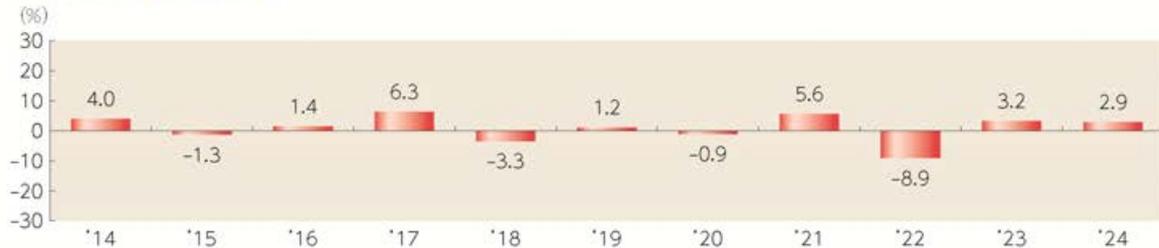
■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	種類	業種/種別	比率
国内株式	5.0%	1 円	81.5%	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.9%
国内債券	47.9%	2 アメリカドル	14.0%	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	0.8%
外国株式	17.7%	3 ユーロ	1.7%	NVIDIA CORP	株式	半導体・半導体製造装置	0.8%
外国債券	24.4%	4 イギリスポンド	0.7%	AMAZON.COM INC	株式	一般消費財・サービス流通・小売り	0.5%
		5 カナダドル	0.6%	META PLATFORMS INC-CLASS A	株式	メディア・娯楽	0.3%
		6 スイスフラン	0.5%	第149回利付国債(5年)	債券	国債	0.7%
		7 オーストラリアドル	0.4%	第372回利付国債(10年)	債券	国債	0.6%
コールローン他		8 デンマーククローネ	0.2%	第147回利付国債(5年)	債券	国債	0.6%
(負債控除後)	5.0%	9 スウェーデンクローネ	0.2%	第361回利付国債(10年)	債券	国債	0.6%
合計	100.0%	10 香港ドル	0.1%	第373回利付国債(10年)	債券	国債	0.5%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	0.6%
債券先物取引 (買建)	0.0%

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

■年間収益率の推移

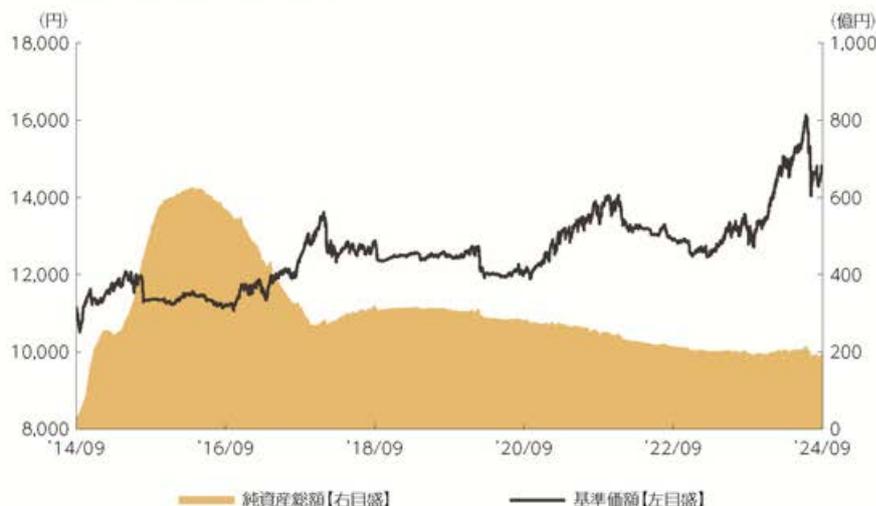


- 収益率は基準価額で計算
- 2024年は年初から9月30日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

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

株式重視型

■基準価額・純資産の推移 2014年9月30日～2024年9月30日



●基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	14,635円
純資産総額	190.6億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024年 3月	0円
2023年 3月	0円
2022年 3月	0円
2021年 3月	0円
2020年 3月	0円
2019年 3月	0円
設定来累計	0円

●分配金は1万口当たり、税引前

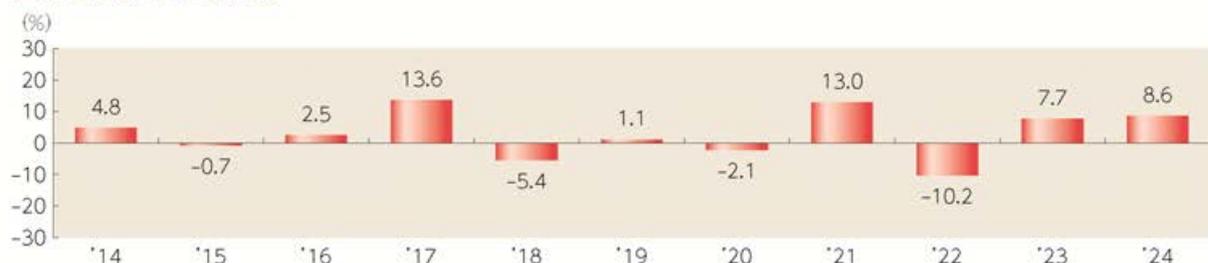
■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	種類	業種/種別	比率
国内株式	16.9%	1 円	66.4%	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.6%
国内債券	21.0%	2 アメリカドル	25.6%	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	1.5%
外国株式	32.5%	3 ユーロ	3.1%	NVIDIA CORP	株式	半導体・半導体製造装置	1.5%
外国債券	24.2%	4 イギリスポンド	1.3%	AMAZON.COM INC	株式	一般消費財・サービス流通・小売り	0.9%
		5 カナダドル	1.1%	META PLATFORMS INC-CLASS A	株式	メディア・娯楽	0.6%
		6 スイスフラン	0.9%	第149回利付国債(5年)	債券	国債	0.3%
		7 オーストラリアドル	0.7%	第372回利付国債(10年)	債券	国債	0.3%
コールローン他 (負債控除後)	5.4%	8 デンマーククローネ	0.3%	第147回利付国債(5年)	債券	国債	0.2%
合計	100.0%	9 スウェーデンクローネ	0.3%	第361回利付国債(10年)	債券	国債	0.2%
		10 香港ドル	0.2%	第373回利付国債(10年)	債券	国債	0.2%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	1.1%
債券先物取引 (買建)	0.0%

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

■年間収益率の推移

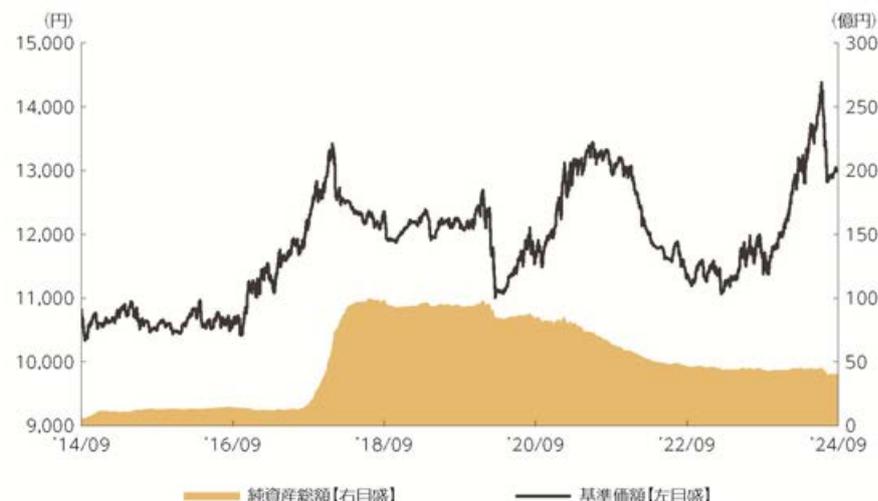


- 収益率は基準価額で計算
- 2024年は年初から9月30日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

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

新興国投資型

■基準価額・純資産の推移 2014年9月30日～2024年9月30日



●基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	12,988円
純資産総額	40.2億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024年 3月	0円
2023年 3月	0円
2022年 3月	0円
2021年 3月	0円
2020年 3月	0円
2019年 3月	0円
設定来累計	0円

●分配金は1万口当たり、税引前

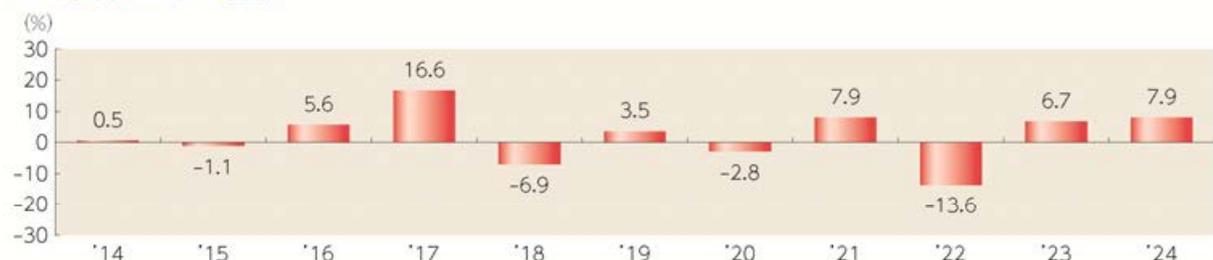
■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	種類	業種/種別	比率
国内債券	32.4%	1 円	99.5%	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.0%
外国株式	0.0%	2 アメリカドル	0.4%	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	0.0%
外国債券	62.9%	3 ユーロ	0.1%	NVIDIA CORP	株式	半導体・半導体製造装置	0.0%
		4 中国元	0.0%	AMAZON.COM INC	株式	一般消費財・サービス流通・小売り	0.0%
		5 イギリスポンド	0.0%	META PLATFORMS INC-CLASS A	株式	メディア・娯楽	0.0%
		6 カナダドル	0.0%	FRN ARGENTINA 300709	債券	国債	0.6%
		7 メキシコペソ	0.0%	FRN ARGENTINA 350709	債券	国債	0.6%
コールローン他		8 香港ドル	0.0%	4.4 QATAR 500416	債券	国債	0.5%
(負債控除後)	4.7%	9 インドルピー	0.0%	第149回利付国債(5年)	債券	国債	0.5%
合計	100.0%	10 スイスフラン	0.0%	FRN ECUADOR 350731	債券	国債	0.5%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	0.0%
債券先物取引 (買建)	0.0%

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

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2024年は年初から9月30日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

①申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

②申込単位

販売会社が定める単位

③申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

④申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑤申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ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

申込価額（発行価格）×2.2%（税抜2%）を上限として販売会社が定める手数料率

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、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

⑦申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額および申込手数料（税込）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は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で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

「三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）／（株式重視型）」

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。

「三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）」

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

※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せん。

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いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ 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

「三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）／（株式重視型）」

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

「三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）」

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

その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

①基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

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

（資産の評価方法）

・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

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

・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

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

・公社債等

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

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

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

- ・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）
原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。
- ・外貨建資産
原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。
- ・外国為替予約取引
原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。
- ・市場デリバティブ取引
原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

②基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

③基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ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】

2028年3月24日まで（2013年10月25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るときは、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3月26日から翌年3月25日まで

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

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

①ファンドの償還条件等

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

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

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

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

②信託約款の変更等

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

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

③ファンドの償還等に関する開示方法

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

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

④反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

⑤関係法人との契約の更改

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

⑥運用報告書

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

⑦委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

⑧受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

⑨信託事務の再信託

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

⑩公告

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

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

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（2023 年 3 月 28 日から 2024 年 3 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。

独立監査人の監査報告書

2024年5月29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 大畑 茂
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）の2023年3月28日から2024年3月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）の2024年3月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱UFJアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の

意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三菱UFJアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

1 【財務諸表】

【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 [2023年3月27日現在]	第11期 [2024年3月25日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,664,777,430	453,658,673
親投資信託受益証券	17,273,657,493	17,198,333,625
未収入金	422,000,000	-
未収利息	-	875
流動資産合計	19,360,434,923	17,651,993,173
資産合計	19,360,434,923	17,651,993,173
負債の部		
流動負債		
未払解約金	23,203,307	58,202,233
未払受託者報酬	5,428,812	4,763,102
未払委託者報酬	135,720,202	119,077,547
未払利息	555	-
その他未払費用	390,819	342,887
流動負債合計	164,743,695	182,385,769
負債合計	164,743,695	182,385,769
純資産の部		
元本等		
元本	17,743,252,194	15,002,180,986
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,452,439,034	2,467,426,418
（分配準備積立金）	646,516,838	982,389,090
元本等合計	19,195,691,228	17,469,607,404
純資産合計	19,195,691,228	17,469,607,404
負債純資産合計	19,360,434,923	17,651,993,173

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期 自 2022年3月26日 至 2023年3月27日	第11期 自 2023年3月28日 至 2024年3月25日
営業収益		
受取利息	19,230	7,691
有価証券売買等損益	△637,762,998	1,566,676,132
営業収益合計	△637,743,768	1,566,683,823
営業費用		
支払利息	2,189,086	180,515

受託者報酬	11,273,533	9,962,263
委託者報酬	281,838,188	249,056,500
その他費用	811,574	717,161
営業費用合計	296,112,381	259,916,439
営業利益又は営業損失(△)	△933,856,149	1,306,767,384
経常利益又は経常損失(△)	△933,856,149	1,306,767,384
当期純利益又は当期純損失(△)	△933,856,149	1,306,767,384
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(△)	△42,038,652	68,053,507
期首剰余金又は期首欠損金(△)	2,546,788,477	1,452,439,034
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,505,366	3,025,475
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,505,366	3,025,475
剰余金減少額又は欠損金増加額	210,037,312	226,751,968
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	210,037,312	226,751,968
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,452,439,034	2,467,426,418

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年3月25日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は2023年3月28日から2024年3月25日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第10期 [2023年3月27日現在]	第11期 [2024年3月25日現在]
1. 期首元本額	19,265,644,331円	17,743,252,194円
期中追加設定元本額	66,798,497円	28,533,597円
期中一部解約元本額	1,589,190,634円	2,769,604,805円
2. 受益権の総数	17,743,252,194口	15,002,180,986口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自2022年3月26日 至2023年3月27日			第11期 自2023年3月28日 至2024年3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	—円	費用控除後の配当等収益額	A	217,134,013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	219,566,448円
収益調整金額	C	805,922,196円	収益調整金額	C	1,485,037,328円
分配準備積立金額	D	646,516,838円	分配準備積立金額	D	545,688,629円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,452,439,034円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,467,426,418円

当ファンドの期末残存口数	F	17,743,252,194 口
1 万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	818 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

当ファンドの期末残存口数	F	15,002,180,986 口
1 万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	1,644 円
1 万口当たり分配金額	H	—円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	—円

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第 10 期 自 2022 年 3 月 26 日 至 2023 年 3 月 27 日	第 11 期 自 2023 年 3 月 28 日 至 2024 年 3 月 25 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和 26 年法律第 198 号) 第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第 10 期 [2023 年 3 月 27 日現在]	第 11 期 [2024 年 3 月 25 日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記) に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第10期 [2023年3月27日現在]	第11期 [2024年3月25日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	△130,369,462	830,762,556
合計	△130,369,462	830,762,556

(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10期 [2023年3月27日現在]	第11期 [2024年3月25日現在]
1口当たり純資産額	1.0819円	1.1645円
(1万口当たり純資産額)	(10,819円)	(11,645円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	3,891,227,596	4,344,555,610	
	国内債券インデックスマザーファンド	6,925,905,524	6,414,773,696	
	TOPIXマザーファンド	946,644,595	3,192,937,554	
	外国株式インデックスマザーファンド	475,391,284	3,246,066,765	
合計		12,239,168,999	17,198,333,625	

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。

独立監査人の監査報告書

2024年5月29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 大畑 茂
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）の2023年3月28日から2024年3月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）の2024年3月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱UFJアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の

意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三菱UFJアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 [2023年3月27日現在]	第11期 [2024年3月25日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	428,473,405	484,289,523
親投資信託受益証券	19,281,578,605	20,208,866,603
未収入金	446,000,000	-
未収利息	-	934
流動資産合計	20,156,052,010	20,693,157,060
資産合計	20,156,052,010	20,693,157,060
負債の部		
流動負債		
未払解約金	21,350,277	16,096,023
未払受託者報酬	5,706,450	5,314,224
未払委託者報酬	142,661,139	132,855,539
未払利息	142	-
その他未払費用	410,807	382,568
流動負債合計	170,128,815	154,648,354
負債合計	170,128,815	154,648,354
純資産の部		
元本等		
元本	16,004,523,401	13,700,578,456
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	3,981,399,794	6,837,930,250
(分配準備積立金)	1,809,391,171	3,963,559,155
元本等合計	19,985,923,195	20,538,508,706
純資産合計	19,985,923,195	20,538,508,706
負債純資産合計	20,156,052,010	20,693,157,060

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期 自 2022年3月26日 至 2023年3月27日	第11期 自 2023年3月28日 至 2024年3月25日
営業収益		
受取利息	13,271	7,789
有価証券売買等損益	△889,409,081	3,922,182,553
営業収益合計	△889,395,810	3,922,190,342
営業費用		
支払利息	1,982,024	185,964
受託者報酬	11,814,017	10,869,263
委託者報酬	295,350,205	271,731,442

その他費用	850,490	782,470
営業費用合計	309,996,736	283,569,139
営業利益又は営業損失(△)	△1,199,392,546	3,638,621,203
経常利益又は経常損失(△)	△1,199,392,546	3,638,621,203
当期純利益又は当期純損失(△)	△1,199,392,546	3,638,621,203
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(△)	△34,078,052	221,234,865
期首剰余金又は期首欠損金(△)	5,526,216,415	3,981,399,794
剰余金増加額又は欠損金減少額	76,556,467	47,762,087
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	76,556,467	47,762,087
剰余金減少額又は欠損金増加額	456,058,594	608,617,969
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	456,058,594	608,617,969
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	3,981,399,794	6,837,930,250

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年3月25日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は2023年3月28日から2024年3月25日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第10期 [2023年3月27日現在]	第11期 [2024年3月25日現在]
1. 期首元本額	17,165,644,448円	16,004,523,401円
期中追加設定元本額	255,946,355円	139,732,101円
期中一部解約元本額	1,417,067,402円	2,443,677,046円
2. 受益権の総数	16,004,523,401口	13,700,578,456口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自2022年3月26日 至2023年3月27日			第11期 自2023年3月28日 至2024年3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	—円	費用控除後の配当等収益額	A	309,125,403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	2,120,081,852円
収益調整金額	C	2,172,008,623円	収益調整金額	C	2,874,371,095円
分配準備積立金額	D	1,809,391,171円	分配準備積立金額	D	1,534,351,900円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,981,399,794円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,837,930,250円
当ファンドの期末残存口数	F	16,004,523,401口	当ファンドの期末残存口数	F	13,700,578,456口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,487円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	4,990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10期 自 2022年 3月 26日 至 2023年 3月 27日	第11期 自 2023年 3月 28日 至 2024年 3月 25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第10期 [2023年 3月 27日現在]	第11期 [2024年 3月 25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第10期 [2023年3月27日現在]	第11期 [2024年3月25日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	△52,289,875	2,284,277,982
合計	△52,289,875	2,284,277,982

(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10期 [2023年3月27日現在]	第11期 [2024年3月25日現在]
1口当たり純資産額	1,248円	1,499円
(1万口当たり純資産額)	(12,488円)	(14,991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	4,563,118,388	5,094,721,680	
	国内債券インデックスマザーファンド	1,516,032,012	1,404,148,849	
	TOPIXマザーファンド	2,014,569,502	6,794,941,473	
	外国株式インデックスマザーファンド	1,012,719,985	6,915,054,601	
合計		9,106,439,887	20,208,866,603	

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。

独立監査人の監査報告書

2024年5月29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 大畑 茂
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）の2023年3月28日から2024年3月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）の2024年3月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱UFJアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の

意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三菱UFJアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

【三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 [2023年3月27日現在]	第11期 [2024年3月25日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	89,469,385	122,138,538
親投資信託受益証券	4,089,503,973	4,407,477,129
未収入金	205,000,000	24,000,000
未収利息	-	235
流動資産合計	4,383,973,358	4,553,615,902
資産合計	4,383,973,358	4,553,615,902
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,032,768	8,709,946
未払受託者報酬	1,258,298	1,177,331
未払委託者報酬	31,457,523	29,433,176
未払利息	29	-
その他未払費用	90,537	84,706
流動負債合計	33,839,155	39,405,159
負債合計	33,839,155	39,405,159
純資産の部		
元本等		
元本	3,908,166,997	3,441,336,362
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	441,967,206	1,072,874,381
（分配準備積立金）	197,797,272	259,318,272
元本等合計	4,350,134,203	4,514,210,743
純資産合計	4,350,134,203	4,514,210,743
負債純資産合計	4,383,973,358	4,553,615,902

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期 自 2022年3月26日 至 2023年3月27日	第11期 自 2023年3月28日 至 2024年3月25日
営業収益		
受取利息	1,682	1,655
有価証券売買等損益	△301,096,937	783,368,454
営業収益合計	△301,095,255	783,370,109
営業費用		
支払利息	251,133	37,850
受託者報酬	2,616,874	2,398,926
委託者報酬	65,421,836	59,973,149

その他費用	188,292	172,600
営業費用合計	68,478,135	62,582,525
営業利益又は営業損失(△)	△369,573,390	720,787,584
経常利益又は経常損失(△)	△369,573,390	720,787,584
当期純利益又は当期純損失(△)	△369,573,390	720,787,584
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(△)	△18,328,226	39,126,743
期首剰余金又は期首欠損金(△)	878,724,641	441,967,206
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,925,553	5,637,382
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,925,553	5,637,382
剰余金減少額又は欠損金増加額	90,437,824	56,391,048
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	90,437,824	56,391,048
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	441,967,206	1,072,874,381

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年3月25日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は2023年3月28日から2024年3月25日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第10期 [2023年3月27日現在]	第11期 [2024年3月25日現在]
1. 期首元本額	4,322,205,525円	3,908,166,997円
期中追加設定元本額	31,065,353円	30,738,192円
期中一部解約元本額	445,103,881円	497,568,827円
2. 受益権の総数	3,908,166,997口	3,441,336,362口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自2022年3月26日 至2023年3月27日			第11期 自2023年3月28日 至2024年3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	1,993,257円	費用控除後の配当等収益額	A	86,593,096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	—円
収益調整金額	C	328,305,956円	収益調整金額	C	813,556,109円
分配準備積立金額	D	195,804,015円	分配準備積立金額	D	172,725,176円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	526,103,228円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,072,874,381円
当ファンドの期末残存口数	F	3,908,166,997口	当ファンドの期末残存口数	F	3,441,336,362口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,346円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,117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10期 自 2022年 3月 26日 至 2023年 3月 27日	第11期 自 2023年 3月 28日 至 2024年 3月 25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第10期 [2023年 3月 27日現在]	第11期 [2024年 3月 25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第 10 期 [2023 年 3 月 27 日現在]	第 11 期 [2024 年 3 月 25 日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	1, 553, 524	363, 888, 863
合計	1, 553, 524	363, 888, 863

(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 10 期 [2023 年 3 月 27 日現在]	第 11 期 [2024 年 3 月 25 日現在]
1口当たり純資産額	1. 1131 円	1. 3118 円
(1万口当たり純資産額)	(11, 131 円)	(13, 118 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	新興国株式インデックスマザーファンド	304, 476, 938	1, 131, 893, 017	
	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	274, 188, 920	306, 131, 929	
	ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド	337, 984, 552	309, 458, 655	
	国内債券インデックスマザーファンド	308, 506, 970	285, 739, 155	
	TOPIXマザーファンド	348, 947, 964	1, 176, 966, 587	
	外国株式インデックスマザーファンド	175, 344, 569	1, 197, 287, 786	
合計		1, 749, 449, 913	4, 407, 477, 129	

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

TOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年3月25日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	25,523,880,695
株式	1,400,111,695,310
派生商品評価勘定	203,351,200
未収入金	3,395,600
未収配当金	1,828,554,601
未収利息	98,246
その他未収収益	12,600,294
差入委託証拠金	523,467,860
流動資産合計	1,428,207,043,806
資産合計	1,428,207,043,806
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,282,600
前受金	341,400,000
未払金	4,301,999,593
未払解約金	3,143,876,446
受入担保金	11,207,846,698
流動負債合計	19,003,405,337
負債合計	19,003,405,337
純資産の部	
元本等	
元本	417,799,026,755
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	991,404,611,714
元本等合計	1,409,203,638,469
純資産合計	1,409,203,638,469
負債純資産合計	1,428,207,043,806

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年 3月 25日現在]
1. 期首	2023年 3月 28日
期首元本額	368,050,508,229円
期中追加設定元本額	189,492,510,991円
期中一部解約元本額	139,743,992,465円
元本の内訳※	
三菱UFJ トピックスインデックスオープン	6,408,022,027円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	774,900,721円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	3,604,456,152円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	3,577,144,220円
三菱UFJ トピックスオープン(確定拠出年金)	3,638,706,598円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	5,783,116,677円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	33,431,662,331円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	41,228,603,366円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	85,902,173円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	231,358,251円
ファンド・マネジャー(国内株式)	631,923,047円
eMAXIS TOPIXインデックス	6,970,895,688円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,904,309,584円
eMAXIS バランス(波乗り型)	213,586,608円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	2,707,213,649円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	814,541,328円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	1,049,994,537円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	1,036,749,488円
eMAXIS Slim 国内株式(TOPIX)	45,769,439,392円
国内株式セレクション(ラップ向け)	4,508,676,412円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	9,842,629,411円
つみたて日本株式(TOPIX)	9,374,088,149円
つみたて8資産均等バランス	4,899,120,960円
つみたて4資産均等バランス	1,788,869,687円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,927,638円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	5,168,933円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	8,463,611円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	680,833,857円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	879,784,114円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	641,911,321円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	516,485,838円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	1,692,892,104円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	4,036,615,450円
eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)	1,306,655,998円
三菱UFJ DC年金インデックス(国内株式)	4,307,593,384円

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	588,271,646円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	153,620,932円
国内株式インデックス・オープン (ラップ向け)	19,774,641,561円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	274,697,620円
ラップ向けインデックスf 国内株式	4,162,521,320円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	140,973,962円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	2,709,130,896円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	1,649,565,627円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	49,338,673円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	7,501,458,030円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	180,968,375円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	22,276,331円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	30,030,006円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	1,586,659円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	946,644,595円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	2,014,569,502円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	348,947,964円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	1,241,261,360円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	278,943,505円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	14,794,195円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	99,154,817円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	721,206,408円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	139,050,237円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	178,808,520円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	741,796,236円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	605,548,444円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	1,086,012,345円
三菱UFJ トピックスオープン	959,622,139円
三菱UFJ DCトピックスオープン	7,975,520,853円
三菱UFJ トピックスオープンVA (適格機関投資家限定)	47,451,882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)	4,073,317,793円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	7,400,376円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,509,064,128円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	61,040,996円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,194,730,419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)	42,107,182,840円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	190,411,797円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	207,949円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	120,282円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	189,058,842円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	323,786,179円
MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)	3,710,359,900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)	2,818,566,421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)	907,115,263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)	472,323,007円
世界8資産バランスファンドV L (適格機関投資家限定)	85,069,311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)	2,480,373,508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)	154,775,849円
MUKAM 日本株式インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	3,427,279,710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)	300,146,196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)	15,997,652,781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)	26,771,348円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	287,191円
日米コアバランス (F O F s 用) (適格機関投資家限定)	103,773,309円
日本株式インデックスファンドS	3,053,696,643円
グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定)	746,960円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	35,980,732円
MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	92,748,992円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	35,434,968円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	35,501,352円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	35,160,631円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	35,822,253円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	35,950,680円
MUKAM 日米コアバランス 2021-07 (適格機関投資家限定)	276,751,535円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)	34,885,307円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	34,844,004円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	35,768,349円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	35,818,860円
MUKAM 日米コアバランス (除く米国株) 2022-03 (適格機関投資家限定)	593,183,237円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	40,180,532円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	39,815,667円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	40,598,807円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	40,095,797円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	34,367,095円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	39,980,785円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)	34,332,624円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定)	35,329,633円

格機関投資家限定)	
三菱UFJ TOPIX・ファンド	5,395,696,129円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	2,557,949円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	6,185,847円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	1,422,380円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	5,548,310円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	458,835,259円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	70,966,779円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	2,830,121円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	24,392,144円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	1,354,897円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	14,166,250円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,592,337,026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)	305,182,950円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(安定成長型)	1,323,355,728円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(成長型)	1,289,803,467円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(積極型)	1,231,533,621円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	60,261,389,716円
合計	417,799,026,755円
2. 貸付有価証券 貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っており す。 株式	10,592,035,570円
3. 受益権の総数	417,799,026,755円

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023 年 3 月 28 日 至 2024 年 3 月 25 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、新株予約権証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	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。 ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年3月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差	時価で計上しているためその差額はありませぬ。

額	
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024年 3月 25日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		364,591,681,352
合計		364,591,681,352

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[2024年 3月 25日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	9,379,960,000	—	9,575,220,000	195,260,000
合計		9,379,960,000	—	9,575,220,000	195,260,000

(注)時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[2024年 3月 25日現在]
1口当たり純資産額	3.3729円
(1万口当たり純資産額)	(33,729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	20,600	3,860.00	79,516,000	
1332	ニッスイ	499,000	985.30	491,664,700	
1333	マルハニチロ	74,000	3,051.00	225,774,000	
1375	雪国まいたけ	42,500	1,135.00	48,237,500	
1376	カネコ種苗	14,100	1,444.00	20,360,400	
1377	サカタのタネ	56,800	3,700.00	210,160,000	
1379	ホクト	40,000	1,904.00	76,160,000	
1384	ホクリヨウ	3,100	1,122.00	3,478,200	貸付有価証券 200株
1514	住石ホールディングス	56,400	1,668.00	94,075,200	貸付有価証券 20,900株
1515	日鉄鉱業	20,000	4,975.00	99,500,000	
1518	三井松島ホールディングス	29,600	2,931.00	86,757,600	貸付有価証券 4,100株
1605	I N P E X	1,675,700	2,275.00	3,812,217,500	貸付有価証券 70,700株
1662	石油資源開発	57,800	6,910.00	399,398,000	
1663	K&Oエナジーグループ	22,600	2,788.00	63,008,800	
1414	ショーボンドホールディングス	68,000	6,431.00	437,308,000	
1417	ミライト・ワン	165,000	1,905.00	314,325,000	
1419	タマホーム	31,400	4,310.00	135,334,000	
1420	サンヨーホームズ	2,600	796.00	2,069,600	
1429	日本アクア	8,800	981.00	8,632,800	
1430	ファーストコーポレーション	5,400	822.00	4,438,800	
1433	ベステラ	4,800	1,007.00	4,833,600	貸付有価証券 600株
1446	キャンディル	3,500	592.00	2,072,000	貸付有価証券 400株
1712	ダイセキ環境ソリューション	4,300	1,024.00	4,403,200	
1716	第一カッター興業	14,400	1,588.00	22,867,200	
1719	安藤・間	289,100	1,242.00	359,062,200	
1720	東急建設	156,300	848.00	132,542,400	
1721	コムシスホールディングス	159,300	3,631.00	578,418,300	
1726	ビーアールホールディングス	73,100	381.00	27,851,100	
1762	高松コンストラクショングループ	37,100	2,891.00	107,256,100	

1766	東建コーポレーション	12,600	10,060.00	126,756,000	
1768	ソネック	2,200	944.00	2,076,800	
1780	ヤマウラ	25,300	1,509.00	38,177,700	
1786	オリエンタル白石	184,700	396.00	73,141,200	
1801	大成建設	326,600	5,742.00	1,875,337,200	
1802	大林組	1,248,300	1,892.50	2,362,407,750	
1803	清水建設	989,700	1,021.00	1,010,483,700	
1805	飛島建設	36,000	1,572.00	56,592,000	
1808	長谷工コーポレーション	320,200	1,907.50	610,781,500	貸付有価証券 1,300株
1810	松井建設	32,600	921.00	30,024,600	
1811	銭高組	1,900	4,465.00	8,483,500	
1812	鹿島建設	773,900	3,139.00	2,429,272,100	貸付有価証券 15,400株
1813	不動テトラ	24,100	2,062.00	49,694,200	
1814	大末建設	5,700	1,627.00	9,273,900	
1815	鉄建建設	25,000	2,786.00	69,650,000	
1820	西松建設	66,600	4,556.00	303,429,600	
1821	三井住友建設	259,800	437.00	113,532,600	
1822	大豊建設	12,000	3,630.00	43,560,000	貸付有価証券 500株
1826	佐田建設	9,400	773.00	7,266,200	
1827	ナカノフドー建設	10,500	602.00	6,321,000	
1833	奥村組	56,600	5,240.00	296,584,000	
1835	東鉄工業	43,200	3,050.00	131,760,000	
1847	イチケン	3,600	2,500.00	9,000,000	
1848	富士ピー・エス	6,700	460.00	3,082,000	
1852	浅沼組	25,800	4,360.00	112,488,000	
1860	戸田建設	472,300	1,039.50	490,955,850	
1861	熊谷組	57,600	4,270.00	245,952,000	貸付有価証券 200株
1866	北野建設	2,800	3,725.00	10,430,000	
1867	植木組	4,200	1,725.00	7,245,000	
1870	矢作建設工業	47,500	1,579.00	75,002,500	
1871	ピーエス三菱	44,200	1,057.00	46,719,400	
1873	日本ハウスホールディングス	74,500	323.00	24,063,500	貸付有価証券 13,700株
1879	新日本建設	49,000	1,629.00	79,821,000	

1882	東亜道路工業	13,900	6,510.00	90,489,000	
1884	日本道路	40,900	1,891.00	77,341,900	
1885	東亜建設工業	26,900	5,130.00	137,997,000	
1887	日本国土開発	99,300	527.00	52,331,100	貸付有価証券 3,800株
1888	若築建設	12,100	3,665.00	44,346,500	
1890	東洋建設	87,900	1,435.00	126,136,500	貸付有価証券 600株
1893	五洋建設	494,800	778.20	385,053,360	
1898	世紀東急工業	44,800	1,951.00	87,404,800	
1899	福田組	13,200	5,690.00	75,108,000	貸付有価証券 600株
1911	住友林業	301,700	4,529.00	1,366,399,300	
1914	日本基礎技術	9,000	514.00	4,626,000	貸付有価証券 200株
1921	巴コーポレーション	18,700	662.00	12,379,400	
1925	大和ハウス工業	965,200	4,524.00	4,366,564,800	
1926	ライト工業	71,800	1,959.00	140,656,200	
1928	積水ハウス	1,058,600	3,414.00	3,614,060,400	貸付有価証券 40,600株
1929	日特建設	33,300	1,199.00	39,926,700	
1930	北陸電気工事	23,900	1,213.00	28,990,700	
1934	ユアテック	76,900	1,471.00	113,119,900	
1938	日本リーテック	27,300	1,319.00	36,008,700	
1939	四電工	14,600	4,035.00	58,911,000	
1941	中電工	54,200	3,065.00	166,123,000	
1942	関電工	218,600	1,728.00	377,740,800	
1944	きんでん	245,700	2,742.00	673,709,400	
1945	東京エネシス	34,700	1,211.00	42,021,700	
1946	トーエネック	11,600	5,820.00	67,512,000	
1949	住友電設	33,200	3,360.00	111,552,000	
1950	日本電設工業	65,500	2,089.00	136,829,500	
1951	エクシオグループ	170,600	3,308.00	564,344,800	
1952	新日本空調	22,600	3,535.00	79,891,000	貸付有価証券 800株
1959	九電工	75,400	6,428.00	484,671,200	
1961	三機工業	75,400	2,141.00	161,431,400	
1963	日揮ホールディングス	345,300	1,511.00	521,748,300	
1964	中外炉工業	11,400	3,105.00	35,397,000	

1967	ヤマト	12,400	1,069.00	13,255,600	
1968	太平電業	21,700	4,520.00	98,084,000	
1969	高砂熱学工業	93,500	4,780.00	446,930,000	
1972	三晃金属工業	1,900	5,220.00	9,918,000	
1975	朝日工業社	16,300	3,420.00	55,746,000	
1976	明星工業	67,500	1,354.00	91,395,000	
1979	大氣社	40,200	4,750.00	190,950,000	
1980	ダイダン	45,900	2,455.00	112,684,500	
1982	日比谷総合設備	25,300	2,992.00	75,697,600	
3267	フィル・カンパニー	5,400	884.00	4,773,600	貸付有価証券 300株
5074	テスホールディングス	75,200	461.00	34,667,200	
5076	インフロニア・ホールディングス	402,400	1,486.50	598,167,600	
6330	東洋エンジニアリング	51,300	959.00	49,196,700	貸付有価証券 1,800株
6379	レイズネクスト	50,500	2,364.00	119,382,000	
2001	ニッポン	104,900	2,408.00	252,599,200	
2002	日清製粉グループ本社	324,000	2,172.50	703,890,000	貸付有価証券 12,500株
2003	日東富士製粉	6,200	5,370.00	33,294,000	
2004	昭和産業	33,900	3,565.00	120,853,500	
2009	鳥越製粉	12,400	720.00	8,928,000	貸付有価証券 2,100株
2053	中部飼料	48,500	1,221.00	59,218,500	貸付有価証券 1,900株
2060	フィード・ワン	51,200	1,010.00	51,712,000	
2107	東洋精糖	2,800	2,543.00	7,120,400	
2108	日本甜菜製糖	20,400	2,167.00	44,206,800	
2109	DM三井製糖ホールディングス	34,800	3,280.00	114,144,000	
2112	塩水港精糖	19,600	311.00	6,095,600	
2117	ウェルネオシュガー	17,500	2,401.00	42,017,500	
2201	森永製菓	150,000	2,652.50	397,875,000	
2204	中村屋	8,700	3,220.00	28,014,000	
2206	江崎グリコ	100,200	4,309.00	431,761,800	
2207	名糖産業	13,800	1,820.00	25,116,000	
2209	井村屋グループ	20,900	2,599.00	54,319,100	
2211	不二家	24,000	2,487.00	59,688,000	
2212	山崎製パン	234,500	3,926.00	920,647,000	

2215	第一屋製パン	2,700	678.00	1,830,600	
2217	モロゾフ	11,300	4,305.00	48,646,500	
2220	亀田製菓	20,000	4,295.00	85,900,000	
2222	寿スピリッツ	165,700	2,013.50	333,636,950	
2229	カルビー	160,400	3,467.00	556,106,800	
2264	森永乳業	122,400	3,183.00	389,599,200	
2266	六甲バター	25,700	1,381.00	35,491,700	貸付有価証券 900株
2267	ヤクルト本社	500,800	3,111.00	1,557,988,800	
2269	明治ホールディングス	429,600	3,428.00	1,472,668,800	
2270	雪印メグミルク	84,700	2,718.00	230,214,600	
2281	プリマハム	47,100	2,345.00	110,449,500	
2282	日本ハム	150,700	5,226.00	787,558,200	
2286	林兼産業	5,000	596.00	2,980,000	
2288	丸大食品	35,300	1,648.00	58,174,400	
2292	S F o o d s	38,600	3,360.00	129,696,000	
2294	柿安本店	13,700	2,986.00	40,908,200	貸付有価証券 600株
2296	伊藤ハム米久ホールディングス	53,500	4,245.00	227,107,500	
2501	サッポロホールディングス	115,300	5,959.00	687,072,700	貸付有価証券 4,500株
2502	アサヒグループホールディングス	809,700	5,426.00	4,393,432,200	貸付有価証券 31,100株
2503	キリンホールディングス	1,459,700	2,096.00	3,059,531,200	貸付有価証券 56,000株
2531	宝ホールディングス	239,200	1,114.00	266,468,800	
2533	オエノンホールディングス	104,700	357.00	37,377,900	
2540	養命酒製造	11,500	1,900.00	21,850,000	
2579	コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	274,500	2,280.50	625,997,250	
2585	ライフドリンク カンパニー	5,200	4,600.00	23,920,000	貸付有価証券 200株
2587	サントリー食品インターナショナル	246,700	5,207.00	1,284,566,900	
2590	ダイドーグループホールディングス	39,700	2,745.00	108,976,500	貸付有価証券 2,400株
2593	伊藤園	118,700	3,619.00	429,575,300	貸付有価証券 13,500株
2594	キーコーヒー	39,300	2,048.00	80,486,400	貸付有価証券 1,600株
2597	ユニカフェ	5,000	916.00	4,580,000	
2599	ジャパンフーズ	2,300	1,581.00	3,636,300	

2602	日清オイリオグループ	49,400	5,250.00	259,350,000	
2607	不二製油グループ本社	81,600	2,621.50	213,914,400	
2612	かどや製油	1,500	4,030.00	6,045,000	
2613	J-オイルミルズ	40,100	2,012.00	80,681,200	
2801	キッコーマン	232,200	9,918.00	2,302,959,600	
2802	味の素	832,700	5,484.00	4,566,526,800	
2804	ブルドックソース	18,600	2,159.00	40,157,400	貸付有価証券 900株
2809	キューピー	188,300	2,820.00	531,006,000	貸付有価証券 7,300株
2810	ハウス食品グループ本社	120,700	3,099.00	374,049,300	
2811	カゴメ	150,700	3,701.00	557,740,700	
2812	焼津水産化学工業	6,600	1,424.00	9,398,400	
2815	アリアケジャパン	34,900	5,290.00	184,621,000	貸付有価証券 600株
2818	ピエトロ	2,000	1,860.00	3,720,000	
2819	エバラ食品工業	8,400	3,000.00	25,200,000	
2820	やまみ	1,300	3,910.00	5,083,000	
2871	ニチレイ	160,600	4,110.00	660,066,000	貸付有価証券 6,200株
2875	東洋水産	177,100	9,722.00	1,721,766,200	貸付有価証券 400株
2882	イトアンドホールディングス	16,600	2,022.00	33,565,200	貸付有価証券 500株
2883	大冷	2,000	1,946.00	3,892,000	
2884	ヨシムラ・フード・ホールディングス	15,900	1,321.00	21,003,900	貸付有価証券 2,400株
2897	日清食品ホールディングス	369,600	4,285.00	1,583,736,000	
2899	永谷園ホールディングス	17,200	2,272.00	39,078,400	
2904	一正蒲鉾	6,400	743.00	4,755,200	
2908	フジッコ	36,000	1,956.00	70,416,000	
2910	ロック・フィールド	42,800	1,655.00	70,834,000	
2914	日本たばこ産業	2,129,300	3,971.00	8,455,450,300	貸付有価証券 81,700株
2915	ケンコーマヨネーズ	24,100	2,031.00	48,947,100	
2918	わらべや日洋ホールディングス	23,500	2,707.00	63,614,500	貸付有価証券 1,300株
2922	なとり	22,000	2,160.00	47,520,000	
2924	イフジ産業	2,800	1,476.00	4,132,800	貸付有価証券 200株
2929	ファーマフーズ	50,300	915.00	46,024,500	貸付有価証券 4,500株

2931	ユーグレナ	218,100	618.00	134,785,800	貸付有価証券 19,000株
2933	紀文食品	30,400	1,247.00	37,908,800	貸付有価証券 1,000株
2935	ピククルスホールディングス	20,500	1,184.00	24,272,000	
4404	ミヨシ油脂	5,500	1,271.00	6,990,500	
4526	理研ビタミン	30,300	2,578.00	78,113,400	
3001	片倉工業	32,800	1,864.00	61,139,200	
3002	グンゼ	25,300	5,560.00	140,668,000	
3101	東洋紡	154,100	1,144.00	176,290,400	
3103	ユニチカ	115,300	168.00	19,370,400	
3104	富士紡ホールディングス	15,600	4,420.00	68,952,000	貸付有価証券 300株
3106	倉敷紡績	25,300	3,605.00	91,206,500	
3109	シキボウ	18,900	1,221.00	23,076,900	貸付有価証券 600株
3201	日本毛織	91,400	1,412.00	129,056,800	
3202	ダイトウボウ	24,600	97.00	2,386,200	
3204	トーア紡コーポレーション	6,000	448.00	2,688,000	貸付有価証券 1,600株
3205	ダイドーリミテッド	21,800	728.00	15,870,400	貸付有価証券 5,700株
3302	帝国繊維	40,200	2,256.00	90,691,200	貸付有価証券 4,700株
3401	帝人	342,500	1,388.50	475,561,250	
3402	東レ	2,388,400	735.60	1,756,907,040	
3501	住江織物	2,800	2,530.00	7,084,000	
3512	日本フェルト	8,700	449.00	3,906,300	貸付有価証券 500株
3513	イチカワ	1,900	1,940.00	3,686,000	
3524	日東製網	1,600	1,684.00	2,694,400	
3529	アツギ	10,300	614.00	6,324,200	貸付有価証券 1,600株
3551	ダイニック	4,500	787.00	3,541,500	
3569	セーレン	68,800	2,633.00	181,150,400	
3571	ソトー	4,800	723.00	3,470,400	
3577	東海染工	1,400	822.00	1,150,800	
3580	小松マテーレ	51,700	774.00	40,015,800	
3591	ワコールホールディングス	73,100	3,748.00	273,978,800	
3593	ホギメディカル	47,100	3,735.00	175,918,500	
3607	クラウドディアホールディングス	3,500	422.00	1,477,000	貸付有価証券

					1,500株
3608	T S I ホールディングス	115,900	761.00	88,199,900	貸付有価証券 14,600株
3611	マツオカコーポレーション	4,500	1,598.00	7,191,000	
3612	ワールド	50,300	2,069.00	104,070,700	
8011	三陽商会	13,400	2,656.00	35,590,400	
8013	ナイガイ	5,100	257.00	1,310,700	貸付有価証券 1,600株
8016	オンワードホールディングス	210,200	532.00	111,826,400	
8029	ルックホールディングス	9,900	2,649.00	26,225,100	貸付有価証券 200株
8107	キムラタン	96,300	18.00	1,733,400	貸付有価証券 23,300株
8111	ゴールドウイン	63,100	9,655.00	609,230,500	
8114	デサント	61,400	3,455.00	212,137,000	
8118	キング	5,700	720.00	4,104,000	
8127	ヤマトインターナショナル	11,900	308.00	3,665,200	
3708	特種東海製紙	19,500	4,085.00	79,657,500	
3861	王子ホールディングス	1,485,000	630.30	935,995,500	
3863	日本製紙	201,100	1,215.00	244,336,500	
3864	三菱製紙	20,300	614.00	12,464,200	貸付有価証券 5,000株
3865	北越コーポレーション	175,200	2,476.00	433,795,200	貸付有価証券 48,500株
3877	中越パルプ工業	6,000	1,932.00	11,592,000	
3880	大王製紙	157,500	1,206.00	189,945,000	
3896	阿波製紙	3,700	529.00	1,957,300	貸付有価証券 1,500株
3941	レンゴー	324,700	1,167.50	379,087,250	
3946	トーモク	20,600	2,688.00	55,372,800	貸付有価証券 800株
3950	ザ・バック	26,500	3,675.00	97,387,500	貸付有価証券 1,000株
2930	北の達人コーポレーション	150,200	200.00	30,040,000	貸付有価証券 21,300株
3405	クラレ	519,500	1,601.00	831,719,500	貸付有価証券 20,000株
3407	旭化成	2,411,600	1,119.50	2,699,786,200	
3553	共和レザー	8,700	831.00	7,229,700	
3878	巴川コーポレーション	4,300	862.00	3,706,600	
4004	レゾナック・ホールディングス	344,500	3,580.00	1,233,310,000	貸付有価証券 13,300株

4005	住友化学	2,645,400	335.00	886,209,000	
4008	住友精化	16,700	5,170.00	86,339,000	
4021	日産化学	167,400	5,915.00	990,171,000	
4022	ラサ工業	13,700	2,658.00	36,414,600	貸付有価証券 700株
4023	クレハ	78,000	2,786.00	217,308,000	
4025	多木化学	13,800	3,725.00	51,405,000	
4027	テイカ	30,800	1,584.00	48,787,200	
4028	石原産業	59,100	1,710.00	101,061,000	
4031	片倉コープアグリ	3,500	1,103.00	3,860,500	貸付有価証券 200株
4041	日本曹達	42,100	6,160.00	259,336,000	
4042	東ソー	475,900	2,103.50	1,001,055,650	
4043	トクヤマ	115,100	2,699.00	310,654,900	
4044	セントラル硝子	38,100	2,900.00	110,490,000	
4045	東亜合成	171,400	1,602.00	274,582,800	
4046	大阪ソーダ	24,900	9,780.00	243,522,000	
4047	関東電化工業	68,900	1,002.00	69,037,800	
4061	デンカ	129,600	2,437.50	315,900,000	
4063	信越化学工業	3,196,700	6,750.00	21,577,725,000	貸付有価証券 8,700株
4064	日本カーバイド工業	15,000	1,878.00	28,170,000	
4078	堺化学工業	27,100	1,977.00	53,576,700	貸付有価証券 1,100株
4082	第一稀元素化学工業	39,000	954.00	37,206,000	
4088	エア・ウォーター	336,300	2,348.50	789,800,550	
4091	日本酸素ホールディングス	345,800	4,811.00	1,663,643,800	
4092	日本化学工業	13,100	2,420.00	31,702,000	
4093	東邦アセチレン	16,600	402.00	6,673,200	
4095	日本パーカライジング	158,800	1,234.00	195,959,200	
4097	高压ガス工業	51,800	909.00	47,086,200	
4098	チタン工業	2,000	1,099.00	2,198,000	
4099	四国化成ホールディングス	45,600	1,828.00	83,356,800	貸付有価証券 200株
4100	戸田工業	8,100	1,785.00	14,458,500	貸付有価証券 1,000株
4109	ステラ ケミファ	19,300	3,780.00	72,954,000	貸付有価証券 100株
4112	保土谷化学工業	11,200	3,585.00	40,152,000	貸付有価証券 300株

4114	日本触媒	51,900	5,974.00	310,050,600	
4116	大日精化工業	24,800	2,882.00	71,473,600	
4118	カネカ	90,500	3,846.00	348,063,000	貸付有価証券 3,200株
4182	三菱瓦斯化学	260,200	2,626.50	683,415,300	
4183	三井化学	294,000	4,448.00	1,307,712,000	
4185	J S R	388,300	4,327.00	1,680,174,100	
4186	東京応化工業	170,100	4,548.00	773,614,800	
4187	大阪有機化学工業	29,800	3,155.00	94,019,000	貸付有価証券 4,000株
4188	三菱ケミカルグループ	2,606,000	939.60	2,448,597,600	
4189	KHネオケム	54,400	2,230.00	121,312,000	
4202	ダイセル	458,200	1,494.00	684,550,800	
4203	住友ベークライト	49,900	9,172.00	457,682,800	
4204	積水化学工業	716,300	2,227.00	1,595,200,100	
4205	日本ゼオン	244,400	1,318.50	322,241,400	
4206	アイカ工業	90,000	3,760.00	338,400,000	
4208	U B E	169,600	2,742.50	465,128,000	
4212	積水樹脂	53,200	2,416.00	128,531,200	
4215	タキロンシーアイ	90,900	669.00	60,812,100	
4216	旭有機材	23,700	5,190.00	123,003,000	
4218	ニチバン	19,300	1,978.00	38,175,400	貸付有価証券 900株
4220	リケンテクノス	76,800	982.00	75,417,600	
4221	大倉工業	16,500	3,160.00	52,140,000	
4228	積水化成成品工業	50,000	510.00	25,500,000	貸付有価証券 600株
4229	群栄化学工業	8,400	3,755.00	31,542,000	
4231	タイガースポリマー	6,800	1,144.00	7,779,200	
4238	ミライアル	5,200	1,541.00	8,013,200	
4245	ダイキアクシス	5,900	702.00	4,141,800	貸付有価証券 1,500株
4246	ダイキョーニシカワ	78,700	792.00	62,330,400	
4248	竹本容器	5,300	788.00	4,176,400	
4249	森六ホールディングス	18,500	2,757.00	51,004,500	
4251	恵和	25,600	1,131.00	28,953,600	
4272	日本化薬	272,300	1,318.00	358,891,400	
4275	カーリットホールディングス	38,400	1,057.00	40,588,800	

4362	日本精化	23,600	2,648.00	62,492,800	貸付有価証券 800株
4368	扶桑化学工業	37,800	4,875.00	184,275,000	
4369	トリケミカル研究所	43,300	4,990.00	216,067,000	貸付有価証券 900株
4401	ADEKA	124,300	3,263.00	405,590,900	
4403	日油	107,600	6,555.00	705,318,000	
4406	新日本理化	20,800	188.00	3,910,400	
4410	ハリマ化成グループ	22,200	941.00	20,890,200	
4452	花王	806,000	5,579.00	4,496,674,000	貸付有価証券 31,000株
4461	第一工業製薬	14,200	3,645.00	51,759,000	貸付有価証券 500株
4462	石原ケミカル	15,900	1,885.00	29,971,500	貸付有価証券 700株
4463	日華化学	6,000	953.00	5,718,000	貸付有価証券 1,500株
4465	ニイタカ	2,800	1,964.00	5,499,200	
4471	三洋化成工業	21,900	4,470.00	97,893,000	
4531	有機合成薬品工業	11,700	321.00	3,755,700	貸付有価証券 3,300株
4611	大日本塗料	39,500	1,175.00	46,412,500	
4612	日本ペイントホールディングス	1,892,900	1,073.50	2,032,028,150	貸付有価証券 51,300株
4613	関西ペイント	349,300	2,205.50	770,381,150	
4615	神東塗料	12,500	130.00	1,625,000	貸付有価証券 3,400株
4617	中国塗料	73,200	2,280.00	166,896,000	
4619	日本特殊塗料	10,700	1,424.00	15,236,800	
4620	藤倉化成	41,100	483.00	19,851,300	
4626	太陽ホールディングス	62,100	3,365.00	208,966,500	
4631	D I C	139,300	2,906.50	404,875,450	貸付有価証券 5,400株
4633	サカタインクス	79,300	1,549.00	122,835,700	
4634	a r t i e n c e	77,600	2,964.00	230,006,400	
4636	T & K TOKA	34,100	1,402.00	47,808,200	
4901	富士フイルムホールディングス	662,200	10,295.00	6,817,349,000	
4911	資生堂	745,300	4,086.00	3,045,295,800	貸付有価証券 28,600株
4912	ライオン	467,200	1,325.50	619,273,600	
4914	高砂香料工業	26,800	3,580.00	95,944,000	
4917	マンダム	77,100	1,372.00	105,781,200	

4919	ミルボン	48,500	3,220.00	156,170,000	
4921	ファンケル	156,100	2,043.00	318,912,300	
4922	コーセー	72,600	7,591.00	551,106,600	貸付有価証券 400株
4923	コタ	32,900	1,687.00	55,502,300	貸付有価証券 400株
4926	シーボン	2,000	1,499.00	2,998,000	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	183,000	1,425.00	260,775,000	貸付有価証券 12,600株
4928	ノエビアホールディングス	31,800	5,230.00	166,314,000	
4929	アジュバンホールディングス	3,600	914.00	3,290,400	貸付有価証券 400株
4931	新日本製薬	20,400	1,716.00	35,006,400	
4933	I n e	7,100	1,821.00	12,929,100	
4936	アクシージア	17,600	798.00	14,044,800	貸付有価証券 600株
4951	エステー	27,500	1,578.00	43,395,000	
4955	アグロ カネショウ	14,300	1,257.00	17,975,100	貸付有価証券 100株
4956	コニシ	103,100	1,580.00	162,898,000	
4958	長谷川香料	68,200	3,040.00	207,328,000	
4967	小林製薬	103,800	5,056.00	524,812,800	貸付有価証券 2,900株
4968	荒川化学工業	30,200	1,176.00	35,515,200	
4971	メック	29,400	4,085.00	120,099,000	貸付有価証券 1,200株
4973	日本高純度化学	8,100	2,976.00	24,105,600	
4974	タカラバイオ	96,200	990.00	95,238,000	
4975	J C U	39,900	3,850.00	153,615,000	
4977	新田ゼラチン	9,900	748.00	7,405,200	
4979	O A Tアグリオ	11,800	1,930.00	22,774,000	
4980	デクセリアルズ	89,600	6,359.00	569,766,400	
4985	アース製薬	32,400	4,290.00	138,996,000	貸付有価証券 3,300株
4992	北興化学工業	35,900	1,183.00	42,469,700	
4994	大成ラミック	10,300	3,040.00	31,312,000	
4996	クミアイ化学工業	141,800	812.00	115,141,600	貸付有価証券 200株
4997	日本農薬	65,500	758.00	49,649,000	
5142	アキレス	22,500	1,571.00	35,347,500	
5208	有沢製作所	62,500	1,164.00	72,750,000	

6988	日東電工	229,300	14,150.00	3,244,595,000	
7874	レック	45,700	1,157.00	52,874,900	
7888	三光合成	44,900	720.00	32,328,000	
7908	きもと	25,100	229.00	5,747,900	
7917	藤森工業	28,200	4,275.00	120,555,000	
7925	前澤化成工業	23,000	1,691.00	38,893,000	
7931	未来工業	12,800	4,480.00	57,344,000	
7940	ウェーブロックホールディングス	5,200	695.00	3,614,000	
7942	J S P	25,100	2,285.00	57,353,500	
7947	エフピコ	67,500	2,746.00	185,355,000	
7958	天馬	25,900	2,346.00	60,761,400	
7970	信越ポリマー	77,000	1,568.00	120,736,000	
7971	東リ	34,900	419.00	14,623,100	
7988	ニフコ	106,700	3,859.00	411,755,300	
7995	バルカー	29,800	5,260.00	156,748,000	
8113	ユニ・チャーム	743,600	4,812.00	3,578,203,200	貸付有価証券 1,300株
9385	ショーエイコーポレーション	4,500	634.00	2,853,000	
4151	協和キリン	431,200	2,738.50	1,180,841,200	貸付有価証券 16,600株
4502	武田薬品工業	3,158,900	4,365.00	13,788,598,500	
4503	アステラス製薬	3,130,900	1,653.50	5,176,943,150	
4506	住友ファーマ	264,800	404.00	106,979,200	
4507	塩野義製薬	450,000	7,812.00	3,515,400,000	
4512	わかもと製薬	15,900	222.00	3,529,800	貸付有価証券 5,200株
4516	日本新薬	93,500	4,567.00	427,014,500	
4519	中外製薬	1,117,300	5,850.00	6,536,205,000	貸付有価証券 42,900株
4521	科研製薬	61,100	3,591.00	219,410,100	
4523	エーザイ	434,200	6,297.00	2,734,157,400	
4527	ロート製薬	345,700	3,159.00	1,092,066,300	
4528	小野薬品工業	757,500	2,497.00	1,891,477,500	
4530	久光製薬	79,300	3,985.00	316,010,500	貸付有価証券 3,100株
4534	持田製薬	41,000	3,235.00	132,635,000	
4536	参天製薬	650,500	1,482.50	964,366,250	
4538	扶桑薬品工業	12,600	2,319.00	29,219,400	

4539	日本ケミファ	1,700	1,682.00	2,859,400	
4540	ツムラ	112,400	3,891.00	437,348,400	
4547	キッセイ薬品工業	59,100	3,510.00	207,441,000	
4548	生化学工業	60,500	768.00	46,464,000	
4549	栄研化学	65,500	1,958.00	128,249,000	
4551	鳥居薬品	19,200	4,010.00	76,992,000	
4552	J C R ファーマ	120,800	870.00	105,096,000	
4553	東和薬品	54,800	2,910.00	159,468,000	
4554	富士製薬工業	26,400	1,623.00	42,847,200	
4559	ゼリア新薬工業	49,500	2,176.00	107,712,000	
4565	そーせいグループ	117,200	1,578.00	184,941,600	貸付有価証券 1,400株
4568	第一三共	3,109,400	4,822.00	14,993,526,800	
4569	杏林製薬	77,400	1,834.00	141,951,600	
4574	大幸薬品	74,100	406.00	30,084,600	貸付有価証券 1,000株
4577	ダイト	27,200	2,316.00	62,995,200	貸付有価証券 100株
4578	大塚ホールディングス	742,400	6,318.00	4,690,483,200	貸付有価証券 28,500株
4587	ペプチドリーム	173,000	1,429.50	247,303,500	貸付有価証券 2,200株
4880	セルソース	9,900	1,426.00	14,117,400	
4886	あすか製薬ホールディングス	36,600	2,125.00	77,775,000	
4887	サワイグループホールディングス	81,600	6,038.00	492,700,800	
3315	日本コークス工業	362,100	129.00	46,710,900	
5011	ニチレキ	46,400	2,523.00	117,067,200	貸付有価証券 200株
5013	ユシロ化学工業	18,500	2,252.00	41,662,000	
5015	ビーピー・カストロール	5,900	985.00	5,811,500	
5017	富士石油	104,000	476.00	49,504,000	貸付有価証券 2,800株
5018	MORESCO	5,400	1,422.00	7,678,800	貸付有価証券 1,600株
5019	出光興産	1,982,000	1,054.00	2,089,028,000	
5020	ENEOSホールディングス	5,650,700	733.80	4,146,483,660	
5021	コスモエネルギーホールディングス	105,800	7,571.00	801,011,800	
5101	横浜ゴム	180,500	4,120.00	743,660,000	貸付有価証券 7,000株
5105	TOYO TIRE	205,100	2,811.50	576,638,650	
5108	ブリヂストン	1,044,800	6,697.00	6,997,025,600	貸付有価証券

					40,100株
5110	住友ゴム工業	350,100	1,828.50	640,157,850	
5121	藤倉コンポジット	27,500	1,443.00	39,682,500	貸付有価証券 800株
5122	オカモト	16,900	5,040.00	85,176,000	
5185	フコク	18,700	1,849.00	34,576,300	
5186	ニッタ	36,300	4,020.00	145,926,000	
5191	住友理工	55,400	1,332.00	73,792,800	
5192	三ツ星ベルト	43,400	4,890.00	212,226,000	
5195	バンドー化学	53,000	1,871.00	99,163,000	
3110	日東紡績	45,200	6,070.00	274,364,000	
5201	A G C	318,300	5,525.00	1,758,607,500	貸付有価証券 12,800株
5202	日本板硝子	170,300	524.00	89,237,200	
5204	石塚硝子	2,600	2,755.00	7,163,000	
5210	日本山村硝子	5,700	1,658.00	9,450,600	貸付有価証券 1,900株
5214	日本電気硝子	145,700	3,734.00	544,043,800	貸付有価証券 5,600株
5218	オハラ	16,900	1,303.00	22,020,700	貸付有価証券 1,700株
5232	住友大阪セメント	59,400	3,910.00	232,254,000	
5233	太平洋セメント	211,000	3,579.00	755,169,000	
5262	日本ヒューム	31,200	892.00	27,830,400	
5269	日本コンクリート工業	69,200	409.00	28,302,800	貸付有価証券 2,700株
5273	三谷セキサン	15,000	5,630.00	84,450,000	貸付有価証券 100株
5288	アジアパイルホールディングス	50,700	796.00	40,357,200	
5301	東海カーボン	329,300	993.30	327,093,690	貸付有価証券 12,700株
5302	日本カーボン	18,900	5,330.00	100,737,000	
5310	東洋炭素	25,100	8,050.00	202,055,000	貸付有価証券 3,600株
5331	ノリタケカンパニーリミテド	19,800	8,420.00	166,716,000	
5332	TOTO	235,500	4,128.00	972,144,000	貸付有価証券 9,100株
5333	日本碍子	415,200	2,043.00	848,253,600	
5334	日本特殊陶業	298,900	5,112.00	1,527,976,800	
5337	ダントーホールディングス	10,000	1,133.00	11,330,000	貸付有価証券 4,800株
5344	MARUWA	13,200	31,700.00	418,440,000	

5351	品川リフラクトリーズ	43,900	1,944.00	85,341,600	
5352	黒崎播磨	7,300	14,270.00	104,171,000	
5357	ヨータイ	22,000	1,502.00	33,044,000	
5363	東京窯業	16,200	491.00	7,954,200	
5367	ニッカトー	6,700	612.00	4,100,400	
5384	フジミインコーポレーテッド	95,900	3,605.00	345,719,500	
5388	クニミネ工業	4,300	1,091.00	4,691,300	
5391	エーアンドエーマテリアル	2,800	1,398.00	3,914,400	
5393	ニチアス	90,200	4,085.00	368,467,000	
7943	ニチハ	44,700	3,420.00	152,874,000	
5401	日本製鉄	1,644,100	3,782.00	6,217,986,200	
5406	神戸製鋼所	738,500	2,167.00	1,600,329,500	
5408	中山製鋼所	83,900	977.00	81,970,300	
5410	合同製鐵	20,500	6,030.00	123,615,000	
5411	J F Eホールディングス	1,021,200	2,610.00	2,665,332,000	
5423	東京製鐵	103,200	1,692.00	174,614,400	貸付有価証券 4,000株
5440	共英製鋼	41,800	2,383.00	99,609,400	
5444	大和工業	69,200	8,847.00	612,212,400	
5445	東京鐵鋼	16,200	5,530.00	89,586,000	
5449	大阪製鐵	16,900	2,177.00	36,791,300	貸付有価証券 700株
5451	淀川製鋼所	41,700	4,700.00	195,990,000	
5461	中部鋼鈹	24,100	2,644.00	63,720,400	
5463	丸一鋼管	111,800	4,108.00	459,274,400	貸付有価証券 500株
5464	モリ工業	7,400	5,720.00	42,328,000	
5471	大同特殊鋼	231,300	1,807.00	417,959,100	
5476	日本高周波鋼業	5,900	575.00	3,392,500	貸付有価証券 1,600株
5480	日本冶金工業	26,800	4,960.00	132,928,000	
5481	山陽特殊製鋼	36,300	2,287.00	83,018,100	
5482	愛知製鋼	21,200	3,905.00	82,786,000	
5491	日本金属	4,000	862.00	3,448,000	貸付有価証券 1,000株
5541	大平洋金属	31,300	1,324.00	41,441,200	貸付有価証券 2,900株
5563	新日本電工	182,600	313.00	57,153,800	
5602	栗本鐵工所	17,000	3,810.00	64,770,000	

5603	虹技	1,900	1,497.00	2,844,300	
5612	日本鑄鉄管	1,700	1,193.00	2,028,100	
5632	三菱製鋼	27,200	1,503.00	40,881,600	
5658	日亜鋼業	15,700	338.00	5,306,600	
5659	日本精線	5,800	6,900.00	40,020,000	
5698	エンビプロ・ホールディングス	28,900	520.00	15,028,000	
6319	シンニッタン	19,600	298.00	5,840,800	
7305	新家工業	3,400	3,900.00	13,260,000	
5702	大紀アルミニウム工業所	46,500	1,251.00	58,171,500	
5703	日本軽金属ホールディングス	107,300	1,842.00	197,646,600	
5706	三井金属鉱業	106,900	4,666.00	498,795,400	
5707	東邦亜鉛	23,500	1,078.00	25,333,000	貸付有価証券 900株
5711	三菱マテリアル	262,500	2,923.00	767,287,500	
5713	住友金属鉱山	425,700	4,476.00	1,905,433,200	
5714	DOWAホールディングス	90,700	5,399.00	489,689,300	
5715	古河機械金属	48,400	1,831.00	88,620,400	
5721	エス・サイエンス	75,500	26.00	1,963,000	貸付有価証券 19,300株
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	63,700	2,621.00	166,957,700	貸付有価証券 4,600株
5727	東邦チタニウム	75,900	1,532.00	116,278,800	貸付有価証券 14,900株
5741	UACJ	51,500	4,430.00	228,145,000	
5757	CKサンエツ	8,900	4,015.00	35,733,500	
5801	古河電気工業	122,300	3,219.00	393,683,700	貸付有価証券 3,200株
5802	住友電気工業	1,373,600	2,376.00	3,263,673,600	貸付有価証券 2,000株
5803	フジクラ	433,100	2,172.00	940,693,200	
5805	SWCC	41,000	3,740.00	153,340,000	
5809	タツタ電線	65,400	704.00	46,041,600	貸付有価証券 8,700株
5819	カナレ電気	2,500	1,740.00	4,350,000	
5821	平河ヒューテック	23,500	1,411.00	33,158,500	
5851	リョービ	39,100	2,965.00	115,931,500	貸付有価証券 1,600株
5852	アーレスティ	17,100	828.00	14,158,800	
5857	AREホールディングス	137,900	1,990.00	274,421,000	貸付有価証券 300株
3421	稲葉製作所	18,100	1,832.00	33,159,200	

3431	宮地エンジニアリンググループ	18,400	4,330.00	79,672,000	
3433	トーカロ	105,900	1,748.00	185,113,200	
3434	アルファＣo	5,700	1,743.00	9,935,100	
3436	SUMCO	652,400	2,424.50	1,581,743,800	貸付有価証券 25,100株
3443	川田テクノロジーズ	8,700	10,330.00	89,871,000	
3445	RS Technologies	24,600	2,801.00	68,904,600	
3446	ジェイテックコーポレーション	2,000	1,953.00	3,906,000	貸付有価証券 700株
3447	信和	9,900	763.00	7,553,700	
5901	東洋製罐グループホールディングス	210,600	2,524.50	531,659,700	
5902	ホッカンホールディングス	17,900	1,940.00	34,726,000	
5909	コロナ	20,500	992.00	20,336,000	
5911	横河ブリッジホールディングス	57,400	2,941.00	168,813,400	
5915	駒井ハルテック	2,700	2,144.00	5,788,800	
5923	高田機工	1,200	3,705.00	4,446,000	貸付有価証券 100株
5929	三和ホールディングス	368,900	2,652.50	978,507,250	
5930	文化シャッター	96,100	1,711.00	164,427,100	
5932	三協立山	46,200	913.00	42,180,600	貸付有価証券 1,700株
5933	アルインコ	28,000	1,032.00	28,896,000	
5936	東洋シャッター	3,500	722.00	2,527,000	
5938	LIXIL	573,300	1,920.00	1,100,736,000	
5942	日本ファイルコン	10,100	555.00	5,605,500	
5943	ノーリツ	60,800	1,714.00	104,211,200	
5946	長府製作所	36,500	2,168.00	79,132,000	
5947	リンナイ	175,700	3,482.00	611,787,400	
5951	ダイニチ工業	7,700	721.00	5,551,700	
5957	日東精工	53,200	632.00	33,622,400	
5958	三洋工業	1,800	3,435.00	6,183,000	
5959	岡部	65,600	760.00	49,856,000	
5970	ジーテクト	46,800	2,119.00	99,169,200	
5975	東プレ	64,700	2,563.00	165,826,100	
5976	高周波熱錬	56,600	1,123.00	63,561,800	
5981	東京製綱	23,800	1,434.00	34,129,200	
5985	サンコール	32,600	490.00	15,974,000	
5986	モリテック スチール	13,100	254.00	3,327,400	貸付有価証券

					3,400株
5988	パイオラックス	45,600	2,719.00	123,986,400	
5989	エイチワン	37,800	725.00	27,405,000	
5991	日本発條	324,800	1,500.00	487,200,000	
5992	中央発條	27,200	1,130.00	30,736,000	
5998	アドバネクス	2,000	1,407.00	2,814,000	
7989	立川ブラインド工業	16,600	1,465.00	24,319,000	
8155	三益半導体工業	33,100	3,060.00	101,286,000	
1909	日本ドライケミカル	3,500	2,642.00	9,247,000	
5631	日本製鋼所	99,000	3,211.00	317,889,000	
6005	三浦工業	150,100	2,907.50	436,415,750	
6013	タクマ	121,500	1,909.00	231,943,500	
6101	ツガミ	79,900	1,166.00	93,163,400	
6103	オークマ	31,400	7,309.00	229,502,600	貸付有価証券 1,400株
6104	芝浦機械	35,900	3,670.00	131,753,000	
6113	アマダ	573,500	1,800.50	1,032,586,750	
6118	アイダエンジニアリング	83,200	917.00	76,294,400	
6134	F U J I	169,200	2,677.50	453,033,000	
6135	牧野フライス製作所	39,800	6,220.00	247,556,000	
6136	オーエスジー	158,400	2,153.00	341,035,200	
6138	ダイジェット工業	1,500	859.00	1,288,500	
6140	旭ダイヤモンド工業	82,900	984.00	81,573,600	
6141	DMG森精機	217,900	4,146.00	903,413,400	貸付有価証券 8,400株
6143	ソディック	87,500	720.00	63,000,000	
6146	ディスコ	173,100	54,400.00	9,416,640,000	
6151	日東工器	17,400	1,901.00	33,077,400	
6157	日進工具	33,300	997.00	33,200,100	
6165	パンチ工業	14,600	455.00	6,643,000	
6167	富士ダイス	21,300	697.00	14,846,100	貸付有価証券 200株
6203	豊和工業	8,300	830.00	6,889,000	貸付有価証券 1,000株
6208	石川製作所	3,900	1,345.00	5,245,500	貸付有価証券 1,000株
6209	リケンNPR	39,000	3,030.00	118,170,000	
6210	東洋機械金属	11,000	800.00	8,800,000	
6217	津田駒工業	2,700	475.00	1,282,500	貸付有価証券

					800 株
6218	エンシュウ	3,600	688.00	2,476,800	貸付有価証券 1,000 株
6222	島精機製作所	57,200	1,379.00	78,878,800	
6235	オプトラン	59,000	2,037.00	120,183,000	
6236	NCホールディングス	3,600	1,800.00	6,480,000	貸付有価証券 1,300 株
6237	イワキポンプ	23,900	2,755.00	65,844,500	
6238	フリーユ	33,900	1,232.00	41,764,800	
6240	ヤマシンフィルタ	86,300	450.00	38,835,000	貸付有価証券 3,200 株
6247	日阪製作所	39,200	1,025.00	40,180,000	
6250	やまびこ	58,700	1,981.00	116,284,700	
6254	野村マイクロ・サイエンス	12,200	18,720.00	228,384,000	
6258	平田機工	17,200	7,810.00	134,332,000	貸付有価証券 2,100 株
6262	PEGASUS	39,700	531.00	21,080,700	
6264	マルマエ	15,600	2,074.00	32,354,400	貸付有価証券 1,800 株
6266	タツモ	21,700	3,850.00	83,545,000	
6268	ナプテスコ	225,600	2,516.00	567,609,600	
6269	三井海洋開発	45,500	3,125.00	142,187,500	
6272	レオン自動機	41,600	1,521.00	63,273,600	
6273	SMC	107,600	85,990.00	9,252,524,000	
6277	ホソカワミクロン	23,000	4,700.00	108,100,000	
6278	ユニオンツール	15,800	4,370.00	69,046,000	
6279	瑞光	25,900	1,446.00	37,451,400	貸付有価証券 1,200 株
6282	オイレス工業	48,700	2,288.00	111,425,600	貸付有価証券 1,000 株
6284	日精エー・エス・ビー機械	14,300	5,310.00	75,933,000	
6287	サトーホールディングス	51,100	2,354.00	120,289,400	
6289	技研製作所	33,800	2,009.00	67,904,200	
6291	日本エアータック	16,800	1,175.00	19,740,000	
6292	カワタ	4,700	1,075.00	5,052,500	
6293	日精樹脂工業	26,700	1,224.00	32,680,800	
6294	オカダアイオン	5,100	3,005.00	15,325,500	
6298	ワイエイシイホールディングス	13,500	2,511.00	33,898,500	貸付有価証券 2,800 株
6301	小松製作所	1,684,800	4,438.00	7,477,142,400	

6302	住友重機械工業	212,600	4,743.00	1,008,361,800	貸付有価証券 8,200株
6305	日立建機	143,100	4,553.00	651,534,300	
6306	日工	53,200	784.00	41,708,800	
6309	巴工業	14,000	4,185.00	58,590,000	貸付有価証券 500株
6310	井関農機	33,600	1,030.00	34,608,000	貸付有価証券 1,300株
6315	TOWA	40,000	9,640.00	385,600,000	
6316	丸山製作所	2,600	2,501.00	6,502,600	
6317	北川鉄工所	14,100	1,706.00	24,054,600	
6323	ローツェ	18,800	20,430.00	384,084,000	
6325	タカキタ	5,000	495.00	2,475,000	貸付有価証券 1,600株
6326	クボタ	1,879,100	2,323.00	4,365,149,300	貸付有価証券 73,000株
6328	荏原実業	18,900	3,590.00	67,851,000	
6331	三菱化工機	12,600	3,985.00	50,211,000	
6332	月島ホールディングス	48,600	1,437.00	69,838,200	
6333	帝国電機製作所	25,300	2,580.00	65,274,000	
6335	東京機械製作所	4,000	469.00	1,876,000	貸付有価証券 1,000株
6339	新東工業	72,600	1,159.00	84,143,400	
6340	澁谷工業	33,700	3,470.00	116,939,000	
6345	アイチ コーポレーション	50,000	1,142.00	57,100,000	
6349	小森コーポレーション	88,500	1,305.00	115,492,500	貸付有価証券 700株
6351	鶴見製作所	27,400	3,720.00	101,928,000	
6356	日本ギア工業	5,800	635.00	3,683,000	貸付有価証券 1,300株
6358	酒井重工業	5,600	6,850.00	38,360,000	
6361	荏原製作所	147,500	13,470.00	1,986,825,000	貸付有価証券 5,700株
6362	石井鐵工所	1,700	2,921.00	4,965,700	
6363	西島製作所	30,900	2,807.00	86,736,300	
6364	北越工業	36,100	1,980.00	71,478,000	
6367	ダイキン工業	429,100	20,405.00	8,755,785,500	
6368	オルガノ	43,200	7,200.00	311,040,000	
6369	トーヨーカネツ	12,200	4,725.00	57,645,000	
6370	栗田工業	201,000	6,250.00	1,256,250,000	
6371	椿本チエイン	50,900	5,200.00	264,680,000	

6373	大同工業	6,700	801.00	5,366,700	
6378	木村化工機	27,400	709.00	19,426,600	
6381	アネスト岩田	55,600	1,336.00	74,281,600	
6383	ダイフク	606,600	3,625.00	2,198,925,000	貸付有価証券 21,400株
6387	サムコ	9,600	4,980.00	47,808,000	貸付有価証券 1,200株
6390	加藤製作所	7,700	1,519.00	11,696,300	
6393	油研工業	2,500	2,458.00	6,145,000	
6395	タダノ	206,800	1,258.50	260,257,800	
6406	フジテック	84,000	3,862.00	324,408,000	
6407	CKD	99,400	3,055.00	303,667,000	
6412	平和	106,300	2,061.00	219,084,300	
6413	理想科学工業	28,700	3,160.00	90,692,000	貸付有価証券 600株
6417	SANKYO	413,300	1,696.00	700,956,800	
6418	日本金銭機械	43,400	1,301.00	56,463,400	貸付有価証券 4,900株
6419	マースグループホールディングス	18,100	3,225.00	58,372,500	
6420	フクシマガリレイ	23,500	5,970.00	140,295,000	
6428	オーイズミ	5,700	426.00	2,428,200	
6430	ダイコク電機	17,700	4,165.00	73,720,500	貸付有価証券 2,100株
6432	竹内製作所	65,200	5,730.00	373,596,000	貸付有価証券 200株
6436	アマノ	102,000	4,026.00	410,652,000	
6440	JUKI	55,700	544.00	30,300,800	
6444	サンデン	22,700	170.00	3,859,000	貸付有価証券 7,600株
6445	ジャノメ	36,400	712.00	25,916,800	
6454	マックス	50,600	3,310.00	167,486,000	
6457	グローリー	86,300	2,926.50	252,556,950	
6458	新晃工業	36,200	3,780.00	136,836,000	
6459	大和冷機工業	55,100	1,555.00	85,680,500	貸付有価証券 6,400株
6460	セガサミーホールディングス	321,000	1,869.00	599,949,000	
6463	TPR	45,600	2,400.00	109,440,000	
6464	ツバキ・ナカシマ	72,000	807.00	58,104,000	貸付有価証券 2,700株
6465	ホシザキ	212,100	5,560.00	1,179,276,000	貸付有価証券 5,200株

6470	大豊工業	31,100	944.00	29,358,400	
6471	日本精工	665,400	866.10	576,302,940	
6472	N T N	779,500	318.80	248,504,600	
6473	ジェイテクト	319,800	1,416.00	452,836,800	
6474	不二越	26,500	3,470.00	91,955,000	
6480	日本トムソン	97,800	668.00	65,330,400	
6481	T H K	207,400	3,351.00	694,997,400	
6482	ユーシン精機	28,500	691.00	19,693,500	
6485	前澤給装工業	25,800	1,317.00	33,978,600	
6486	イーグル工業	39,700	1,835.00	72,849,500	
6489	前澤工業	8,700	1,089.00	9,474,300	
6490	日本ピラー工業	33,300	5,920.00	197,136,000	
6498	キッツ	120,300	1,294.00	155,668,200	
6586	マキタ	409,900	4,168.00	1,708,463,200	
7003	三井E&S	178,400	1,936.00	345,382,400	貸付有価証券 6,600株
7004	日立造船	317,100	1,306.00	414,132,600	貸付有価証券 11,300株
7011	三菱重工業	628,600	13,590.00	8,542,674,000	
7013	I H I	267,600	3,683.00	985,570,800	
7022	サノヤスホールディングス	19,500	196.00	3,822,000	
7718	スター精密	66,100	1,847.00	122,086,700	
3105	日清紡ホールディングス	270,200	1,212.50	327,617,500	
4062	イビデン	187,500	6,596.00	1,236,750,000	
4902	コニカミノルタ	802,800	496.90	398,911,320	
6448	ブラザー工業	480,200	2,813.50	1,351,042,700	
6479	ミネベアミツミ	625,200	2,932.50	1,833,399,000	
6501	日立製作所	1,727,500	13,815.00	23,865,412,500	貸付有価証券 21,700株
6503	三菱電機	4,000,600	2,545.50	10,183,527,300	
6504	富士電機	218,600	9,859.00	2,155,177,400	貸付有価証券 3,600株
6505	東洋電機製造	5,000	1,182.00	5,910,000	
6506	安川電機	390,400	6,478.00	2,529,011,200	貸付有価証券 16,400株
6507	シンフォニアテクノロジー	39,600	3,110.00	123,156,000	
6508	明電舎	66,600	2,777.00	184,948,200	
6513	オリジン	3,400	1,220.00	4,148,000	

6516	山洋電気	15,500	6,970.00	108,035,000	
6517	デンヨー	27,400	2,356.00	64,554,400	
6523	PHCホールディングス	67,200	1,306.00	87,763,200	
6525	KOKUSAI ELECTRIC	138,900	3,750.00	520,875,000	
6526	ソシオネクスト	260,900	4,184.00	1,091,605,600	
6588	東芝テック	46,000	3,025.00	139,150,000	
6590	芝浦メカトロニクス	20,500	6,560.00	134,480,000	
6592	マブチモーター	176,800	2,769.00	489,559,200	貸付有価証券 300株
6594	ニデック	793,600	6,339.00	5,030,630,400	
6615	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	22,600	387.00	8,746,200	貸付有価証券 2,500株
6616	トレックス・セミコンダクター	18,500	1,833.00	33,910,500	貸付有価証券 900株
6617	東光高岳	21,700	2,444.00	53,034,800	
6619	ダブル・スコープ	102,900	560.00	57,624,000	貸付有価証券 6,900株
6622	ダイヘン	36,100	9,500.00	342,950,000	
6630	ヤーマン	69,900	974.00	68,082,600	貸付有価証券 6,400株
6632	JVCケンウッド	283,700	954.00	270,649,800	
6638	ミマキエンジニアリング	34,100	1,091.00	37,203,100	
6640	IPEX	24,900	1,803.00	44,894,700	貸付有価証券 1,000株
6644	大崎電気工業	78,700	680.00	53,516,000	
6645	オムロン	274,500	5,510.00	1,512,495,000	
6651	日東工業	48,500	4,435.00	215,097,500	
6652	IDEC	53,100	2,804.00	148,892,400	
6653	正興電機製作所	5,200	1,242.00	6,458,400	貸付有価証券 1,100株
6654	不二電機工業	3,000	1,123.00	3,369,000	貸付有価証券 700株
6674	ジーエス・ユアサコーポレーション	140,300	3,120.00	437,736,000	
6675	サクサホールディングス	3,500	3,255.00	11,392,500	
6676	メルコホールディングス	11,300	3,555.00	40,171,500	
6678	テクノメディカ	8,700	1,764.00	15,346,800	
6699	ダイヤモンドエレクトリックホールディング	13,400	770.00	10,318,000	貸付有価証券 1,100株
6701	日本電気	472,100	11,025.00	5,204,902,500	
6702	富士通	330,800	25,125.00	8,311,350,000	貸付有価証券 13,800株

6703	沖電気工業	162,500	1,166.00	189,475,000	
6704	岩崎通信機	6,900	697.00	4,809,300	
6706	電気興業	16,100	2,170.00	34,937,000	
6707	サンケン電気	33,400	6,426.00	214,628,400	
6715	ナカヨ	2,400	1,200.00	2,880,000	
6718	アイホン	19,400	3,085.00	59,849,000	貸付有価証券 700株
6723	ルネサスエレクトロニクス	2,345,700	2,595.00	6,087,091,500	貸付有価証券 89,900株
6724	セイコーエプソン	461,200	2,610.50	1,203,962,600	
6727	ワコム	273,400	653.00	178,530,200	
6728	アルバック	78,800	9,802.00	772,397,600	
6730	アクセル	14,300	2,025.00	28,957,500	貸付有価証券 1,000株
6737	E I Z O	26,300	5,280.00	138,864,000	
6740	ジャパンディスプレイ	1,549,300	23.00	35,633,900	貸付有価証券 126,800株
6741	日本信号	81,900	1,052.00	86,158,800	
6742	京三製作所	75,300	532.00	40,059,600	
6744	能美防災	48,600	2,259.00	109,787,400	
6745	ホーチキ	26,800	2,222.00	59,549,600	
6748	星和電機	6,300	545.00	3,433,500	
6750	エレコム	85,900	1,560.00	134,004,000	
6752	パナソニック ホールディングス	4,246,100	1,453.50	6,171,706,350	貸付有価証券 141,700株
6753	シャープ	605,900	823.40	498,898,060	貸付有価証券 50,900株
6754	アンリツ	253,200	1,256.00	318,019,200	
6755	富士通ゼネラル	101,900	1,910.00	194,629,000	貸付有価証券 7,400株
6758	ソニーグループ	2,517,400	13,050.00	32,852,070,000	
6762	TDK	569,100	7,426.00	4,226,136,600	
6763	帝国通信工業	15,700	1,897.00	29,782,900	
6768	タムラ製作所	143,200	581.00	83,199,200	
6770	アルプスアルパイン	321,000	1,152.00	369,792,000	貸付有価証券 12,400株
6771	池上通信機	4,800	812.00	3,897,600	
6779	日本電波工業	43,100	1,284.00	55,340,400	貸付有価証券 1,600株
6785	鈴木	19,200	1,195.00	22,944,000	
6787	メイコー	35,700	5,200.00	185,640,000	

6788	日本トリム	8,100	3,950.00	31,995,000	
6789	ローランド ディー. ジー.	19,700	5,410.00	106,577,000	
6794	フォスター電機	26,600	1,208.00	32,132,800	貸付有価証券 1,300株
6798	SMK	9,600	2,713.00	26,044,800	貸付有価証券 400株
6800	ヨコオ	31,700	1,528.00	48,437,600	貸付有価証券 1,000株
6803	ティアック	25,000	102.00	2,550,000	貸付有価証券 900株
6804	ホシデン	81,700	1,939.00	158,416,300	貸付有価証券 3,900株
6806	ヒロセ電機	53,100	15,510.00	823,581,000	貸付有価証券 100株
6807	日本航空電子工業	86,000	2,547.00	219,042,000	
6809	TOA	40,900	1,151.00	47,075,900	
6810	マクセル	79,400	1,588.00	126,087,200	
6814	古野電気	46,700	2,372.00	110,772,400	貸付有価証券 1,300株
6817	スミダコーポレーション	48,100	1,225.00	58,922,500	貸付有価証券 300株
6820	アイコム	13,800	3,540.00	48,852,000	
6823	リオン	14,800	2,959.00	43,793,200	
6841	横河電機	393,200	3,511.00	1,380,525,200	貸付有価証券 15,100株
6844	新電元工業	13,800	3,145.00	43,401,000	貸付有価証券 600株
6845	アズビル	244,800	4,203.00	1,028,894,400	
6848	東亜ディーケーケー	7,000	935.00	6,545,000	
6849	日本光電工業	152,600	3,940.00	601,244,000	
6850	チノー	14,800	2,687.00	39,767,600	
6853	共和電業	14,000	424.00	5,936,000	
6855	日本電子材料	21,900	2,580.00	56,502,000	
6856	堀場製作所	67,900	15,655.00	1,062,974,500	
6857	アドバンテスト	1,019,600	6,731.00	6,862,927,600	
6858	小野測器	5,900	660.00	3,894,000	
6859	エスペック	28,500	3,055.00	87,067,500	
6861	キーエンス	356,000	70,370.00	25,051,720,000	
6866	日置電機	16,800	7,000.00	117,600,000	貸付有価証券 500株
6869	シスメックス	307,100	8,130.00	2,496,723,000	
6871	日本マイクロニクス	63,900	8,210.00	524,619,000	貸付有価証券

					7,700株
6875	メガチップス	28,100	3,945.00	110,854,500	
6877	OBARA GROUP	19,400	3,750.00	72,750,000	
6901	澤藤電機	1,800	1,312.00	2,361,600	
6904	原田工業	6,700	748.00	5,011,600	貸付有価証券 700株
6905	コーセル	38,000	1,512.00	57,456,000	貸付有価証券 600株
6908	イリソ電子工業	32,700	3,050.00	99,735,000	
6914	オプテックスグループ	65,300	1,960.00	127,988,000	
6915	千代田インテグレ	13,900	2,679.00	37,238,100	
6920	レーザーテック	163,100	42,180.00	6,879,558,000	貸付有価証券 6,300株
6923	スタンレー電気	227,800	2,687.50	612,212,500	
6925	ウシオ電機	180,800	2,015.50	364,402,400	
6926	岡谷電機産業	11,500	280.00	3,220,000	
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	14,700	560.00	8,232,000	貸付有価証券 6,500株
6928	エノモト	4,200	1,634.00	6,862,800	
6929	日本セラミック	29,000	2,716.00	78,764,000	
6932	遠藤照明	6,800	1,530.00	10,404,000	
6937	古河電池	26,200	1,010.00	26,462,000	貸付有価証券 1,000株
6938	双信電機	6,000	311.00	1,866,000	
6941	山一電機	32,000	2,340.00	74,880,000	
6947	函研	31,000	4,615.00	143,065,000	
6951	日本電子	89,200	6,266.00	558,927,200	
6952	カシオ計算機	257,100	1,285.00	330,373,500	
6954	ファナック	1,735,400	4,296.00	7,455,278,400	貸付有価証券 22,400株
6958	日本シイエムケイ	83,500	612.00	51,102,000	
6961	エンプラス	10,400	7,540.00	78,416,000	
6962	大真空	53,000	807.00	42,771,000	貸付有価証券 1,700株
6963	ローム	658,000	2,510.00	1,651,580,000	
6965	浜松ホトニクス	285,600	5,376.00	1,535,385,600	
6966	三井ハイテック	31,500	8,754.00	275,751,000	貸付有価証券 6,100株
6967	新光電気工業	125,900	5,664.00	713,097,600	
6971	京セラ	2,211,200	2,078.00	4,594,873,600	

6976	太陽誘電	173,300	3,560.00	616,948,000	貸付有価証券 6,700株
6981	村田製作所	3,237,800	2,851.00	9,230,967,800	
6986	双葉電子工業	67,800	508.00	34,442,400	
6989	北陸電気工業	5,600	1,441.00	8,069,600	
6996	ニチコン	93,400	1,306.00	121,980,400	
6997	日本ケミコン	37,900	1,456.00	55,182,400	貸付有価証券 200株
6999	K O A	53,900	1,484.00	79,987,600	
7244	市光工業	64,100	545.00	34,934,500	
7276	小糸製作所	368,700	1,985.00	731,869,500	
7280	ミツバ	66,700	1,598.00	106,586,600	
7735	S C R E E Nホールディングス	121,700	18,670.00	2,272,139,000	貸付有価証券 3,400株
7739	キャノン電子	39,300	2,393.00	94,044,900	
7751	キャノン	1,775,000	4,464.00	7,923,600,000	貸付有価証券 68,100株
7752	リコー	892,300	1,335.50	1,191,666,650	
7965	象印マホービン	96,600	1,432.00	138,331,200	貸付有価証券 600株
7999	M U T O Hホールディングス	1,900	2,363.00	4,489,700	貸付有価証券 300株
8035	東京エレクトロン	753,200	38,720.00	29,163,904,000	
9880	イノテック	23,700	1,989.00	47,139,300	
3116	トヨタ紡織	149,900	2,594.00	388,840,600	
3526	芦森工業	3,000	2,745.00	8,235,000	
5949	ユニプレス	63,900	1,166.00	74,507,400	貸付有価証券 2,500株
6201	豊田自動織機	303,500	15,925.00	4,833,237,500	
6455	モリタホールディングス	62,400	1,638.00	102,211,200	
6584	三櫻工業	54,300	1,128.00	61,250,400	
6902	デンソー	2,936,200	2,910.00	8,544,342,000	
6995	東海理化電機製作所	100,300	2,624.00	263,187,200	
7012	川崎重工業	290,500	4,991.00	1,449,885,500	
7014	名村造船所	88,600	2,047.00	181,364,200	
7102	日本車輛製造	11,700	2,400.00	28,080,000	
7105	三菱ロジスネクスト	56,800	1,803.00	102,410,400	
7122	近畿車輛	2,000	2,501.00	5,002,000	
7201	日産自動車	4,802,700	628.90	3,020,418,030	
7202	いすゞ自動車	1,034,600	2,097.00	2,169,556,200	

7203	トヨタ自動車	19,541,300	3,830.00	74,843,179,000	
7205	日野自動車	535,300	520.50	278,623,650	貸付有価証券 17,600株
7211	三菱自動車工業	1,388,300	496.30	689,013,290	
7212	エフテック	10,500	767.00	8,053,500	貸付有価証券 3,100株
7213	レシップホールディングス	6,500	644.00	4,186,000	
7214	GMB	2,900	1,156.00	3,352,400	貸付有価証券 1,000株
7215	ファルテック	2,700	568.00	1,533,600	
7220	武蔵精密工業	87,000	1,680.00	146,160,000	
7222	日産車体	36,100	1,052.00	37,977,200	貸付有価証券 3,800株
7224	新明和工業	102,500	1,256.00	128,740,000	
7226	極東開発工業	58,800	2,643.00	155,408,400	
7231	トピー工業	28,800	2,990.00	86,112,000	
7236	ティラド	7,900	4,060.00	32,074,000	
7238	曙ブレーキ工業	217,200	144.00	31,276,800	
7239	タチエス	65,700	2,037.00	133,830,900	
7240	NOK	138,300	2,140.50	296,031,150	
7241	フタバ産業	95,400	1,184.00	112,953,600	
7242	カヤバ	34,300	5,110.00	175,273,000	
7245	大同メタル工業	69,600	678.00	47,188,800	
7246	プレス工業	142,200	706.00	100,393,200	
7247	ミクニ	19,000	488.00	9,272,000	
7250	太平洋工業	81,600	1,741.00	142,065,600	
7256	河西工業	21,100	244.00	5,148,400	
7259	アイシン	274,500	6,123.00	1,680,763,500	
7261	マツダ	1,177,200	1,775.00	2,089,530,000	貸付有価証券 6,500株
7266	今仙電機製作所	9,500	647.00	6,146,500	
7267	本田技研工業	8,678,600	1,879.00	16,307,089,400	
7269	スズキ	653,600	6,776.00	4,428,793,600	貸付有価証券 18,200株
7270	SUBARU	1,103,700	3,430.00	3,785,691,000	
7271	安永	6,600	764.00	5,042,400	
7272	ヤマハ発動機	1,538,100	1,376.00	2,116,425,600	貸付有価証券 59,100株
7277	T B K	16,300	392.00	6,389,600	
7278	エクセディ	58,200	3,080.00	179,256,000	

7282	豊田合成	101,900	3,368.00	343,199,200	
7283	愛三工業	58,900	1,713.00	100,895,700	
7284	盟和産業	2,100	1,021.00	2,144,100	
7291	日本プラス	12,300	562.00	6,912,600	
7294	ヨロズ	33,300	1,015.00	33,799,500	
7296	エフ・シー・シー	63,100	2,237.00	141,154,700	
7309	シマノ	143,800	22,345.00	3,213,211,000	
7313	テイ・エス テック	126,700	2,021.50	256,124,050	
7408	ジャムコ	17,200	1,249.00	21,482,800	
4543	テルモ	995,000	5,532.00	5,504,340,000	
5187	クリエートメディック	4,900	963.00	4,718,700	貸付有価証券 300株
6376	日機装	82,900	1,228.00	101,801,200	
7600	日本エム・ディ・エム	28,200	743.00	20,952,600	
7701	島津製作所	472,800	4,336.00	2,050,060,800	
7702	JMS	32,900	538.00	17,700,200	
7709	クボテック	3,600	236.00	849,600	貸付有価証券 1,600株
7715	長野計器	25,900	2,280.00	59,052,000	貸付有価証券 300株
7717	ブイ・テクノロジー	18,700	2,495.00	46,656,500	貸付有価証券 600株
7721	東京計器	27,300	2,580.00	70,434,000	
7723	愛知時計電機	15,400	2,401.00	36,975,400	
7725	インターアクション	21,400	1,253.00	26,814,200	貸付有価証券 700株
7727	オーバル	13,200	537.00	7,088,400	
7729	東京精密	72,800	12,015.00	874,692,000	
7730	マニー	142,400	1,981.50	282,165,600	
7731	ニコン	514,500	1,573.50	809,565,750	
7732	トプコン	173,000	1,763.50	305,085,500	
7733	オリンパス	2,190,600	2,160.50	4,732,791,300	
7734	理研計器	25,200	7,460.00	187,992,000	
7740	タムロン	21,800	6,790.00	148,022,000	
7741	HOYA	700,600	19,075.00	13,363,945,000	
7743	シード	7,500	661.00	4,957,500	
7744	ノーリツ鋼機	33,700	3,165.00	106,660,500	
7745	A&Dホロンホールディングス	51,900	2,751.00	142,776,900	

7747	朝日インテック	433,800	2,742.50	1,189,696,500	貸付有価証券 8,900株
7762	シチズン時計	327,400	1,008.00	330,019,200	
7769	リズム	3,400	4,325.00	14,705,000	貸付有価証券 300株
7775	大研医器	13,000	579.00	7,527,000	
7780	メニコン	122,400	1,585.00	194,004,000	
7782	シンシア	1,400	508.00	711,200	
7979	松風	16,100	2,997.00	48,251,700	
8050	セイコーグループ	49,600	3,915.00	194,184,000	
8086	ニプロ	296,600	1,198.00	355,326,800	
7795	KYORITSU	22,500	187.00	4,207,500	
7811	中本パックス	4,800	1,640.00	7,872,000	貸付有価証券 1,100株
7816	スノーピーク	50,800	1,247.00	63,347,600	
7817	パラマウントベッドホールディングス	74,000	2,636.00	195,064,000	
7818	トランザクション	23,500	2,289.00	53,791,500	
7819	粧美堂	4,100	586.00	2,402,600	
7820	ニホンフラッシュ	33,400	976.00	32,598,400	
7821	前田工織	30,100	3,695.00	111,219,500	貸付有価証券 6,100株
7822	永大産業	17,900	306.00	5,477,400	
7823	アートネイチャー	32,000	781.00	24,992,000	
7826	フルヤ金属	8,400	10,930.00	91,812,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	975,000	2,853.00	2,781,675,000	
7833	アイフィスジャパン	4,200	636.00	2,671,200	
7839	SHOEI	80,400	2,329.00	187,251,600	
7840	フランスベッドホールディングス	46,000	1,305.00	60,030,000	
7846	パイロットコーポレーション	50,100	3,879.00	194,337,900	
7856	萩原工業	23,800	1,585.00	37,723,000	
7864	フジシールインターナショナル	72,100	1,939.00	139,801,900	
7867	タカラトミー	162,000	2,875.00	465,750,000	
7868	広済堂ホールディングス	91,600	640.00	58,624,000	
7872	エステールホールディングス	3,600	697.00	2,509,200	
7885	タカノ	5,600	1,100.00	6,160,000	
7893	プロネクサス	36,900	1,249.00	46,088,100	
7897	ホクシン	11,600	126.00	1,461,600	貸付有価証券 4,600株

7898	ウッドワン	5,100	1,057.00	5,390,700	貸付有価証券 300株
7911	TOPPANホールディングス	437,500	3,701.00	1,619,187,500	貸付有価証券 2,800株
7912	大日本印刷	388,900	4,602.00	1,789,717,800	
7914	共同印刷	10,000	3,450.00	34,500,000	
7915	N I S S H A	60,900	1,449.00	88,244,100	
7916	光村印刷	1,100	1,660.00	1,826,000	
7921	TAKARA & COMPANY	21,000	2,734.00	57,414,000	
7936	アシックス	303,200	7,072.00	2,144,230,400	貸付有価証券 11,600株
7937	ツツミ	8,300	2,129.00	17,670,700	
7944	ローランド	26,200	4,620.00	121,044,000	貸付有価証券 4,400株
7949	小松ウオール工業	14,500	3,290.00	47,705,000	
7951	ヤマハ	224,300	3,219.00	722,021,700	貸付有価証券 1,700株
7952	河合楽器製作所	10,800	3,665.00	39,582,000	
7955	クリナップ	34,900	782.00	27,291,800	
7956	ビジョン	226,700	1,483.50	336,309,450	
7962	キングジム	31,400	892.00	28,008,800	
7966	リンテック	71,400	3,190.00	227,766,000	
7972	イトーキ	72,900	1,710.00	124,659,000	貸付有価証券 300株
7974	任天堂	2,246,800	8,299.00	18,646,193,200	
7976	三菱鉛筆	50,500	2,520.00	127,260,000	
7981	タカラスタンダード	74,900	1,905.00	142,684,500	
7984	コクヨ	145,600	2,538.00	369,532,800	
7987	ナカバヤシ	38,300	552.00	21,141,600	
7990	グローブライド	31,900	2,053.00	65,490,700	貸付有価証券 400株
7994	オカムラ	107,100	2,255.00	241,510,500	
8022	美津濃	35,400	6,340.00	224,436,000	
9501	東京電力ホールディングス	3,208,000	867.70	2,783,581,600	貸付有価証券 123,000株
9502	中部電力	1,311,400	2,002.00	2,625,422,800	
9503	関西電力	1,374,200	2,135.00	2,933,917,000	
9504	中国電力	618,300	1,157.50	715,682,250	
9505	北陸電力	363,900	796.30	289,773,570	貸付有価証券 27,000株
9506	東北電力	937,000	1,205.00	1,129,085,000	

9507	四国電力	331,400	1,207.00	399,999,800	
9508	九州電力	820,400	1,382.00	1,133,792,800	
9509	北海道電力	343,800	833.00	286,385,400	貸付有価証券 13,200株
9511	沖縄電力	90,900	1,146.00	104,171,400	
9513	電源開発	292,300	2,551.00	745,657,300	
9514	エフオン	25,900	433.00	11,214,700	
9517	イーレックス	63,300	710.00	44,943,000	貸付有価証券 8,800株
9519	レノバ	94,900	1,263.00	119,858,700	貸付有価証券 7,400株
9531	東京瓦斯	752,400	3,521.00	2,649,200,400	
9532	大阪瓦斯	720,900	3,444.00	2,482,779,600	
9533	東邦瓦斯	154,100	3,298.00	508,221,800	
9534	北海道瓦斯	21,200	2,515.00	53,318,000	
9535	広島ガス	75,200	385.00	28,952,000	
9536	西部ガスホールディングス	37,100	1,920.00	71,232,000	
9543	静岡ガス	71,000	955.00	67,805,000	貸付有価証券 2,800株
9551	メタウォーター	42,600	2,263.00	96,403,800	
2384	SBSホールディングス	31,700	2,520.00	79,884,000	
9001	東武鉄道	390,900	3,975.00	1,553,827,500	貸付有価証券 500株
9003	相鉄ホールディングス	127,400	2,856.00	363,854,400	
9005	東急	997,900	2,079.50	2,075,133,050	
9006	京浜急行電鉄	440,400	1,420.00	625,368,000	
9007	小田急電鉄	588,500	2,222.00	1,307,647,000	
9008	京王電鉄	171,100	4,310.00	737,441,000	
9009	京成電鉄	229,500	6,359.00	1,459,390,500	
9010	富士急行	43,800	4,030.00	176,514,000	
9020	東日本旅客鉄道	653,800	9,099.00	5,948,926,200	貸付有価証券 23,200株
9021	西日本旅客鉄道	422,100	6,559.00	2,768,553,900	
9022	東海旅客鉄道	1,370,800	3,980.00	5,455,784,000	貸付有価証券 53,000株
9024	西武ホールディングス	430,500	2,396.00	1,031,478,000	貸付有価証券 16,600株
9025	鴻池運輸	60,600	2,114.00	128,108,400	貸付有価証券 300株
9031	西日本鉄道	95,100	2,545.50	242,077,050	
9037	ハマキョウレックス	30,400	3,815.00	115,976,000	

9039	サカイ引越センター	39,400	2,592.00	102,124,800	
9041	近鉄グループホールディングス	355,200	4,649.00	1,651,324,800	
9042	阪急阪神ホールディングス	473,800	4,516.00	2,139,680,800	
9044	南海電気鉄道	158,500	3,193.00	506,090,500	
9045	京阪ホールディングス	195,800	3,452.00	675,901,600	
9046	神戸電鉄	9,700	2,906.00	28,188,200	
9048	名古屋鉄道	366,500	2,209.50	809,781,750	
9052	山陽電気鉄道	26,700	2,152.00	57,458,400	
9055	アルプス物流	28,300	2,764.00	78,221,200	
9064	ヤマトホールディングス	454,900	2,232.50	1,015,564,250	
9065	山九	90,400	5,424.00	490,329,600	
9067	丸運	7,700	291.00	2,240,700	
9068	丸全昭和運輸	22,000	4,695.00	103,290,000	
9069	センコーグループホールディングス	188,100	1,148.00	215,938,800	
9070	トナミホールディングス	7,800	4,575.00	35,685,000	
9072	ニッコンホールディングス	113,700	3,053.00	347,126,100	
9074	日本石油輸送	1,500	2,935.00	4,402,500	
9075	福山通運	40,500	3,780.00	153,090,000	
9076	セイノーホールディングス	199,800	2,177.00	434,964,600	貸付有価証券 7,700株
9078	エスライングループ本社	4,300	927.00	3,986,100	
9081	神奈川中央交通	10,100	3,225.00	32,572,500	
9090	AZ-COM丸和ホールディングス	90,800	1,391.00	126,302,800	
9099	C&Fロジホールディングス	34,200	3,045.00	104,139,000	
9142	九州旅客鉄道	251,200	3,601.00	904,571,200	
9143	SGホールディングス	596,600	1,995.00	1,190,217,000	
9147	NIPPON EXPRESSホール ディン	124,400	7,721.00	960,492,400	貸付有価証券 4,700株
9101	日本郵船	1,018,400	4,183.00	4,259,967,200	
9104	商船三井	771,100	4,715.00	3,635,736,500	
9107	川崎汽船	285,400	6,280.00	1,792,312,000	貸付有価証券 10,300株
9110	NSユニテッド海運	19,100	5,090.00	97,219,000	
9115	明海グループ	16,300	781.00	12,730,300	貸付有価証券 1,000株
9119	飯野海運	130,400	1,282.00	167,172,800	貸付有価証券 5,100株
9130	共栄タンカー	2,800	1,101.00	3,082,800	貸付有価証券 800株

9308	乾汽船	41,600	1,075.00	44,720,000	貸付有価証券 4,300株
9201	日本航空	872,700	2,906.50	2,536,502,550	
9202	A N Aホールディングス	966,800	3,219.00	3,112,129,200	
9232	パスコ	2,800	1,896.00	5,308,800	
9058	トランコム	10,300	6,050.00	62,315,000	
9066	日新	27,000	2,845.00	76,815,000	
9301	三菱倉庫	87,300	5,004.00	436,849,200	
9302	三井倉庫ホールディングス	33,200	4,680.00	155,376,000	
9303	住友倉庫	95,800	2,599.00	248,984,200	
9304	澁澤倉庫	16,200	3,050.00	49,410,000	
9306	東陽倉庫	4,000	1,583.00	6,332,000	
9310	日本トランスシティ	71,500	681.00	48,691,500	
9312	ケイヒン	2,700	2,033.00	5,489,100	
9319	中央倉庫	19,000	1,198.00	22,762,000	
9322	川西倉庫	2,700	1,267.00	3,420,900	貸付有価証券 200株
9324	安田倉庫	24,200	1,239.00	29,983,800	
9325	ファイズホールディングス	2,100	1,174.00	2,465,400	
9351	東洋埠頭	4,400	1,420.00	6,248,000	
9364	上組	164,100	3,409.00	559,416,900	
9366	サンリツ	3,600	866.00	3,117,600	
9368	キムラユニティー	7,100	1,711.00	12,148,100	
9369	キューソー流通システム	16,200	1,067.00	17,285,400	
9380	東海運	8,800	311.00	2,736,800	
9381	エーアイテイー	22,300	1,786.00	39,827,800	貸付有価証券 3,900株
9384	内外トランスライン	14,200	2,428.00	34,477,600	貸付有価証券 2,000株
9386	日本コンセプト	12,900	1,822.00	23,503,800	
1973	N E C ネットエスアイ	139,100	2,623.00	364,859,300	
2307	クロスキャット	22,600	1,751.00	39,572,600	
2317	システナ	540,000	274.00	147,960,000	
2326	デジタルアーツ	22,600	4,290.00	96,954,000	
2327	日鉄ソリューションズ	60,900	5,070.00	308,763,000	
2335	キューブシステム	18,900	1,111.00	20,997,900	
2359	コア	15,800	1,930.00	30,494,000	
2477	手間いらず	6,000	3,345.00	20,070,000	貸付有価証券

					100株
3031	ラクーンホールディングス	26,600	568.00	15,108,800	
3040	ソリトンシステムズ	18,400	1,264.00	23,257,600	
3371	ソフトクリエイティブホールディングス	29,300	1,922.00	56,314,600	
3626	T I S	390,400	3,322.00	1,296,908,800	
3627	テクミラホールディングス	6,900	465.00	3,208,500	貸付有価証券 2,400株
3632	グリーン	119,600	486.00	58,125,600	貸付有価証券 25,100株
3633	GMOペパボ	4,400	1,380.00	6,072,000	貸付有価証券 500株
3635	コーエーテクモホールディングス	223,600	1,690.00	377,884,000	
3636	三菱総合研究所	17,500	5,030.00	88,025,000	
3639	ボルテージ	4,400	259.00	1,139,600	貸付有価証券 500株
3640	電算	1,800	1,510.00	2,718,000	貸付有価証券 300株
3648	A G S	6,200	889.00	5,511,800	
3649	ファインデックス	28,300	1,110.00	31,413,000	
3655	ブレインパッド	29,700	1,451.00	43,094,700	貸付有価証券 1,000株
3656	K L a b	65,600	378.00	24,796,800	貸付有価証券 8,400株
3657	ポールトゥウィンホールディングス	60,900	499.00	30,389,100	
3659	ネクソン	799,100	2,557.50	2,043,698,250	貸付有価証券 30,600株
3660	アイスタイル	116,500	516.00	60,114,000	
3661	エムアップホールディングス	43,700	1,242.00	54,275,400	貸付有価証券 100株
3662	エイチーム	21,100	630.00	13,293,000	
3665	エニグモ	45,400	407.00	18,477,800	貸付有価証券 200株
3666	テクノスジャパン	13,100	626.00	8,200,600	貸付有価証券 700株
3667	e n i s h	11,900	271.00	3,224,900	貸付有価証券 1,900株
3668	コロブラ	138,500	606.00	83,931,000	貸付有価証券 14,200株
3672	オルトプラス	12,100	135.00	1,633,500	貸付有価証券 2,400株
3673	ブロードリーフ	169,400	561.00	95,033,400	
3675	クロス・マーケティンググループ	6,400	549.00	3,513,600	貸付有価証券 900株
3676	デジタルハーツホールディングス	22,300	955.00	21,296,500	貸付有価証券 100株

3678	メディアドゥ	16,100	1,470.00	23,667,000	
3679	じげん	104,100	615.00	64,021,500	
3681	ブイキューブ	42,800	266.00	11,384,800	
3682	エンカレッジ・テクノロジー	3,600	645.00	2,322,000	
3683	サイバーリンクス	5,100	885.00	4,513,500	貸付有価証券 300株
3686	ディー・エル・イー	10,700	181.00	1,936,700	貸付有価証券 3,100株
3687	フィックスターズ	40,300	2,211.00	89,103,300	貸付有価証券 1,500株
3688	CARTA HOLDINGS	16,700	1,589.00	26,536,300	
3694	オプティム	36,700	1,019.00	37,397,300	貸付有価証券 1,100株
3696	セレス	14,400	1,772.00	25,516,800	
3697	SHIFT	23,700	24,015.00	569,155,500	
3738	ティーガイア	37,300	2,081.00	77,621,300	
3741	セック	4,400	4,910.00	21,604,000	
3762	テクマトリックス	65,200	1,882.00	122,706,400	
3763	プロシップ	17,100	1,529.00	26,145,900	
3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	92,900	2,358.50	219,104,650	貸付有価証券 3,600株
3769	GMOペイメントゲートウェイ	71,300	9,851.00	702,376,300	貸付有価証券 2,800株
3770	ザッパラス	3,600	489.00	1,760,400	
3771	システムリサーチ	12,200	3,380.00	41,236,000	
3774	インターネットイニシアティブ	170,600	2,831.50	483,053,900	
3778	さくらインターネット	40,100	6,570.00	263,457,000	貸付有価証券 6,700株
3788	GMOグローバルサイン・ホールディングス	10,900	3,105.00	33,844,500	
3817	SRAホールディングス	18,300	4,015.00	73,474,500	
3826	システムインテグレータ	4,400	409.00	1,799,600	貸付有価証券 1,300株
3834	朝日ネット	38,300	643.00	24,626,900	
3835	eBASE	50,200	740.00	37,148,000	貸付有価証券 5,200株
3836	アバントグループ	45,100	1,299.00	58,584,900	
3837	アドソル日進	15,000	1,679.00	25,185,000	
3839	ODKソリューションズ	2,800	678.00	1,898,400	
3843	フリービット	15,600	1,426.00	22,245,600	
3844	コムチュア	51,500	1,992.00	102,588,000	

3853	アステリア	27,900	688.00	19,195,200	貸付有価証券 2,600株
3854	アイル	16,700	3,020.00	50,434,000	
3901	マークラインズ	19,300	3,190.00	61,567,000	
3902	メディカル・データ・ビジョン	42,600	584.00	24,878,400	
3903	g u m i	57,900	420.00	24,318,000	貸付有価証券 6,400株
3909	ショーケース	3,500	369.00	1,291,500	
3912	モバイルファクトリー	3,200	742.00	2,374,400	貸付有価証券 1,000株
3915	テラスカイ	15,400	1,468.00	22,607,200	貸付有価証券 3,400株
3916	デジタル・インフォメーション・テクノロジー	18,600	1,808.00	33,628,800	
3918	P C Iホールディングス	5,800	961.00	5,573,800	
3920	アイビーシー	2,300	442.00	1,016,600	
3921	ネオジャパン	11,900	1,262.00	15,017,800	
3922	P R T I M E S	7,200	2,054.00	14,788,800	
3923	ラクス	168,800	2,063.50	348,318,800	
3924	ランドコンピュータ	7,300	886.00	6,467,800	
3925	ダブルスタンダード	10,800	1,916.00	20,692,800	
3926	オープンドア	20,800	840.00	17,472,000	貸付有価証券 3,100株
3928	マイネット	4,900	349.00	1,710,100	貸付有価証券 1,400株
3932	アカツキ	17,000	2,572.00	43,724,000	
3934	ベネフィットジャパン	900	1,269.00	1,142,100	貸付有価証券 300株
3937	U b i c o mホールディングス	11,100	1,264.00	14,030,400	
3939	カナミックネットワーク	38,400	474.00	18,201,600	
3940	ノムラシステムコーポレーション	14,700	118.00	1,734,600	
3962	チェンジホールディングス	77,700	1,266.00	98,368,200	貸付有価証券 5,400株
3963	シンクロ・フード	8,500	621.00	5,278,500	
3964	オークネット	13,200	2,376.00	31,363,200	
3965	キャピタル・アセット・プランニング	2,800	780.00	2,184,000	貸付有価証券 300株
3968	セグエグループ	12,900	595.00	7,675,500	貸付有価証券 1,800株
3969	エイトレッド	2,200	1,457.00	3,205,400	
3978	マクロミル	70,000	769.00	53,830,000	
3981	ビーグリー	2,700	1,139.00	3,075,300	

3983	オロ	12,900	2,720.00	35,088,000	
3984	ユーザーローカル	15,100	2,343.00	35,379,300	貸付有価証券 1,400株
3985	テモナ	3,000	236.00	708,000	貸付有価証券 600株
3992	ニーズウェル	8,300	982.00	8,150,600	
3994	マネーフォワード	79,600	6,505.00	517,798,000	貸付有価証券 3,000株
3996	サインポスト	5,400	647.00	3,493,800	貸付有価証券 700株
4053	Sun Asterisk	25,300	935.00	23,655,500	貸付有価証券 1,200株
4071	プラスアルファ・コンサルティング	21,100	2,347.00	49,521,700	
4072	電算システムホールディングス	15,800	2,675.00	42,265,000	貸付有価証券 600株
4180	Appier Group	122,100	1,605.00	195,970,500	貸付有価証券 600株
4194	ビジョナル	27,400	9,530.00	261,122,000	
4284	ソルクシーズ	12,300	342.00	4,206,600	貸付有価証券 3,800株
4295	フェイス	4,300	465.00	1,999,500	貸付有価証券 1,500株
4298	プロトコーポレーション	39,100	1,418.00	55,443,800	
4299	ハイマックス	11,200	1,495.00	16,744,000	
4307	野村総合研究所	790,700	4,196.00	3,317,777,200	
4320	CEホールディングス	7,700	549.00	4,227,300	
4323	日本システム技術	13,200	3,835.00	50,622,000	
4326	インテージホールディングス	40,400	1,610.00	65,044,000	
4333	東邦システムサイエンス	13,300	1,266.00	16,837,800	貸付有価証券 400株
4344	ソースネクスト	163,300	246.00	40,171,800	貸付有価証券 20,400株
4348	インフォコム	46,000	2,750.00	126,500,000	
4373	シンプレクス・ホールディングス	54,000	2,835.00	153,090,000	
4382	HEROZ	14,000	1,714.00	23,996,000	貸付有価証券 900株
4384	ラクスル	86,000	1,140.00	98,040,000	貸付有価証券 3,200株
4385	メルカリ	173,700	1,962.00	340,799,400	貸付有価証券 27,600株
4390	I P S	10,300	2,460.00	25,338,000	貸付有価証券 1,100株
4392	F I G	17,500	353.00	6,177,500	貸付有価証券 900株
4396	システムサポート	13,800	2,167.00	29,904,600	

4420	イーソル	25,700	826.00	21,228,200	貸付有価証券 2,400株
4430	東海ソフト	2,200	1,255.00	2,761,000	
4432	ウイングアーク1st	37,100	3,050.00	113,155,000	
4433	ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	9,500	1,136.00	10,792,000	
4434	サーバーワークス	7,300	3,630.00	26,499,000	貸付有価証券 500株
4439	東名	1,200	2,394.00	2,872,800	貸付有価証券 500株
4440	ヴィッツ	1,400	779.00	1,090,600	貸付有価証券 200株
4441	トビラシステムズ	3,900	806.00	3,143,400	
4443	S a n s a n	117,100	1,756.00	205,627,600	貸付有価証券 4,500株
4446	L i n k - Uグループ	3,000	656.00	1,968,000	貸付有価証券 300株
4449	ギフトィ	31,300	1,338.00	41,879,400	貸付有価証券 4,000株
4480	メドレー	47,900	4,710.00	225,609,000	貸付有価証券 1,800株
4481	ベース	12,500	3,485.00	43,562,500	貸付有価証券 1,600株
4483	J M D C	60,900	3,582.00	218,143,800	貸付有価証券 9,300株
4662	フォーカスシステムズ	23,900	1,310.00	31,309,000	
4674	クレスコ	29,300	2,157.00	63,200,100	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	342,800	1,859.50	637,436,600	
4684	オービック	119,300	22,790.00	2,718,847,000	
4686	ジャストシステム	51,300	2,671.00	137,022,300	貸付有価証券 200株
4687	T D Cソフト	33,400	2,285.00	76,319,000	
4689	L I N Eヤフー	5,081,400	391.30	1,988,351,820	
4704	トレンドマイクロ	168,700	7,612.00	1,284,144,400	貸付有価証券 6,500株
4709	I Dホールディングス	24,000	1,514.00	36,336,000	
4716	日本オラクル	68,300	11,405.00	778,961,500	
4719	アルファシステムズ	9,400	3,275.00	30,785,000	
4722	フューチャー	76,100	1,686.00	128,304,600	
4725	C A C H o l d i n g s	19,100	1,871.00	35,736,100	
4726	S Bテクノロジー	15,100	2,098.00	31,679,800	
4728	トーセ	4,200	709.00	2,977,800	貸付有価証券 700株

4733	オービックビジネスコンサルタント	50,200	7,099.00	356,369,800	
4743	アイティフォー	45,700	1,351.00	61,740,700	
4746	東計電算	10,000	3,560.00	35,600,000	
4762	エックスネット	2,000	1,216.00	2,432,000	貸付有価証券 100株
4768	大塚商会	177,000	6,601.00	1,168,377,000	
4776	サイボウズ	49,100	1,753.00	86,072,300	貸付有価証券 1,900株
4812	電通総研	43,400	4,930.00	213,962,000	
4813	ACCESS	37,100	1,685.00	62,513,500	貸付有価証券 4,100株
4819	デジタルガレージ	57,000	3,285.00	187,245,000	
4820	EMシステムズ	59,500	720.00	42,840,000	
4825	ウェザーニューズ	11,000	5,080.00	55,880,000	
4826	C I J	59,300	1,103.00	65,407,900	
4828	ビジネスエンジニアリング	6,700	3,850.00	25,795,000	
4829	日本エンタープライズ	15,600	131.00	2,043,600	
4839	WOWOW	26,900	1,151.00	30,961,900	
4845	スカラ	33,100	726.00	24,030,600	
4847	インテリジェント ウェイブ	8,000	1,151.00	9,208,000	
5032	ANYCOLOR	37,800	2,650.00	100,170,000	貸付有価証券 100株
6879	IMAGICA GROUP	35,700	677.00	24,168,900	
7518	ネットワンシステムズ	144,100	2,771.50	399,373,150	
7527	システムソフト	124,200	60.00	7,452,000	
7595	アルゴグラフィックス	32,700	4,340.00	141,918,000	
7844	マーベラス	58,000	727.00	42,166,000	貸付有価証券 2,300株
7860	エイベックス	60,800	1,303.00	79,222,400	
8056	B I P R O G Y	116,800	4,613.00	538,798,400	
8157	都築電気	18,800	2,414.00	45,383,200	
9401	T B Sホールディングス	179,500	4,170.00	748,515,000	
9404	日本テレビホールディングス	316,000	2,224.00	702,784,000	
9405	朝日放送グループホールディングス	33,400	675.00	22,545,000	貸付有価証券 1,300株
9409	テレビ朝日ホールディングス	86,700	2,190.00	189,873,000	
9412	スカパー J S A Tホールディングス	277,200	1,052.00	291,614,400	
9413	テレビ東京ホールディングス	25,700	3,080.00	79,156,000	
9414	日本BS放送	5,400	908.00	4,903,200	

9416	ビジョン	53,800	1,192.00	64,129,600	
9417	スマートバリュー	3,600	415.00	1,494,000	貸付有価証券 1,400株
9418	USEN-NEXT HOLDING S	40,000	5,210.00	208,400,000	
9419	ワイヤレスゲート	6,600	215.00	1,419,000	貸付有価証券 2,400株
9424	日本通信	351,400	206.00	72,388,400	
9428	クロップス	2,000	1,102.00	2,204,000	
9432	日本電信電話	106,170,200	183.00	19,429,146,600	
9433	KDDI	2,758,100	4,514.00	12,450,063,400	
9434	ソフトバンク	5,745,200	2,027.50	11,648,393,000	
9435	光通信	36,000	27,770.00	999,720,000	
9438	エムティーアイ	24,500	751.00	18,399,500	貸付有価証券 1,000株
9449	GMOインターネットグループ	131,900	2,769.50	365,297,050	
9450	ファイバーゲート	19,200	1,120.00	21,504,000	
9466	アイドママーケティングコミュニケー ション	3,500	236.00	826,000	
9468	KADOKAWA	188,700	2,695.00	508,546,500	
9470	学研ホールディングス	59,400	940.00	55,836,000	
9474	ゼンリン	61,000	872.00	53,192,000	
9475	昭文社ホールディングス	6,500	393.00	2,554,500	貸付有価証券 2,000株
9479	インプレスホールディングス	13,900	171.00	2,376,900	貸付有価証券 3,600株
9600	アイネット	21,600	2,306.00	49,809,600	
9601	松竹	18,500	10,100.00	186,850,000	貸付有価証券 2,900株
9602	東宝	198,600	5,117.00	1,016,236,200	貸付有価証券 8,600株
9605	東映	11,800	19,620.00	231,516,000	
9613	NTTデータグループ	933,300	2,461.50	2,297,317,950	貸付有価証券 16,900株
9629	ピー・シー・エー	20,500	1,757.00	36,018,500	
9658	ビジネスブレイン太田昭和	14,000	2,177.00	30,478,000	
9682	DTS	75,200	4,025.00	302,680,000	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディ ングス	163,100	6,021.00	982,025,100	
9692	シーイーシー	45,000	1,551.00	69,795,000	
9697	カプコン	319,200	6,021.00	1,921,903,200	
9702	アイ・エス・ビー	18,200	1,375.00	25,025,000	

9717	ジャステック	21,900	1,441.00	31,557,900	
9719	S C S K	249,800	2,881.00	719,673,800	貸付有価証券 1,500株
9739	N S W	15,900	3,165.00	50,323,500	
9742	アイネス	27,800	1,569.00	43,618,200	
9746	T K C	56,600	3,705.00	209,703,000	
9749	富士ソフト	71,800	6,060.00	435,108,000	
9759	N S D	127,400	2,992.00	381,180,800	
9766	コナミグループ	133,700	10,240.00	1,369,088,000	貸付有価証券 5,900株
9790	福井コンピュータホールディングス	22,000	2,653.00	58,366,000	
9889	J B C Cホールディングス	23,700	3,370.00	79,869,000	
9928	ミロク情報サービス	32,400	1,803.00	58,417,200	
9984	ソフトバンクグループ	1,760,700	9,182.00	16,166,747,400	
2676	高千穂交易	11,900	4,015.00	47,778,500	貸付有価証券 900株
2689	オルパヘルスケアホールディングス	2,400	1,993.00	4,783,200	貸付有価証券 500株
2692	伊藤忠食品	8,500	7,450.00	63,325,000	
2715	エレマテック	33,800	1,954.00	66,045,200	
2733	あらた	57,600	3,215.00	185,184,000	
2737	トーメンデバイス	5,400	6,760.00	36,504,000	
2760	東京エレクトロン デバイス	37,500	6,570.00	246,375,000	
2767	円谷フィールズホールディングス	64,700	1,718.00	111,154,600	貸付有価証券 6,800株
2768	双日	419,200	4,040.00	1,693,568,000	
2784	アルフレッサ ホールディングス	377,900	2,275.00	859,722,500	
2874	横浜冷凍	102,500	1,065.00	109,162,500	
3004	神栄	2,300	1,711.00	3,935,300	
3023	ラサ商事	15,300	2,032.00	31,089,600	
3036	アルコニックス	49,600	1,478.00	73,308,800	
3038	神戸物産	291,300	3,688.00	1,074,314,400	貸付有価証券 7,100株
3054	ハイパー	3,100	307.00	951,700	貸付有価証券 600株
3076	あい ホールディングス	60,300	2,400.00	144,720,000	
3079	ディーブイエックス	4,300	1,059.00	4,553,700	
3107	ダイワボウホールディングス	166,700	2,548.00	424,751,600	
3132	マクニカホールディングス	89,100	7,376.00	657,201,600	
3139	ラクト・ジャパン	14,600	2,358.00	34,426,800	

3150	グリムス	15,800	2,184.00	34,507,200	
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	57,000	1,258.00	71,706,000	
3153	八洲電機	30,400	1,623.00	49,339,200	
3154	メディアスホールディングス	21,900	768.00	16,819,200	貸付有価証券 2,500株
3156	レスターホールディングス	32,000	3,020.00	96,640,000	
3157	ジオリーブグループ	3,300	1,479.00	4,880,700	
3160	大光	6,800	656.00	4,460,800	貸付有価証券 2,300株
3166	OCHIホールディングス	3,500	1,714.00	5,999,000	貸付有価証券 500株
3167	TOKAIホールディングス	204,500	1,006.00	205,727,000	
3168	黒谷	4,300	612.00	2,631,600	貸付有価証券 1,000株
3173	Cominix	2,900	955.00	2,769,500	
3176	三洋貿易	42,500	1,338.00	56,865,000	貸付有価証券 1,700株
3180	ビューティガレージ	11,900	2,308.00	27,465,200	
3183	ウイン・パートナーズ	24,400	1,253.00	30,573,200	
3321	ミタチ産業	4,000	1,221.00	4,884,000	
3360	シップヘルスケアホールディングス	135,300	2,204.00	298,201,200	
3388	明治電機工業	14,000	1,542.00	21,588,000	
3392	デリカフーズホールディングス	6,600	591.00	3,900,600	
3393	スターティアホールディングス	3,600	1,522.00	5,479,200	
3543	コメダホールディングス	92,300	2,738.00	252,717,400	貸付有価証券 200株
3559	ピーバンドットコム	1,900	407.00	773,300	貸付有価証券 200株
3565	アセンテック	14,400	618.00	8,899,200	貸付有価証券 600株
5009	富士興産	4,200	1,990.00	8,358,000	貸付有価証券 1,400株
6973	協栄産業	1,600	2,905.00	4,648,000	
7128	フルサト・マルカホールディングス	33,500	2,201.00	73,733,500	貸付有価証券 1,600株
7130	ヤマエグループホールディングス	24,900	2,731.00	68,001,900	貸付有価証券 3,200株
7414	小野建	37,000	1,907.00	70,559,000	
7417	南陽	3,200	2,644.00	8,460,800	
7420	佐鳥電機	21,000	2,454.00	51,534,000	
7427	エコートレーディング	3,000	1,238.00	3,714,000	貸付有価証券 1,000株

7433	伯東	21,600	5,870.00	126,792,000	
7438	コンドーテック	28,900	1,275.00	36,847,500	
7442	中山福	8,400	382.00	3,208,800	
7447	ナガイレーベン	47,600	2,412.00	114,811,200	貸付有価証券 5,300株
7451	三菱食品	34,800	5,490.00	191,052,000	
7456	松田産業	28,600	2,470.00	70,642,000	
7458	第一興商	145,700	1,976.50	287,976,050	
7459	メディパルホールディングス	382,900	2,325.50	890,433,950	
7466	S P K	16,700	2,040.00	34,068,000	
7467	萩原電気ホールディングス	16,200	4,465.00	72,333,000	
7476	アズワン	59,000	5,355.00	315,945,000	
7480	スズデン	13,200	2,194.00	28,960,800	貸付有価証券 600株
7481	尾家産業	3,700	1,761.00	6,515,700	
7482	シモジマ	25,200	1,428.00	35,985,600	
7483	ドウシシャ	34,800	2,138.00	74,402,400	
7487	小津産業	3,600	1,742.00	6,271,200	
7504	高速	22,300	2,350.00	52,405,000	
7510	たけびし	14,400	2,077.00	29,908,800	
7525	リックス	7,600	4,080.00	31,008,000	
7537	丸文	33,600	1,540.00	51,744,000	貸付有価証券 300株
7552	ハピネット	32,000	3,105.00	99,360,000	
7570	橋本総業ホールディングス	14,900	1,415.00	21,083,500	
7575	日本ライフライン	110,400	1,269.00	140,097,600	
7590	タカショー	32,800	536.00	17,580,800	貸付有価証券 3,800株
7599	I D O M	99,600	1,049.00	104,480,400	貸付有価証券 4,400株
7607	進和	23,000	2,655.00	61,065,000	貸付有価証券 900株
7608	エスケイジャパン	3,800	737.00	2,800,600	
7609	ダイトロン	14,800	3,355.00	49,654,000	
7613	シークス	53,700	1,726.00	92,686,200	
7619	田中商事	4,400	943.00	4,149,200	
7628	オーハシテクニカ	19,700	1,690.00	33,293,000	
7637	白銅	10,600	2,619.00	27,761,400	
7673	ダイコー通産	1,600	1,311.00	2,097,600	

8001	伊藤忠商事	2,531,100	6,542.00	16,558,456,200	貸付有価証券 24,500株
8002	丸紅	3,139,300	2,665.00	8,366,234,500	
8007	高島	9,600	1,333.00	12,796,800	
8012	長瀬産業	172,600	2,607.00	449,968,200	
8014	蝶理	23,600	3,400.00	80,240,000	
8015	豊田通商	329,800	10,420.00	3,436,516,000	
8018	三共生興	52,200	778.00	40,611,600	
8020	兼松	157,400	2,568.00	404,203,200	貸付有価証券 200株
8025	ツカモトコーポレーション	2,200	1,355.00	2,981,000	貸付有価証券 100株
8031	三井物産	2,837,000	7,122.00	20,205,114,000	
8032	日本紙パルプ商事	18,000	5,300.00	95,400,000	
8037	カメイ	40,000	2,034.00	81,360,000	
8038	東都水産	800	7,180.00	5,744,000	貸付有価証券 100株
8041	OUGホールディングス	2,300	2,614.00	6,012,200	
8043	スターゼン	26,000	2,914.00	75,764,000	
8051	山善	114,200	1,377.00	157,253,400	
8052	椿本興業	7,800	7,220.00	56,316,000	貸付有価証券 200株
8053	住友商事	2,278,800	3,695.00	8,420,166,000	
8057	内田洋行	15,300	6,930.00	106,029,000	
8058	三菱商事	7,230,100	3,549.00	25,659,624,900	
8059	第一実業	35,400	2,136.00	75,614,400	
8060	キャノンマーケティングジャパン	87,200	4,470.00	389,784,000	
8061	西華産業	14,800	3,425.00	50,690,000	
8065	佐藤商事	26,100	1,815.00	47,371,500	
8068	菱洋エレクトロ	35,700	3,995.00	142,621,500	
8070	東京産業	34,300	727.00	24,936,100	貸付有価証券 200株
8074	ユアサ商事	29,400	5,150.00	151,410,000	
8075	神鋼商事	9,400	7,330.00	68,902,000	
8077	トルク	8,500	266.00	2,261,000	貸付有価証券 3,100株
8078	阪和興業	67,600	5,880.00	397,488,000	
8079	正栄食品工業	25,000	4,680.00	117,000,000	
8081	カナデン	28,300	1,536.00	43,468,800	
8084	RYODEN	30,400	2,723.00	82,779,200	

8088	岩谷産業	85,700	7,837.00	671,630,900	貸付有価証券 400株
8089	ナイス	5,000	1,750.00	8,750,000	
8091	ニチモウ	4,000	2,386.00	9,544,000	
8093	極東貿易	22,500	2,215.00	49,837,500	貸付有価証券 900株
8095	アステナホールディングス	70,700	481.00	34,006,700	貸付有価証券 2,800株
8097	三愛オブリ	90,500	2,124.00	192,222,000	
8098	稲畑産業	74,400	3,220.00	239,568,000	貸付有価証券 800株
8101	G S I クレオス	20,200	2,440.00	49,288,000	
8103	明和産業	44,500	688.00	30,616,000	
8104	クワザワホールディングス	5,700	883.00	5,033,100	
8125	ワキタ	62,300	1,570.00	97,811,000	
8129	東邦ホールディングス	104,200	3,535.00	368,347,000	
8130	サンゲツ	86,700	3,420.00	296,514,000	
8131	ミツウロコグループホールディングス	48,000	1,481.00	71,088,000	
8132	シナネンホールディングス	10,400	4,860.00	50,544,000	貸付有価証券 500株
8133	伊藤忠エネクス	93,300	1,584.00	147,787,200	
8136	サンリオ	106,700	9,080.00	968,836,000	
8137	サンワテクノス	19,200	2,428.00	46,617,600	
8140	リョーサン	26,600	5,190.00	138,054,000	
8141	新光商事	50,600	1,208.00	61,124,800	
8142	トーヨー	14,700	2,918.00	42,894,600	貸付有価証券 1,900株
8150	三信電気	15,200	2,230.00	33,896,000	
8151	東陽テクニカ	38,200	1,527.00	58,331,400	
8153	モスフードサービス	55,400	3,480.00	192,792,000	
8154	加賀電子	34,400	6,480.00	222,912,000	
8158	ソーダニッカ	31,800	1,250.00	39,750,000	
8159	立花エレテック	25,000	3,340.00	83,500,000	
8275	フォーバル	14,800	1,261.00	18,662,800	
8283	P A L T A C	50,700	4,036.00	204,625,200	
8285	三谷産業	65,800	425.00	27,965,000	
8835	太平洋興発	6,000	859.00	5,154,000	
9260	西本W i s m e t t a cホールディングス	9,600	5,850.00	56,160,000	
9265	ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	2,770.00	3,324,000	貸付有価証券

					100株
9273	コーア商事ホールディングス	26,400	860.00	22,704,000	貸付有価証券 3,500株
9274	K P Pグループホールディングス	97,500	734.00	71,565,000	
9305	ヤマタネ	16,600	2,964.00	49,202,400	
9763	丸紅建材リース	1,100	3,050.00	3,355,000	
9824	泉州電業	17,500	4,720.00	82,600,000	
9830	トラスコ中山	79,100	2,446.00	193,478,600	
9832	オートバックスセブン	131,000	1,649.50	216,084,500	
9837	モリト	26,900	1,496.00	40,242,400	
9869	加藤産業	46,600	4,655.00	216,923,000	
9872	北恵	3,700	873.00	3,230,100	貸付有価証券 800株
9882	イエローハット	59,800	1,925.00	115,115,000	
9896	J Kホールディングス	28,900	1,079.00	31,183,100	
9902	日伝	25,500	2,750.00	70,125,000	
9930	北沢産業	8,900	346.00	3,079,400	貸付有価証券 1,200株
9932	杉本商事	18,200	2,275.00	41,405,000	
9934	因幡電機産業	97,600	3,615.00	352,824,000	
9960	東テク	12,600	9,000.00	113,400,000	
9962	ミスミグループ本社	568,500	2,044.00	1,162,014,000	
9972	アルテック	8,400	306.00	2,570,400	
9982	タキヒヨー	3,700	1,137.00	4,206,900	
9986	蔵王産業	2,700	2,586.00	6,982,200	
9987	スズケン	143,300	4,591.00	657,890,300	
9991	ジェコス	22,500	1,175.00	26,437,500	
9995	グローセル	44,000	746.00	32,824,000	
2651	ローソン	80,100	10,305.00	825,430,500	
2659	サンエー	28,700	4,700.00	134,890,000	貸付有価証券 1,100株
2664	カワチ薬品	29,400	2,650.00	77,910,000	貸付有価証券 3,400株
2670	エービーシー・マート	164,800	2,879.00	474,459,200	
2674	ハードオフコーポレーション	13,400	1,750.00	23,450,000	
2678	アスクル	90,900	2,086.00	189,617,400	貸付有価証券 9,200株
2681	ゲオホールディングス	42,200	1,928.00	81,361,600	
2685	アダストリア	45,500	3,795.00	172,672,500	

2686	ジーフット	10,100	285.00	2,878,500	貸付有価証券 3,900株
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	722.00	1,444,000	
2695	くら寿司	44,100	4,605.00	203,080,500	
2698	キャンドゥ	13,400	2,755.00	36,917,000	貸付有価証券 700株
2722	I Kホールディングス	5,100	386.00	1,968,600	貸付有価証券 1,300株
2726	パルグループホールディングス	73,900	2,533.00	187,188,700	
2730	エディオン	149,100	1,550.00	231,105,000	貸付有価証券 18,400株
2734	サーラコーポレーション	79,100	834.00	65,969,400	
2735	ワッツ	7,700	653.00	5,028,100	
2742	ハローズ	17,100	4,580.00	78,318,000	
2752	フジオフードグループ本社	42,200	1,378.00	58,151,600	
2753	あみやき亭	9,100	5,060.00	46,046,000	
2764	ひらまつ	35,800	293.00	10,489,400	貸付有価証券 8,600株
2791	大黒天物産	11,600	9,930.00	115,188,000	
2792	ハニーズホールディングス	33,400	1,723.00	57,548,200	
2796	ファーマライズホールディングス	3,500	657.00	2,299,500	
3028	アルペン	31,100	1,991.00	61,920,100	貸付有価証券 2,400株
3030	ハブ	5,100	762.00	3,886,200	貸付有価証券 1,300株
3034	クオールホールディングス	51,800	1,783.00	92,359,400	
3046	ジズホールディングス	22,300	4,405.00	98,231,500	貸付有価証券 1,000株
3048	ビックカメラ	200,300	1,285.00	257,385,500	貸付有価証券 25,200株
3050	DCMホールディングス	199,000	1,475.00	293,525,000	
3053	ペッパーフードサービス	87,400	123.00	10,750,200	貸付有価証券 7,000株
3064	Monotaro	533,800	1,753.50	936,018,300	
3067	東京一番フーズ	3,600	523.00	1,882,800	
3073	DDグループ	8,900	1,277.00	11,365,300	貸付有価証券 1,700株
3082	きちりホールディングス	3,700	937.00	3,466,900	貸付有価証券 700株
3086	J. フロント リテイリング	432,100	1,661.00	717,718,100	貸付有価証券 18,000株
3087	ドトール・日レスホールディングス	66,800	2,070.00	138,276,000	
3088	マツキヨココカラ&カンパニー	685,000	2,413.50	1,653,247,500	

3091	ブロンコビリー	22,100	3,705.00	81,880,500	
3092	Z O Z O	239,900	3,956.00	949,044,400	
3093	トレジャー・ファクトリー	20,700	1,453.00	30,077,100	貸付有価証券 2,600株
3097	物語コーポレーション	62,900	4,655.00	292,799,500	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	634,200	2,495.50	1,582,646,100	
3134	H a m e e	15,200	1,248.00	18,969,600	
3135	マーケットエンタープライズ	1,400	791.00	1,107,400	貸付有価証券 100株
3141	ウエルシアホールディングス	195,300	2,601.50	508,072,950	貸付有価証券 33,300株
3148	クリエイトSDホールディングス	53,400	3,255.00	173,817,000	
3159	丸善CHIホールディングス	18,700	332.00	6,208,400	貸付有価証券 5,500株
3169	ミサワ	3,300	626.00	2,065,800	貸付有価証券 900株
3172	ティーライフ	2,100	1,341.00	2,816,100	貸付有価証券 200株
3175	エー・ピーホールディングス	3,300	1,047.00	3,455,100	貸付有価証券 300株
3178	チムニー	4,900	1,407.00	6,894,300	貸付有価証券 1,300株
3179	シュッピン	34,000	1,235.00	41,990,000	
3182	オイシックス・ラ・大地	50,600	1,336.00	67,601,600	貸付有価証券 4,400株
3186	ネクステージ	86,000	2,761.00	237,446,000	貸付有価証券 3,200株
3191	ジョイフル本田	109,500	2,214.00	242,433,000	貸付有価証券 2,000株
3193	鳥貴族ホールディングス	13,900	4,790.00	66,581,000	貸付有価証券 2,000株
3196	ホットランド	28,800	1,943.00	55,958,400	
3197	すかいらーくホールディングス	514,700	2,371.00	1,220,353,700	
3198	S F Pホールディングス	20,600	1,919.00	39,531,400	貸付有価証券 1,900株
3199	綿半ホールディングス	29,200	1,620.00	47,304,000	貸付有価証券 1,200株
3221	ヨシックスホールディングス	7,700	3,065.00	23,600,500	
3222	ユナイテッド・スーパーマーケット・ ホール	105,100	996.00	104,679,600	貸付有価証券 12,700株
3319	ゴルフダイジェスト・オンライン	17,000	608.00	10,336,000	
3328	B E E N O S	15,400	2,006.00	30,892,400	
3333	あさひ	34,900	1,328.00	46,347,200	貸付有価証券 4,500株
3341	日本調剤	25,600	1,617.00	41,395,200	

3349	コスモス薬品	31,900	14,260.00	454,894,000	
3361	トーエル	7,000	822.00	5,754,000	貸付有価証券 300株
3382	セブン&アイ・ホールディングス	3,893,000	2,138.50	8,325,180,500	貸付有価証券 149,400株
3387	クリエイト・レストランツ・ホールディング	254,900	1,049.00	267,390,100	貸付有価証券 34,200株
3391	ツルハホールディングス	79,100	10,915.00	863,376,500	貸付有価証券 900株
3395	サンマルクホールディングス	30,300	2,217.00	67,175,100	
3396	フェリシモ	3,500	926.00	3,241,000	
3397	トリドールホールディングス	105,500	4,277.00	451,223,500	
3415	TOKYO BASE	42,800	312.00	13,353,600	貸付有価証券 3,900株
3538	ウイルプラスホールディングス	2,600	1,012.00	2,631,200	
3539	JMホールディングス	28,400	2,608.00	74,067,200	
3544	サツドラホールディングス	6,800	863.00	5,868,400	
3546	アレンザホールディングス	28,100	1,047.00	29,420,700	貸付有価証券 1,000株
3547	串カツ田中ホールディングス	10,000	1,707.00	17,070,000	貸付有価証券 1,200株
3548	バロックジャパンリミテッド	29,300	759.00	22,238,700	貸付有価証券 4,400株
3549	クスリのアオキホールディングス	113,300	3,165.00	358,594,500	
3561	力の源ホールディングス	19,300	1,646.00	31,767,800	貸付有価証券 1,900株
3563	FOOD & LIFE COMPANIE	200,800	2,959.00	594,167,200	
4350	メディカルシステムネットワーク	40,800	661.00	26,968,800	
7127	一家ホールディングス	3,500	724.00	2,534,000	貸付有価証券 300株
7135	ジャパングラフトホールディングス	9,200	159.00	1,462,800	貸付有価証券 1,700株
7416	はるやまホールディングス	7,600	657.00	4,993,200	
7419	ノジマ	109,200	1,695.00	185,094,000	
7421	カップ・クリエイト	59,200	1,655.00	97,976,000	貸付有価証券 8,300株
7445	ライトオン	12,000	424.00	5,088,000	貸付有価証券 5,800株
7453	良品計画	411,000	2,393.50	983,728,500	貸付有価証券 15,800株
7455	パリミキホールディングス	19,900	430.00	8,557,000	貸付有価証券 4,700株
7463	アドヴァングループ	35,800	1,199.00	42,924,200	
7475	アルビス	12,300	2,787.00	34,280,100	貸付有価証券

					500株
7494	コナカ	17,300	420.00	7,266,000	
7506	ハウス オブ ローゼ	2,000	1,659.00	3,318,000	
7508	G-7ホールディングス	41,000	1,441.00	59,081,000	
7512	イオン北海道	111,300	896.00	99,724,800	貸付有価証券 1,000株
7513	コジマ	62,200	818.00	50,879,600	
7514	ヒマラヤ	5,100	912.00	4,651,200	貸付有価証券 1,600株
7516	コーナン商事	46,200	4,310.00	199,122,000	
7520	エコス	14,000	2,311.00	32,354,000	
7522	ワタミ	39,800	992.00	39,481,600	
7524	マルシェ	5,500	283.00	1,556,500	貸付有価証券 400株
7532	パン・パシフィック・インターナショナルホ	760,400	3,995.00	3,037,798,000	
7545	西松屋チェーン	74,100	2,449.00	181,470,900	貸付有価証券 5,000株
7550	ゼンショーホールディングス	191,700	6,350.00	1,217,295,000	貸付有価証券 7,900株
7554	幸楽苑ホールディングス	27,900	1,415.00	39,478,500	
7561	ハークスレイ	5,600	949.00	5,314,400	
7581	サイゼリヤ	55,700	5,110.00	284,627,000	
7593	V Tホールディングス	143,000	537.00	76,791,000	
7596	魚力	13,100	2,469.00	32,343,900	
7601	ポプラ	3,600	265.00	954,000	貸付有価証券 1,100株
7605	フジ・コーポレーション	17,900	1,750.00	31,325,000	
7606	ユナイテッドアローズ	44,200	1,989.00	87,913,800	
7611	ハイデイ日高	55,800	2,661.00	148,483,800	
7615	YU-WA Creation Holdi	8,900	175.00	1,557,500	貸付有価証券 3,100株
7616	コロワイド	161,900	2,182.50	353,346,750	貸付有価証券 5,200株
7630	壱番屋	148,700	1,198.00	178,142,600	貸付有価証券 6,000株
7640	トップカルチャー	5,200	157.00	816,400	貸付有価証券 1,900株
7646	PLANT	3,600	1,759.00	6,332,400	
7649	スギホールディングス	227,600	2,548.00	579,924,800	
7679	薬王堂ホールディングス	18,400	2,661.00	48,962,400	
7918	ヴィア・ホールディングス	22,200	135.00	2,997,000	貸付有価証券

					6,600株
8005	スクロール	56,100	978.00	54,865,800	
8008	ヨンドシーホールディングス	35,600	1,898.00	67,568,800	貸付有価証券 4,400株
8160	木曽路	57,000	2,671.00	152,247,000	
8163	S R Sホールディングス	62,100	1,184.00	73,526,400	
8165	千趣会	69,300	296.00	20,512,800	貸付有価証券 7,800株
8166	タカキュー	11,200	68.00	761,600	
8167	リテールパートナーズ	55,900	1,824.00	101,961,600	
8173	上新電機	37,300	2,344.00	87,431,200	
8174	日本瓦斯	199,500	2,601.50	518,999,250	
8179	ロイヤルホールディングス	66,400	2,491.00	165,402,400	
8181	東天紅	1,200	939.00	1,126,800	貸付有価証券 300株
8182	いなげや	36,600	1,402.00	51,313,200	
8185	チヨダ	36,000	872.00	31,392,000	
8194	ライフコーポレーション	39,500	3,845.00	151,877,500	
8200	リンガーハット	48,600	2,317.00	112,606,200	貸付有価証券 2,900株
8203	M r M a x HD	47,400	622.00	29,482,800	
8207	テンアライド	17,000	312.00	5,304,000	貸付有価証券 8,300株
8214	A O K Iホールディングス	80,700	1,153.00	93,047,100	
8217	オークワ	54,200	847.00	45,907,400	
8218	コメリ	57,900	3,550.00	205,545,000	貸付有価証券 2,300株
8219	青山商事	80,500	1,839.00	148,039,500	
8227	しまむら	88,400	8,915.00	788,086,000	
8230	はせがわ	7,500	348.00	2,610,000	
8233	高島屋	260,200	2,417.00	628,903,400	貸付有価証券 10,900株
8237	松屋	63,800	1,040.00	66,352,000	
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	166,600	1,967.00	327,702,200	
8244	近鉄百貨店	16,100	2,380.00	38,318,000	貸付有価証券 1,700株
8252	丸井グループ	249,900	2,483.00	620,501,700	
8255	アクシアル リテイリング	25,700	4,165.00	107,040,500	
8260	井筒屋	7,500	377.00	2,827,500	貸付有価証券 2,300株
8267	イオン	1,276,400	3,572.00	4,559,300,800	貸付有価証券

					49,000株
8273	イズミ	66,800	3,513.00	234,668,400	貸付有価証券 5,600株
8276	平和堂	62,900	2,004.00	126,051,600	
8278	フジ	57,800	1,846.00	106,698,800	貸付有価証券 7,500株
8279	ヤオコー	44,500	9,445.00	420,302,500	
8281	ゼビオホールディングス	51,000	993.00	50,643,000	
8282	ケーズホールディングス	252,900	1,326.00	335,345,400	
8289	O l y m p i cグループ	6,900	521.00	3,594,900	貸付有価証券 2,200株
8291	日産東京販売ホールディングス	23,600	613.00	14,466,800	
9262	シルバーライフ	7,200	930.00	6,696,000	貸付有価証券 400株
9267	G e n k y D r u g S t o r e s	16,500	6,580.00	108,570,000	貸付有価証券 700株
9275	ナルミヤ・インターナショナル	2,600	1,205.00	3,133,000	貸付有価証券 700株
9278	ブックオフグループホールディングス	21,900	1,427.00	31,251,300	貸付有価証券 2,500株
9279	ギフトホールディングス	15,900	3,575.00	56,842,500	貸付有価証券 600株
9627	アインホールディングス	51,900	5,469.00	283,841,100	貸付有価証券 5,900株
9828	元気寿司	21,300	3,235.00	68,905,500	
9831	ヤマダホールディングス	1,158,100	446.30	516,860,030	
9842	アークランズ	112,000	1,752.00	196,224,000	
9843	ニトリホールディングス	137,100	24,090.00	3,302,739,000	
9850	グルメ杵屋	30,500	1,117.00	34,068,500	貸付有価証券 3,100株
9854	愛眼	11,700	192.00	2,246,400	
9856	ケーユーホールディングス	17,600	1,187.00	20,891,200	
9861	吉野家ホールディングス	138,700	3,321.00	460,622,700	貸付有価証券 3,100株
9887	松屋フーズホールディングス	17,800	5,830.00	103,774,000	貸付有価証券 700株
9900	サガミホールディングス	56,500	1,561.00	88,196,500	貸付有価証券 2,300株
9919	関西フードマーケット	25,500	1,776.00	45,288,000	
9936	王将フードサービス	27,900	7,930.00	221,247,000	
9946	ミニストップ	27,400	1,502.00	41,154,800	貸付有価証券 1,100株
9948	アークス	69,100	3,120.00	215,592,000	
9956	パローホールディングス	71,800	2,519.00	180,864,200	

9974	ベルク	18,700	6,840.00	127,908,000	
9979	大庄	18,100	1,236.00	22,371,600	
9983	ファーストリテイリング	169,400	47,130.00	7,983,822,000	貸付有価証券 6,500株
9989	サンドラッグ	127,000	4,834.00	613,918,000	
9990	サックスパー ホールディングス	31,800	912.00	29,001,600	
9993	ヤマザワ	3,400	1,254.00	4,263,600	貸付有価証券 800株
9994	やまや	3,300	3,300.00	10,890,000	
9997	ペルーナ	90,600	627.00	56,806,200	
5830	いよぎんホールディングス	417,100	1,202.50	501,562,750	
5831	しずおかフィナンシャルグループ	778,700	1,497.00	1,165,713,900	
5832	ちゅうぎんフィナンシャルグループ	295,100	1,260.00	371,826,000	
5838	楽天銀行	121,900	3,110.00	379,109,000	貸付有価証券 1,500株
5844	京都フィナンシャルグループ	444,100	2,785.00	1,236,818,500	
7150	島根銀行	4,300	585.00	2,515,500	
7161	じもとホールディングス	11,200	641.00	7,179,200	
7167	めぶきフィナンシャルグループ	1,739,200	499.30	868,382,560	
7173	東京きらぼしフィナンシャルグループ	44,900	4,730.00	212,377,000	
7180	九州フィナンシャルグループ	678,300	1,151.00	780,723,300	
7182	ゆうちょ銀行	3,851,600	1,689.50	6,507,278,200	
7184	富山第一銀行	111,300	964.00	107,293,200	
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,880,700	787.30	1,480,675,110	
7189	西日本フィナンシャルホールディングス	197,800	1,932.00	382,149,600	
7322	三十三フィナンシャルグループ	31,300	2,085.00	65,260,500	
7327	第四北越フィナンシャルグループ	55,000	4,575.00	251,625,000	
7337	ひろぎんホールディングス	498,900	1,112.00	554,776,800	
7350	おきなわフィナンシャルグループ	29,900	2,661.00	79,563,900	
7380	十六フィナンシャルグループ	45,400	4,820.00	218,828,000	
7381	北國フィナンシャルホールディングス	36,900	4,880.00	180,072,000	
7384	プロクレアホールディングス	40,000	1,910.00	76,400,000	
7389	あいちフィナンシャルグループ	53,900	2,730.00	147,147,000	
8304	あおぞら銀行	251,900	2,471.00	622,444,900	貸付有価証券 35,700株
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	21,345,300	1,580.50	33,736,246,650	
8308	りそなホールディングス	4,053,600	947.90	3,842,407,440	

8309	三井住友トラスト・ホールディングス	1,259,600	3,365.00	4,238,554,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	2,492,000	8,951.00	22,305,892,000	
8331	千葉銀行	976,800	1,278.00	1,248,350,400	
8334	群馬銀行	680,100	883.00	600,528,300	
8336	武蔵野銀行	48,900	3,005.00	146,944,500	
8337	千葉興業銀行	66,200	1,074.00	71,098,800	
8338	筑波銀行	153,800	305.00	46,909,000	
8341	七十七銀行	102,000	4,065.00	414,630,000	
8343	秋田銀行	23,500	2,116.00	49,726,000	
8344	山形銀行	38,900	1,195.00	46,485,500	貸付有価証券 1,500株
8345	岩手銀行	22,200	2,635.00	58,497,000	
8346	東邦銀行	277,200	367.00	101,732,400	
8349	東北銀行	7,200	1,298.00	9,345,600	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	305,200	4,107.00	1,253,456,400	
8358	スルガ銀行	308,900	891.00	275,229,900	
8359	八十二銀行	752,100	1,022.50	769,022,250	
8360	山梨中央銀行	39,300	1,936.00	76,084,800	
8361	大垣共立銀行	66,800	2,279.00	152,237,200	
8362	福井銀行	31,300	1,980.00	61,974,000	
8364	清水銀行	13,900	1,651.00	22,948,900	
8365	富山銀行	2,500	2,045.00	5,112,500	
8366	滋賀銀行	58,300	4,245.00	247,483,500	
8367	南都銀行	52,700	3,145.00	165,741,500	貸付有価証券 100株
8368	百五銀行	329,700	661.00	217,931,700	
8370	紀陽銀行	125,400	1,900.00	238,260,000	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	216,900	1,912.50	414,821,250	貸付有価証券 500株
8381	山陰合同銀行	219,400	1,257.00	275,785,800	
8383	鳥取銀行	5,200	1,580.00	8,216,000	
8386	百十四銀行	34,500	3,025.00	104,362,500	
8387	四国銀行	51,400	1,220.00	62,708,000	
8388	阿波銀行	49,200	2,864.00	140,908,800	
8392	大分銀行	21,100	3,005.00	63,405,500	
8393	宮崎銀行	21,100	2,957.00	62,392,700	
8395	佐賀銀行	20,500	2,146.00	43,993,000	

8399	琉球銀行	74,600	1,217.00	90,788,200	
8410	セブン銀行	1,098,600	296.30	325,515,180	
8411	みずほフィナンシャルグループ	4,731,100	3,044.00	14,401,468,400	
8416	高知銀行	5,100	1,082.00	5,518,200	
8418	山口フィナンシャルグループ	343,700	1,608.00	552,669,600	
8522	名古屋銀行	22,700	6,700.00	152,090,000	
8524	北洋銀行	531,100	451.00	239,526,100	
8537	大光銀行	4,800	1,562.00	7,497,600	
8541	愛媛銀行	47,200	1,147.00	54,138,400	
8542	トマト銀行	5,200	1,310.00	6,812,000	
8544	京葉銀行	144,300	772.00	111,399,600	
8550	栃木銀行	175,000	370.00	64,750,000	
8551	北日本銀行	11,400	2,528.00	28,819,200	
8558	東和銀行	64,300	740.00	47,582,000	
8562	福島銀行	15,500	312.00	4,836,000	
8563	大東銀行	6,500	811.00	5,271,500	
8600	トモニホールディングス	331,700	425.00	140,972,500	
8713	フィデアホールディングス	36,200	1,650.00	59,730,000	
8714	池田泉州ホールディングス	486,200	397.00	193,021,400	
7148	F P G	118,500	2,171.00	257,263,500	
7172	ジャパンインベストメントアドバイザー	56,800	1,084.00	61,571,200	
7347	マーキュリアホールディングス	7,500	1,075.00	8,062,500	
8473	S B Iホールディングス	513,700	4,067.00	2,089,217,900	
8518	日本アジア投資	10,800	232.00	2,505,600	
8595	ジャフコグループ	104,400	1,849.50	193,087,800	
8601	大和証券グループ本社	2,715,200	1,190.50	3,232,445,600	
8604	野村ホールディングス	5,894,300	980.60	5,779,950,580	
8609	岡三証券グループ	307,700	853.00	262,468,100	
8613	丸三証券	116,600	1,170.00	136,422,000	貸付有価証券 4,500株
8614	東洋証券	93,000	428.00	39,804,000	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	416,200	635.00	264,287,000	
8617	光世証券	3,400	900.00	3,060,000	貸付有価証券 200株
8622	水戸証券	103,500	517.00	53,509,500	
8624	いちよし証券	65,600	855.00	56,088,000	

8628	松井証券	172,500	865.00	149,212,500	
8698	マネックスグループ	343,300	907.00	311,373,100	
8706	極東証券	48,000	1,808.00	86,784,000	
8707	岩井コスモホールディングス	39,900	2,362.00	94,243,800	
8708	アイザワ証券グループ	50,600	1,270.00	64,262,000	貸付有価証券 2,000株
8732	マネーパートナーズグループ	15,500	287.00	4,448,500	貸付有価証券 4,600株
8739	スパークス・グループ	39,000	1,871.00	72,969,000	
8742	小林洋行	5,900	380.00	2,242,000	貸付有価証券 500株
7181	かんぽ生命保険	357,000	2,982.50	1,064,752,500	
7388	F P パートナー	7,000	6,570.00	45,990,000	貸付有価証券 100株
8630	S O M P Oホールディングス	527,300	9,426.00	4,970,329,800	
8715	アニコム ホールディングス	119,000	577.00	68,663,000	
8725	MS & ADインシュアランスグループ ホール	784,800	7,836.00	6,149,692,800	
8750	第一生命ホールディングス	1,712,500	3,893.00	6,666,762,500	
8766	東京海上ホールディングス	3,464,500	4,684.00	16,227,718,000	
8795	T & Dホールディングス	941,200	2,692.00	2,533,710,400	
8798	アドバンスクリエイト	20,300	1,031.00	20,929,300	
7164	全国保証	91,700	5,650.00	518,105,000	貸付有価証券 3,600株
7183	あんしん保証	6,400	256.00	1,638,400	
7187	ジェイリース	20,900	1,292.00	27,002,800	
7191	イントラスト	5,700	845.00	4,816,500	貸付有価証券 900株
7192	日本モーゲージサービス	8,300	542.00	4,498,600	
7196	C a s a	5,800	817.00	4,738,600	貸付有価証券 2,400株
7198	S B I アルヒ	33,600	950.00	31,920,000	
7199	プレミアグループ	59,200	1,996.00	118,163,200	
7383	ネットプロテクションズホールディン グス	116,400	219.00	25,491,600	
8253	クレディセゾン	222,100	3,266.00	725,378,600	貸付有価証券 2,500株
8424	芙蓉総合リース	32,200	13,700.00	441,140,000	
8425	みずほリース	58,700	5,720.00	335,764,000	
8439	東京センチュリー	262,000	1,617.50	423,785,000	
8511	日本証券金融	128,800	1,706.00	219,732,800	

8515	アイフル	516,000	413.00	213,108,000	
8566	リコーリース	33,300	5,500.00	183,150,000	
8570	イオンフィナンシャルサービス	201,200	1,355.00	272,626,000	
8572	アコム	625,300	399.30	249,682,290	
8584	ジャックス	37,300	5,600.00	208,880,000	
8585	オリエントコーポレーション	114,400	1,117.00	127,784,800	
8591	オリックス	2,102,000	3,335.00	7,010,170,000	
8593	三菱HCキャピタル	1,561,800	1,079.50	1,685,963,100	
8596	九州リースサービス	6,000	1,454.00	8,724,000	
8697	日本取引所グループ	914,500	4,224.00	3,862,848,000	
8771	イー・ギャランティ	57,000	1,838.00	104,766,000	
8772	アサックス	6,800	819.00	5,569,200	貸付有価証券 500株
8793	NECキャピタルソリューション	17,200	3,950.00	67,940,000	
1435	Robot Home	97,000	168.00	16,296,000	
1878	大東建託	128,400	17,500.00	2,247,000,000	
2337	いちご	403,500	437.00	176,329,500	貸付有価証券 15,500株
2353	日本駐車場開発	370,900	203.00	75,292,700	貸付有価証券 62,200株
2975	スター・マイカ・ホールディングス	40,700	615.00	25,030,500	
2980	SREホールディングス	15,100	4,025.00	60,777,500	貸付有価証券 1,300株
2982	ADワークスグループ	37,400	246.00	9,200,400	貸付有価証券 8,000株
3003	ヒューリック	817,600	1,532.00	1,252,563,200	貸付有価証券 31,400株
3231	野村不動産ホールディングス	195,100	4,012.00	782,741,200	
3232	三重交通グループホールディングス	75,000	640.00	48,000,000	
3244	サムティ	55,800	2,626.00	146,530,800	貸付有価証券 100株
3245	ディア・ライフ	59,800	987.00	59,022,600	
3246	コーセーアールイー	4,700	791.00	3,717,700	貸付有価証券 2,000株
3252	地主	26,800	2,326.00	62,336,800	
3254	プレサンスコーポレーション	55,600	1,756.00	97,633,600	
3271	THEグローバル社	8,600	427.00	3,672,200	貸付有価証券 200株
3275	ハウスコム	2,400	1,030.00	2,472,000	
3276	JPMC	20,300	1,235.00	25,070,500	
3277	サンセイランディック	4,400	1,045.00	4,598,000	

3280	エストラスト	1,500	663.00	994,500	
3284	フージャースホールディングス	54,000	1,124.00	60,696,000	
3288	オープンハウスグループ	128,400	4,756.00	610,670,400	貸付有価証券 800株
3289	東急不動産ホールディングス	1,053,800	1,174.00	1,237,161,200	
3291	飯田グループホールディングス	335,800	1,980.00	664,884,000	貸付有価証券 400株
3294	イーグランド	2,200	1,597.00	3,513,400	
3299	ムゲンエステート	9,900	1,590.00	15,741,000	
3452	ビーロット	10,100	1,011.00	10,211,100	
3454	ファーストブラザーズ	2,900	1,259.00	3,651,100	
3457	A n d D oホールディングス	21,200	1,221.00	25,885,200	
3458	シーアールイー	19,500	1,420.00	27,690,000	
3465	ケイアイスター不動産	16,900	3,730.00	63,037,000	
3467	アグレ都市デザイン	2,700	1,653.00	4,463,100	
3475	グッドコムアセット	32,500	800.00	26,000,000	
3480	ジェイ・エス・ビー	17,400	2,610.00	45,414,000	
3482	ロードスターキャピタル	22,800	2,627.00	59,895,600	
3484	テンポイノベーション	4,400	975.00	4,290,000	貸付有価証券 1,000株
3486	グローバル・リンク・マネジメント	2,700	2,842.00	7,673,400	
3489	フェイスネットワーク	4,000	1,289.00	5,156,000	貸付有価証券 800株
3498	霞ヶ関キャピタル	9,500	16,800.00	159,600,000	
4666	パーク24	227,600	1,770.50	402,965,800	貸付有価証券 8,800株
4809	パラカ	12,400	1,983.00	24,589,200	
5535	ミガロホールディングス	2,300	2,220.00	5,106,000	
6620	宮越ホールディングス	16,000	1,324.00	21,184,000	貸付有価証券 1,600株
8801	三井不動産	1,620,900	4,769.00	7,730,072,100	
8802	三菱地所	2,291,100	2,654.50	6,081,724,950	
8803	平和不動産	56,900	3,980.00	226,462,000	
8804	東京建物	306,200	2,383.00	729,674,600	貸付有価証券 11,800株
8818	京阪神ビルディング	65,500	1,521.00	99,625,500	
8830	住友不動産	506,900	5,260.00	2,666,294,000	貸付有価証券 24,300株
8841	テーオーシー	62,400	679.00	42,369,600	
8848	レオパレス21	350,700	497.00	174,297,900	

8850	スターツコーポレーション	50,300	3,155.00	158,696,500	
8860	フジ住宅	44,100	758.00	33,427,800	
8864	空港施設	49,400	619.00	30,578,600	
8869	明和地所	20,000	1,112.00	22,240,000	貸付有価証券 2,400株
8871	ゴールドクレスト	28,600	2,488.00	71,156,800	
8877	エスリード	16,500	3,595.00	59,317,500	
8881	日神グループホールディングス	56,200	531.00	29,842,200	
8892	日本エスコン	65,600	1,033.00	67,764,800	貸付有価証券 7,900株
8897	M I R A R T Hホールディングス	161,000	511.00	82,271,000	
8904	A V A N T I A	7,900	856.00	6,762,400	
8905	イオンモール	181,700	1,762.50	320,246,250	貸付有価証券 7,000株
8908	毎日コムネット	5,400	778.00	4,201,200	貸付有価証券 1,000株
8917	ファースト住建	5,900	1,143.00	6,743,700	貸付有価証券 800株
8918	ランド	1,945,400	8.00	15,563,200	
8919	カチタス	94,200	1,962.00	184,820,400	
8923	トーセイ	58,300	2,305.00	134,381,500	
8928	穴吹興産	2,800	2,133.00	5,972,400	貸付有価証券 1,000株
8934	サンフロンティア不動産	51,900	1,778.00	92,278,200	
8935	F J ネクストホールディングス	36,900	1,387.00	51,180,300	
8940	インテリックス	3,500	615.00	2,152,500	
8944	ランドビジネス	5,400	272.00	1,468,800	
8945	サンネクスタグループ	4,300	1,000.00	4,300,000	
8999	グランディハウス	26,300	675.00	17,752,500	
9706	日本空港ビルデング	124,000	6,127.00	759,748,000	
1717	明豊ファシリティワークス	7,500	902.00	6,765,000	
2120	L I F U L L	125,100	173.00	21,642,300	貸付有価証券 1,800株
2121	M I X I	78,500	2,678.00	210,223,000	
2124	ジェイエイシーリクルートメント	132,200	764.00	101,000,800	
2127	日本M&Aセンターホールディングス	582,900	961.50	560,458,350	
2130	メンバーズ	12,500	901.00	11,262,500	貸付有価証券 1,000株
2139	中広	2,500	424.00	1,060,000	
2146	U T グループ	47,100	3,555.00	167,440,500	

2148	アイティメディア	13,900	1,995.00	27,730,500	
2150	ケアネット	56,100	672.00	37,699,200	
2153	E・Jホールディングス	21,400	1,725.00	36,915,000	
2154	オープンアップグループ	109,900	2,033.00	223,426,700	
2157	コシダカホールディングス	109,500	945.00	103,477,500	貸付有価証券 4,200株
2163	アルトナー	3,900	2,312.00	9,016,800	
2168	パソナグループ	44,400	2,790.00	123,876,000	貸付有価証券 1,800株
2169	CDS	3,800	1,728.00	6,566,400	貸付有価証券 1,100株
2170	リンクアンドモチベーション	105,300	559.00	58,862,700	貸付有価証券 1,100株
2175	エス・エム・エス	128,200	2,505.50	321,205,100	
2180	サニーサイドアップグループ	4,600	754.00	3,468,400	
2181	パーソルホールディングス	3,724,200	215.00	800,703,000	
2183	リニカル	9,100	402.00	3,658,200	
2193	クックパッド	100,100	134.00	13,413,400	
2196	エスクリ	6,300	305.00	1,921,500	
2198	アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,500	812.00	6,090,000	
2301	学情	18,600	1,740.00	32,364,000	
2305	スタジオアリス	18,300	2,055.00	37,606,500	貸付有価証券 3,700株
2311	エプロ	3,500	851.00	2,978,500	
2325	NJS	8,000	3,100.00	24,800,000	
2331	総合警備保障	611,100	839.90	513,262,890	
2371	カカクコム	241,700	1,899.50	459,109,150	貸付有価証券 10,300株
2372	アイロムグループ	14,800	1,926.00	28,504,800	
2374	セントケア・ホールディング	26,600	898.00	23,886,800	
2376	サイネックス	2,700	831.00	2,243,700	
2378	ルネサンス	28,500	1,074.00	30,609,000	
2379	ディップ	56,000	2,749.00	153,944,000	
2389	デジタルホールディングス	19,000	1,105.00	20,995,000	
2395	新日本科学	33,200	1,535.00	50,962,000	
2410	キャリアデザインセンター	3,200	1,758.00	5,625,600	
2412	ベネフィット・ワン	127,100	2,160.50	274,599,550	
2413	エムスリー	723,000	2,110.50	1,525,891,500	
2418	ツカダ・グローバルホールディング	10,000	441.00	4,410,000	

2424	プラス	1,800	678.00	1,220,400	貸付有価証券 700株
2427	アウトソーシング	234,800	1,748.50	410,547,800	
2428	ウェルネット	11,800	556.00	6,560,800	貸付有価証券 800株
2429	ワールドホールディングス	16,500	2,527.00	41,695,500	
2432	ディー・エヌ・エー	130,000	1,480.50	192,465,000	
2433	博報堂DYホールディングス	466,600	1,351.00	630,376,600	
2440	ぐるなび	68,200	309.00	21,073,800	貸付有価証券 7,300株
2445	タカミヤ	49,600	567.00	28,123,200	
2461	ファンコミュニケーションズ	51,200	404.00	20,684,800	貸付有価証券 2,000株
2462	ライク	13,600	1,617.00	21,991,200	貸付有価証券 900株
2464	A o b a - B B T	5,800	389.00	2,256,200	
2471	エスプール	105,100	310.00	32,581,000	
2475	WDBホールディングス	18,700	2,319.00	43,365,300	
2485	ティア	9,200	468.00	4,305,600	貸付有価証券 500株
2487	CDG	1,700	1,238.00	2,104,600	
2489	アドウェイズ	50,300	435.00	21,880,500	貸付有価証券 7,400株
2491	バリューコマース	32,100	1,089.00	34,956,900	貸付有価証券 100株
2492	インフォマート	379,800	410.00	155,718,000	
2749	J Pホールディングス	93,500	533.00	49,835,500	
3521	エコナックホールディングス	13,400	144.00	1,929,600	
4286	CLホールディングス	8,700	1,258.00	10,944,600	貸付有価証券 1,100株
4290	プレステージ・インターナショナル	171,200	665.00	113,848,000	
4301	アミューズ	22,300	1,556.00	34,698,800	
4310	ドリームインキュベータ	12,500	2,819.00	35,237,500	
4318	クイック	25,400	2,328.00	59,131,200	
4319	T A C	7,600	194.00	1,474,400	貸付有価証券 2,500株
4324	電通グループ	359,500	4,219.00	1,516,730,500	貸付有価証券 13,800株
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	14,000	1,141.00	15,974,000	
4337	びあ	12,500	3,290.00	41,125,000	貸付有価証券 1,200株
4343	イオンファンタジー	13,200	2,352.00	31,046,400	

4345	シーティーエス	46,200	792.00	36,590,400	貸付有価証券 1,600株
4346	N E X Y Z . G r o u p	4,800	602.00	2,889,600	貸付有価証券 1,500株
4544	H. U. グループホールディングス	107,100	2,568.50	275,086,350	
4641	アルプス技研	34,700	2,736.00	94,939,200	貸付有価証券 100株
4651	サニックス	58,600	325.00	19,045,000	
4658	日本空調サービス	39,300	896.00	35,212,800	
4661	オリエンタルランド	1,936,100	4,956.00	9,595,311,600	貸付有価証券 28,300株
4665	ダスキン	81,400	3,343.00	272,120,200	
4668	明光ネットワークジャパン	44,400	720.00	31,968,000	貸付有価証券 2,600株
4671	ファルコホールディングス	16,500	2,350.00	38,775,000	
4678	秀英予備校	3,500	313.00	1,095,500	
4679	田谷	2,600	417.00	1,084,200	貸付有価証券 200株
4680	ラウンドワン	344,300	795.00	273,718,500	
4681	リゾートトラスト	158,900	2,675.50	425,136,950	
4694	ビー・エム・エル	45,000	3,005.00	135,225,000	
4714	リソー教育	187,100	225.00	42,097,500	貸付有価証券 25,800株
4718	早稲田アカデミー	20,200	1,632.00	32,966,400	
4732	ユー・エス・エス	410,400	2,530.00	1,038,312,000	
4745	東京個別指導学院	43,400	430.00	18,662,000	
4751	サイバーエージェント	808,500	1,107.00	895,009,500	貸付有価証券 31,000株
4755	楽天グループ	3,136,500	882.80	2,768,902,200	貸付有価証券 120,000株
4763	クリーク・アンド・リバー社	18,400	1,901.00	34,978,400	
4765	S B I グローバルアセットマネジメン ト	71,600	773.00	55,346,800	
4767	テー・オー・ダブリュー	71,700	372.00	26,672,400	
4792	山田コンサルティンググループ	15,900	1,811.00	28,794,900	
4801	セントラルスポーツ	13,700	2,568.00	35,181,600	
4848	フルキャストホールディングス	34,900	1,453.00	50,709,700	
4849	エン・ジャパン	59,500	2,764.00	164,458,000	
5261	リソルホールディングス	1,300	5,750.00	7,475,000	貸付有価証券 300株
6028	テクノプロ・ホールディングス	214,200	3,122.00	668,732,400	
6029	アトラグループ	3,600	176.00	633,600	貸付有価証券

					300 株
6035	アイ・アールジャパンホールディングス	19,000	1,340.00	25,460,000	
6036	K e e P e r 技研	22,600	5,020.00	113,452,000	貸付有価証券 3,200 株
6037	ファーストロジック	3,500	550.00	1,925,000	
6044	三機サービス	2,300	1,507.00	3,466,100	
6047	G u n o s y	29,000	820.00	23,780,000	
6048	デザインワン・ジャパン	3,800	139.00	528,200	貸付有価証券 800 株
6050	イー・ガーディアン	13,800	1,353.00	18,671,400	
6054	リブセンス	7,100	233.00	1,654,300	貸付有価証券 2,700 株
6055	ジャパンマテリアル	111,900	2,360.00	264,084,000	
6058	ベクトル	44,900	1,171.00	52,577,900	貸付有価証券 2,100 株
6059	ウチヤマホールディングス	6,600	381.00	2,514,600	
6062	チャーム・ケア・コーポレーション	30,500	1,546.00	47,153,000	貸付有価証券 1,100 株
6070	キャリアリンク	13,400	2,691.00	36,059,400	
6071	I B J	27,900	552.00	15,400,800	
6073	アサンテ	18,100	1,694.00	30,661,400	
6078	バリューHR	32,000	1,330.00	42,560,000	貸付有価証券 1,600 株
6080	M&Aキャピタルパートナーズ	29,600	2,274.00	67,310,400	貸付有価証券 4,100 株
6082	ライドオンエクスプレスホールディングス	14,500	1,118.00	16,211,000	
6083	E R I ホールディングス	3,900	1,807.00	7,047,300	
6087	アビスト	2,400	3,305.00	7,932,000	貸付有価証券 200 株
6088	シグマクス・ホールディングス	49,300	1,731.00	85,338,300	
6089	ウィルグループ	30,500	1,117.00	34,068,500	
6093	エスクロー・エージェント・ジャパン	17,100	144.00	2,462,400	
6095	メドピア	32,100	711.00	22,823,100	
6096	レアジョブ	2,900	807.00	2,340,300	貸付有価証券 100 株
6098	リクルートホールディングス	2,708,500	6,500.00	17,605,250,000	
6099	エラン	48,400	882.00	42,688,800	貸付有価証券 1,800 株
6171	土木管理総合試験所	6,700	337.00	2,257,900	
6178	日本郵政	4,299,000	1,535.00	6,598,965,000	

6183	ベルシステム24ホールディングス	39,300	1,562.00	61,386,600	
6184	鎌倉新書	31,200	781.00	24,367,200	貸付有価証券 2,000株
6185	SMN	2,900	397.00	1,151,300	貸付有価証券 200株
6186	一蔵	2,000	617.00	1,234,000	
6189	グローバルキッズCOMPANY	2,500	681.00	1,702,500	
6191	エアトリ	26,800	1,698.00	45,506,400	貸付有価証券 1,900株
6194	アトラエ	21,600	443.00	9,568,800	
6196	ストライク	15,500	4,795.00	74,322,500	
6197	ソラスト	100,800	536.00	54,028,800	
6199	セラク	11,200	1,119.00	12,532,800	
6200	インソース	79,400	898.00	71,301,200	貸付有価証券 3,100株
6532	バイカレント・コンサルティング	268,900	2,933.00	788,683,700	
6533	Orchestra Holdings	7,800	960.00	7,488,000	
6535	アイモバイル	46,400	411.00	19,070,400	
6538	キャリアインデックス	5,200	201.00	1,045,200	
6539	MS-Japan	13,300	1,213.00	16,132,900	
6540	船場	2,700	1,313.00	3,545,100	貸付有価証券 700株
6544	ジャパンエレベーターサービスホールディング	118,500	2,475.00	293,287,500	
6546	フルテック	2,100	1,127.00	2,366,700	貸付有価証券 300株
6547	グリーンズ	5,600	2,505.00	14,028,000	
6551	ツナググループ・ホールディングス	4,300	732.00	3,147,600	貸付有価証券 500株
6552	GameWith	4,600	304.00	1,398,400	貸付有価証券 900株
6555	MS&Consulting	2,000	607.00	1,214,000	貸付有価証券 300株
6556	ウェルビー	18,300	1,076.00	19,690,800	
6560	エル・ティー・エス	4,300	2,310.00	9,933,000	
6564	ミダックホールディングス	22,200	1,645.00	36,519,000	
6571	キュービーネットホールディングス	20,900	1,227.00	25,644,300	
6572	RPAホールディングス	49,700	293.00	14,562,100	
7030	スプリックス	4,400	828.00	3,643,200	貸付有価証券 600株
7033	マネジメントソリューションズ	15,700	2,109.00	33,111,300	

7034	プロレド・パートナーズ	8,900	545.00	4,850,500	
7035	a n d f a c t o r y	4,500	314.00	1,413,000	
7037	テノ. ホールディングス	2,000	475.00	950,000	貸付有価証券 600株
7038	フロンティア・マネジメント	9,200	1,651.00	15,189,200	貸付有価証券 1,700株
7044	ピアラ	2,700	315.00	850,500	
7059	コプロ・ホールディングス	5,100	1,802.00	9,190,200	貸付有価証券 200株
7060	ギークス	2,000	478.00	956,000	
7071	アンビスホールディングス	39,200	2,394.00	93,844,800	
7085	カーブスホールディングス	99,900	808.00	80,719,200	
7088	フォーラムエンジニアリング	49,800	965.00	48,057,000	
7092	F a s t F i t n e s s J a p a n	12,500	1,110.00	13,875,000	
7354	ダイレクトマーケティングミックス	37,700	312.00	11,762,400	
7358	ポピンズ	5,400	1,511.00	8,159,400	
7366	L I T A L I C O	28,500	2,115.00	60,277,500	
7374	コンフィデンス・インターワークス	1,400	1,703.00	2,384,200	
8769	アドバンテッジリスクマネジメント	7,900	415.00	3,278,500	貸付有価証券 2,100株
8876	リログループ	183,300	1,229.00	225,275,700	
8920	東祥	25,500	781.00	19,915,500	貸付有価証券 2,700株
9161	I D & E ホールディングス	22,100	4,235.00	93,593,500	
9216	ビーウィズ	7,500	2,140.00	16,050,000	貸付有価証券 400株
9247	T R E ホールディングス	70,000	1,226.00	85,820,000	
9248	人・夢・技術グループ	13,800	1,738.00	23,984,400	
9332	N I S S O ホールディングス	31,700	868.00	27,515,600	貸付有価証券 2,000株
9336	大栄環境	66,500	2,689.00	178,818,500	
9347	日本管財ホールディングス	38,400	2,575.00	98,880,000	
9552	M & A 総研ホールディングス	17,500	6,430.00	112,525,000	
9603	エイチ・アイ・エス	106,300	1,941.00	206,328,300	貸付有価証券 600株
9612	ラックランド	16,600	2,225.00	36,935,000	貸付有価証券 800株
9616	共立メンテナンス	57,400	7,174.00	411,787,600	貸付有価証券 2,500株
9619	イチネンホールディングス	38,700	1,736.00	67,183,200	
9621	建設技術研究所	18,800	5,550.00	104,340,000	

9622	スペース	23,900	1,036.00	24,760,400	
9628	燦ホールディングス	34,300	1,060.00	36,358,000	
9632	スバル興業	11,300	2,677.00	30,250,100	貸付有価証券 500株
9633	東京テアトル	5,700	1,142.00	6,509,400	
9644	タナベコンサルティンンググループ	12,600	1,060.00	13,356,000	
9663	ナガワ	11,400	7,610.00	86,754,000	貸付有価証券 1,600株
9672	東京都競馬	30,600	4,410.00	134,946,000	
9675	常磐興産	5,700	1,250.00	7,125,000	貸付有価証券 1,700株
9678	カナモト	56,700	2,665.00	151,105,500	貸付有価証券 2,200株
9699	ニシオホールディングス	34,000	3,865.00	131,410,000	
9704	アゴーラ ホスピタリティー グループ	90,100	55.00	4,955,500	貸付有価証券 27,100株
9715	トランス・コスモス	45,500	3,185.00	144,917,500	
9716	乃村工藝社	159,600	909.00	145,076,400	
9722	藤田観光	14,600	7,520.00	109,792,000	
9726	KNT-CTホールディングス	21,800	1,395.00	30,411,000	
9729	トーカイ	32,400	2,151.00	69,692,400	
9731	白洋舎	1,500	2,871.00	4,306,500	貸付有価証券 500株
9735	セコム	372,600	11,130.00	4,147,038,000	貸付有価証券 13,800株
9740	セントラル警備保障	19,700	2,664.00	52,480,800	貸付有価証券 1,600株
9743	丹青社	70,900	870.00	61,683,000	貸付有価証券 3,100株
9744	メイテックグループホールディングス	131,800	3,018.00	397,772,400	
9755	応用地質	34,200	2,209.00	75,547,800	貸付有価証券 3,400株
9757	船井総研ホールディングス	76,100	2,585.00	196,718,500	貸付有価証券 1,200株
9760	進学会ホールディングス	4,100	280.00	1,148,000	
9765	オオバ	9,600	1,015.00	9,744,000	
9768	いであ	3,500	2,362.00	8,267,000	
9769	学究社	14,600	2,143.00	31,287,800	
9783	ベネッセホールディングス	122,900	2,585.00	317,696,500	
9787	イオンディライト	39,300	3,520.00	138,336,000	
9788	ナック	31,000	584.00	18,104,000	
9793	ダイセキ	74,700	3,755.00	280,498,500	貸付有価証券

					700 株
9795	ステップ	13,300	2,016.00	26,812,800	
合 計		552,676,700		1,400,111,695,310	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年3月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	36,255,741,846
コール・ローン	11,933,739,709
株式	4,742,686,545,669
投資証券	90,397,857,995
派生商品評価勘定	1,392,476,080
未収入金	37,170,395
未収配当金	7,401,337,889
未収利息	23,020
差入委託証拠金	45,914,539,967
流動資産合計	4,936,019,432,570
資産合計	4,936,019,432,570
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	17,301,008
未払金	330,065,344
未払解約金	10,117,523,541
流動負債合計	10,464,889,893
負債合計	10,464,889,893
純資産の部	
元本等	
元本	721,351,336,039
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	4,204,203,206,638
元本等合計	4,925,554,542,677
純資産合計	4,925,554,542,677
負債純資産合計	4,936,019,432,570

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年3月25日現在]
1. 期首	2023年3月28日
期首元本額	470,141,826,649円
期中追加設定元本額	326,968,596,454円
期中一部解約元本額	75,759,087,064円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	179,591,419円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	914,475,724円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	880,858,267円
MAXIS 海外株式(MSCIコクサイ)上場投信	2,972,518,299円
MAXIS 全世界株式(オール・カントリー)上場投信	5,617,174,484円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,340,296,993円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	8,481,852,216円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	10,152,343,594円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	42,495,750円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	115,280,967円
ファンド・マネジャー(海外株式)	777,708円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,872,691,188円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	945,044,000円
eMAXIS バランス(波乗り型)	75,400,761円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,666,595,527円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	200,824,684円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	272,136,087円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	252,407,593円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	101,677,236,814円
海外株式セレクション(ラップ向け)	2,522,393,617円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	4,894,821,418円
つみたて先進国株式	32,918,438,220円
つみたて8資産均等バランス	2,435,205,774円
つみたて4資産均等バランス	885,259,167円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,877,249円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,518,466円

eMAXIS マイマネージャー 1990s	6,761,462円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	167,548,361円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	219,824,264円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	156,639,361円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	63,590,727円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	500,239,939円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	1,412,521,571円
eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本)	58,992,923,393円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	649,914,085円
三菱UFJ DC年金インデックス (先進国株式)	4,661,608,153円
eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カントリー)	357,403,420,841円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	150,227,228円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	42,557,056円
つみたて全世界株式	1,940,532,884円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	70,153,390円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	2,742,726,173円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	53,456,989円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	2,789,035,106円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	66,889,786円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	405,309円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	33,217,477,107円
eMAXIS 全世界株式インデックス	5,965,755,989円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	475,391,284円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	1,012,719,985円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	175,344,569円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	623,987,033円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	145,541,241円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	358,776,570円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	77,112,858円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	114,811,704円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	505,797,169円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	424,376,007円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	872,147,780円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA (適格機関投資家限定)	1,222,185,783円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	4,566,464円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	2,927,429,463円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	30,319,999円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	593,904,490円
MUAM 外国株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)	8,678,624,266円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	60,136円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	473,991,456円
MUAM 全世界株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)	4,188,766,615円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	8,322,487円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	55,748,712円
MUKAM バランス・イノベーション (株式抑制型) (適格機関投	1,400,088,728円

資家転売制限付)	
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)	453,246,319 円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)	163,183,895 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	52,369,749 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)	1,256,075,813 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)	77,961,876 円
MUKAM 外国株式インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	2,531,218,564 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)	107,837,302 円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド (適格機関投資家限定)	7,262,363,446 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)	13,655,268 円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	211,294 円
外国株式インデックスファンドV (適格機関投資家限定)	1,840,864,893 円
海外株式インデックスファンドS	7,234,521,166 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)	164,397,584 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)	85,281,601 円
グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定)	334,623 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)	1,358,766 円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,913,414,410 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	632,007 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	1,532,600 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	407,359 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	1,722,934 円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	20,247,065 円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	709,549 円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	6,116,923 円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	679,206 円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	7,068,975 円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	7,032,722,803 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)	76,047,282 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)	328,376,660 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)	368,434,682 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)	382,601,466 円
合計	721,351,336,039 円
2. 受益権の総数	721,351,336,039 口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023年3月28日 至 2024年3月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に	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

係るリスク	<p>替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> <p>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。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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。</p>
-------	--

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年 3月 25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024年 3月 25日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	
株式	734,983,643,976	
投資証券	2,529,516,119	
合計	737,513,160,095	

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[2024年 3月 25日現在]

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

市場取引	株価指数先物取引			
	買建	89,615,468,173	—	90,994,203,898
	合計	89,615,468,173	—	90,994,203,898
				1,378,735,725

(注) 時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

[2024年3月25日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	1,367,029,615	—	1,366,143,556	△886,059
	カナダドル	79,428,561	—	78,844,203	△584,358
	イギリスポンド	108,296,460	—	107,544,422	△752,038
	スイスフラン	68,392,957	—	68,263,681	△129,276
	シンガポールドル	58,443,350	—	58,112,917	△330,433
	デンマーククローネ	27,786,759	—	27,619,186	△167,573
	ユーロ	113,425,936	—	112,707,515	△718,421
	売建				
	アメリカドル	493,824,067	—	493,812,977	11,090
	カナダドル	23,795,088	—	23,794,595	493
	オーストラリアドル	54,436,584	—	54,435,369	1,215
	スイスフラン	37,754,976	—	37,753,968	1,008
	スウェーデンクローネ	171,912,000	—	171,921,600	△9,600
	デンマーククローネ	20,883,548	—	20,881,929	1,619
	ユーロ	114,495,500	—	114,493,820	1,680
合計		2,739,905,401	—	2,736,329,738	△3,560,653

(注) 時価の算定方法

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[2024年3月25日現在]
1口当たり純資産額	6.8282円
(1万口当たり純資産額)	(68,282円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

(単位：円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	151,797	33.46	5,079,127.62	
	BAKER HUGHES CO	549,253	33.44	18,367,020.32	
	CHENIERE ENERGY INC	127,008	159.72	20,285,717.76	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	58,377	86.31	5,038,518.87	
	CHEVRON CORP	941,237	154.66	145,571,714.42	
	CONOCOPHILLIPS	626,845	123.03	77,120,740.35	
	COTERRA ENERGY INC	396,485	27.29	10,820,075.65	
	DEVON ENERGY CORP	348,497	48.37	16,856,799.89	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	92,169	194.70	17,945,304.30	
	EOG RESOURCES INC	301,399	124.84	37,626,651.16	
	EQT CORP	196,028	34.36	6,735,522.08	
	EXXON MOBIL CORP	2,102,986	113.49	238,667,881.14	
	HALLIBURTON CO	456,767	38.39	17,535,285.13	
	HESS CORP	143,297	149.63	21,441,530.11	
	HF SINCLAIR CORP	77,822	61.59	4,793,056.98	
	KINDER MORGAN INC	1,068,834	18.06	19,303,142.04	
	MARATHON OIL CORP	310,945	27.10	8,426,609.50	
	MARATHON PETROLEUM CORP	196,182	200.17	39,269,750.94	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	351,821	63.81	22,449,698.01	
	ONEOK INC	301,391	79.03	23,818,930.73	

OVINTIV INC	133,161	50.95	6,784,552.95
PHILLIPS 66	233,471	159.45	37,226,950.95
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	124,425	255.53	31,794,320.25
SCHLUMBERGER LTD	739,628	53.99	39,932,515.72
TARGA RESOURCES CORP	115,380	110.90	12,795,642.00
TEXAS PACIFIC LAND CORP	3,227	1,685.87	5,440,302.49
VALERO ENERGY CORP	179,351	169.64	30,425,103.64
WILLIAMS COS INC	630,145	38.25	24,103,046.25
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	118,911	236.71	28,147,422.81
ALBEMARLE CORP	62,065	120.86	7,501,175.90
AMCOR PLC	830,703	9.23	7,667,388.69
AVERY DENNISON CORP	41,472	215.58	8,940,533.76
BALL CORP	163,864	66.22	10,851,074.08
CELANESE CORP	55,524	165.41	9,184,224.84
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	101,273	83.66	8,472,499.18
CLEVELAND-CLIFFS INC	275,888	21.26	5,865,378.88
CORTEVA INC	366,457	55.07	20,180,786.99
CROWN HOLDINGS INC	62,964	77.55	4,882,858.20
DOW INC	378,237	57.68	21,816,710.16
DUPONT DE NEMOURS INC	233,219	75.74	17,664,007.06
EASTMAN CHEMICAL CO	59,297	95.27	5,649,225.19
ECOLAB INC	133,043	229.27	30,502,768.61
FMC CORP	66,809	62.36	4,166,209.24
FREEMONT-MCMORAN INC	769,538	45.10	34,706,163.80
INTERNATIONAL PAPER CO	159,887	39.53	6,320,333.11
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	132,359	83.08	10,996,385.72
LINDE PLC	255,132	468.24	119,463,007.68
LYONDELLBASELL INDU-CL A	140,312	100.98	14,168,705.76
MARTIN MARIETTA MATERIALS	32,166	607.12	19,528,621.92
MOSAIC CO/THE	174,017	31.18	5,425,850.06
NEWMONT CORP	629,839	33.77	21,269,663.03
NUCOR CORP	131,885	194.44	25,643,719.40
PACKAGING CORP OF AMERICA	47,222	184.72	8,722,847.84
PPG INDUSTRIES INC	126,639	142.56	18,053,655.84
RELIANCE INC	28,920	330.43	9,556,035.60
RPM INTERNATIONAL INC	65,733	118.69	7,801,849.77

SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	128,700	342.87	44,127,369.00
STEEL DYNAMICS INC	78,999	144.01	11,376,645.99
VULCAN MATERIALS CO	69,275	274.36	19,006,289.00
WESTLAKE CORP	17,817	150.32	2,678,251.44
WESTROCK CO	125,922	48.22	6,071,958.84
3M CO	295,772	106.78	31,582,534.16
AECOM	68,045	97.61	6,641,872.45
AERCAP HOLDINGS NV	105,654	86.51	9,140,127.54
ALLEGION PLC	47,118	134.12	6,319,466.16
AMETEK INC	123,261	183.15	22,575,252.15
AXON ENTERPRISE INC	35,700	316.32	11,292,624.00
BOEING CO/THE	303,887	188.85	57,389,059.95
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	64,016	210.54	13,477,928.64
CARLISLE COS INC	25,792	387.02	9,982,019.84
CARRIER GLOBAL CORP	429,227	57.86	24,835,074.22
CATERPILLAR INC	268,230	358.11	96,055,845.30
CNH INDUSTRIAL NV	529,492	12.73	6,740,433.16
CUMMINS INC	71,156	290.34	20,659,433.04
DEERE & CO	137,869	398.86	54,990,429.34
DOVER CORP	73,087	176.41	12,893,277.67
EATON CORP PLC	210,918	316.58	66,772,420.44
EMERSON ELECTRIC CO	303,255	112.45	34,101,024.75
FASTENAL CO	296,455	78.10	23,153,135.50
FERGUSON PLC	108,244	221.27	23,951,149.88
FORTIVE CORP	189,221	85.66	16,208,670.86
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	73,576	82.20	6,047,947.20
GENERAL DYNAMICS CORP	119,783	281.16	33,678,188.28
GENERAL ELECTRIC CO	573,627	175.15	100,470,769.05
GRACO INC	88,867	94.35	8,384,601.45
HEICO CORP	23,226	193.38	4,491,443.88
HEICO CORP-CLASS A	39,041	155.54	6,072,437.14
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	347,380	200.73	69,729,587.40
HOWMET AEROSPACE INC	199,691	68.10	13,598,957.10
HUBBELL INC	28,142	417.92	11,761,104.64
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	20,277	292.55	5,932,036.35
IDEX CORP	39,908	243.87	9,732,363.96

ILLINOIS TOOL WORKS	155,104	268.66	41,670,240.64
INGERSOLL-RAND INC	218,107	94.74	20,663,457.18
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	84,100	37.40	3,145,340.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	353,212	63.75	22,517,265.00
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	98,634	211.94	20,904,489.96
LENNOX INTERNATIONAL INC	17,039	493.85	8,414,710.15
LOCKHEED MARTIN CORP	118,281	445.88	52,739,132.28
MASCO CORP	116,358	77.10	8,971,201.80
NORDSON CORP	28,510	268.52	7,655,505.20
NORTHROP GRUMMAN CORP	76,358	468.75	35,792,812.50
OTIS WORLDWIDE CORP	217,164	99.34	21,573,071.76
OWENS CORNING	46,484	165.97	7,714,949.48
PACCAR INC	277,508	123.75	34,341,615.00
PARKER HANNIFIN CORP	66,522	554.89	36,912,392.58
PENTAIR PLC	90,296	83.94	7,579,446.24
QUANTA SERVICES INC	78,196	255.92	20,011,920.32
ROCKWELL AUTOMATION INC	61,862	286.38	17,716,039.56
RTX CORP	760,767	95.54	72,683,679.18
SMITH (A. O.) CORP	60,973	89.28	5,443,669.44
SNAP-ON INC	27,075	291.63	7,895,882.25
STANLEY BLACK & DECKER INC	85,688	94.68	8,112,939.84
TEXTRON INC	101,090	95.85	9,689,476.50
TORO CO	51,819	90.44	4,686,510.36
TRANE TECHNOLOGIES PLC	117,781	300.29	35,368,456.49
TRANSDIGM GROUP INC	28,597	1,231.20	35,208,626.40
UNITED RENTALS INC	36,245	714.27	25,888,716.15
VERTIV HOLDINGS CO-A	189,269	82.50	15,614,692.50
WABTEC CORP	92,105	143.78	13,242,856.90
WATSCO INC	17,387	439.50	7,641,586.50
WW GRAINGER INC	23,704	1,027.10	24,346,378.40
XYLEM INC	125,262	129.21	16,185,103.02
AUTOMATIC DATA PROCESSING	216,826	247.61	53,688,285.86
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	66,512	147.61	9,817,836.32
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	60,098	203.51	12,230,543.98
CINTAS CORP	48,349	639.39	30,913,867.11
COPART INC	448,089	57.41	25,724,789.49

DAYFORCE INC	81,226	69.17	5,618,402.42
EQUIFAX INC	66,483	264.16	17,562,149.28
JACOBS SOLUTIONS INC	66,108	150.03	9,918,183.24
LEIDOS HOLDINGS INC	67,318	129.14	8,693,446.52
PAYCHEX INC	167,826	120.84	20,280,093.84
PAYCOM SOFTWARE INC	27,679	192.47	5,327,377.13
PAYLOCITY HOLDING CORP	24,837	171.20	4,252,094.40
REPUBLIC SERVICES INC	114,016	190.51	21,721,188.16
ROBERT HALF INC	57,823	79.53	4,598,663.19
ROLLINS INC	150,661	46.54	7,011,762.94
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	109,026	63.84	6,960,219.84
TRANSUNION	106,627	80.00	8,530,160.00
VERALTO CORP	119,520	89.46	10,692,259.20
VERISK ANALYTICS INC	75,319	234.86	17,689,420.34
WASTE CONNECTIONS INC	133,810	170.88	22,865,452.80
WASTE MANAGEMENT INC	212,741	211.78	45,054,288.98
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	56,990	74.47	4,244,045.30
CSX CORP	1,044,531	37.35	39,013,232.85
DELTA AIR LINES INC	96,256	45.59	4,388,311.04
EXPEDITORS INTL WASH INC	74,240	121.69	9,034,265.60
FEDEX CORP	125,722	284.32	35,745,279.04
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	833,326	3.15	2,624,976.90
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	42,716	194.79	8,320,649.64
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	86,238	52.58	4,534,394.04
NORFOLK SOUTHERN CORP	117,172	254.12	29,775,748.64
OLD DOMINION FREIGHT LINE	52,353	441.07	23,091,337.71
SOUTHWEST AIRLINES CO	70,510	28.45	2,006,009.50
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	55,698	65.30	3,637,079.40
UBER TECHNOLOGIES INC	977,286	80.23	78,407,655.78
UNION PACIFIC CORP	321,016	244.97	78,639,289.52
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	382,479	156.27	59,769,993.33
APTIV PLC	145,581	78.72	11,460,136.32
BORGWARNER INC	121,246	33.20	4,025,367.20
FORD MOTOR CO	2,042,458	12.91	26,368,132.78
GENERAL MOTORS CO	732,664	43.06	31,548,511.84
LEAR CORP	36,593	145.70	5,331,600.10

RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	351,762	10.80	3,799,029.60
TESLA INC	1,506,409	170.83	257,339,849.47
DECKERS OUTDOOR CORP	13,439	922.44	12,396,671.16
DR HORTON INC	160,139	161.82	25,913,692.98
GARMIN LTD	77,502	147.29	11,415,269.58
HASBRO INC	69,310	54.84	3,800,960.40
LENNAR CORP-A	134,675	166.58	22,434,161.50
LULULEMON ATHLETICA INC	61,127	403.19	24,645,795.13
NIKE INC -CL B	643,933	93.86	60,439,551.38
NVR INC	1,654	7,971.71	13,185,208.34
PULTEGROUP INC	113,757	116.45	13,247,002.65
AIRBNB INC-CLASS A	225,337	167.86	37,825,068.82
BOOKING HOLDINGS INC	18,402	3,624.73	66,702,281.46
CAESARS ENTERTAINMENT INC	115,054	41.31	4,752,880.74
CARNIVAL CORP	525,292	17.08	8,971,987.36
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	14,500	2,882.04	41,789,580.00
DARDEN RESTAURANTS INC	61,306	165.11	10,122,233.66
DOMINO'S PIZZA INC	18,210	458.42	8,347,828.20
DOORDASH INC - A	135,049	137.24	18,534,124.76
DRAFTKINGS INC-CL A	212,563	47.20	10,032,973.60
EXPEDIA GROUP INC	68,962	136.84	9,436,760.08
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	136,450	211.30	28,831,885.00
HYATT HOTELS CORP - CL A	24,388	159.15	3,881,350.20
LAS VEGAS SANDS CORP	195,669	50.10	9,803,016.90
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	132,412	255.16	33,786,245.92
MCDONALD'S CORP	381,050	282.63	107,696,161.50
MGM RESORTS INTERNATIONAL	154,928	44.47	6,889,648.16
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	130,255	136.02	17,717,285.10
STARBUCKS CORP	597,605	90.71	54,208,749.55
VAIL RESORTS INC	20,649	221.50	4,573,753.50
WYNN RESORTS LTD	54,362	99.89	5,430,220.18
YUM! BRANDS INC	148,533	136.23	20,234,650.59
ALPHABET INC-CL A	3,112,102	150.77	469,211,618.54
ALPHABET INC-CL C	2,707,997	151.77	410,992,704.69
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	48,911	290.60	14,213,536.60
COMCAST CORP-CLASS A	2,120,167	42.74	90,615,937.58

ELECTRONIC ARTS INC	136,145	131.70	17,930,296.50
FOX CORP - CLASS A	120,205	30.04	3,610,958.20
FOX CORP - CLASS B	88,642	27.32	2,421,699.44
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	200,600	32.75	6,569,650.00
LIBERTY BROADBAND-C	64,383	56.00	3,605,448.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	109,976	67.24	7,394,786.24
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	91,985	28.74	2,643,648.90
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	83,541	105.99	8,854,510.59
MATCH GROUP INC	134,711	35.75	4,815,918.25
META PLATFORMS INC-CLASS A	1,167,552	509.58	594,961,148.16
NETFLIX INC	230,552	628.01	144,788,961.52
NEWS CORP - CLASS A	205,514	25.90	5,322,812.60
OMNICOM GROUP	100,962	93.97	9,487,399.14
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	226,588	11.25	2,549,115.00
PINTEREST INC- CLASS A	300,210	33.89	10,174,116.90
ROBLOX CORP -CLASS A	211,776	37.26	7,890,773.76
ROKU INC	59,908	63.58	3,808,950.64
SEA LTD-ADR	190,051	54.47	10,352,077.97
SIRIUS XM HOLDINGS INC	334,269	3.88	1,296,963.72
SNAP INC - A	529,711	11.40	6,038,705.40
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	86,040	152.46	13,117,658.40
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	239,088	85.06	20,336,825.28
WALT DISNEY CO/THE	966,941	115.87	112,039,453.67
WARNER BROS DISCOVERY INC	1,194,454	8.44	10,081,191.76
AMAZON.COM INC	4,891,586	178.87	874,957,987.82
AUTOZONE INC	9,065	3,239.32	29,364,435.80
BATH & BODY WORKS INC	105,296	46.75	4,922,588.00
BEST BUY CO INC	102,296	81.66	8,353,491.36
BURLINGTON STORES INC	31,307	226.67	7,096,357.69
CARMAX INC	84,559	85.53	7,232,331.27
DICK'S SPORTING GOODS INC	33,562	221.24	7,425,256.88
EBAY INC	272,773	51.42	14,025,987.66
ETSY INC	60,720	67.82	4,118,030.40
GENUINE PARTS CO	73,811	155.88	11,505,658.68
GLOBAL-E ONLINE LTD	34,400	36.71	1,262,824.00
HOME DEPOT INC	524,136	390.28	204,559,798.08

LKQ CORP	132,517	52.78	6,994,247.26
LOWE'S COS INC	303,811	258.50	78,535,143.50
MERCADOLIBRE INC	23,521	1,571.99	36,974,776.79
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	30,491	1,167.53	35,599,157.23
POOL CORP	21,752	416.38	9,057,097.76
ROSS STORES INC	172,917	145.37	25,136,944.29
TJX COMPANIES INC	601,538	99.48	59,841,000.24
TRACTOR SUPPLY COMPANY	58,919	262.97	15,493,929.43
ULTA BEAUTY INC	26,292	520.37	13,681,568.04
WILLIAMS-SONOMA INC	32,309	312.63	10,100,762.67
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	183,466	20.90	3,834,439.40
COSTCO WHOLESALE CORP	233,507	734.80	171,580,943.60
DOLLAR GENERAL CORP	117,570	150.70	17,717,799.00
DOLLAR TREE INC	105,210	125.71	13,225,949.10
KROGER CO	365,405	56.55	20,663,652.75
SYSCO CORP	261,676	81.59	21,350,144.84
TARGET CORP	238,774	168.63	40,264,459.62
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	387,829	20.58	7,981,520.82
WALMART INC	2,335,585	60.87	142,167,058.95
ALTRIA GROUP INC	932,247	42.98	40,067,976.06
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	274,680	62.00	17,030,160.00
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	159,753	50.90	8,131,427.70
BUNGE GLOBAL SA	71,945	99.22	7,138,382.90
CAMPBELL SOUP CO	90,900	43.55	3,958,695.00
CELSIUS HOLDINGS INC	80,388	92.46	7,432,674.48
COCA-COLA CO/THE	2,158,455	60.49	130,564,942.95
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	116,740	71.32	8,325,896.80
CONAGRA BRANDS INC	235,853	28.99	6,837,378.47
CONSTELLATION BRANDS INC-A	85,562	268.24	22,951,150.88
DARLING INGREDIENTS INC	88,310	45.34	4,003,975.40
GENERAL MILLS INC	292,423	69.10	20,206,429.30
HERSHEY CO/THE	81,802	197.99	16,195,977.98
HORMEL FOODS CORP	152,101	34.38	5,229,232.38
JM SMUCKER CO/THE	55,002	124.47	6,846,098.94
KELLANOVA	155,222	55.55	8,622,582.10
KEURIG DR PEPPER INC	586,906	29.80	17,489,798.80

KRAFT HEINZ CO/THE	462,006	35.85	16,562,915.10
LAMB WESTON HOLDINGS INC	79,379	103.17	8,189,531.43
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	133,217	70.03	9,329,186.51
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	99,682	67.16	6,694,643.12
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	704,468	72.40	51,003,483.20
MONSTER BEVERAGE CORP	403,120	59.50	23,985,640.00
PEPSICO INC	723,316	172.02	124,424,818.32
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	816,270	90.88	74,182,617.60
TYSON FOODS INC-CL A	144,659	58.05	8,397,454.95
CHURCH & DWIGHT CO INC	126,053	104.60	13,185,143.80
CLOROX COMPANY	62,251	150.75	9,384,338.25
COLGATE-PALMOLIVE CO	405,234	89.20	36,146,872.80
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	119,252	143.18	17,074,501.36
KENVUE INC	936,757	20.60	19,297,194.20
KIMBERLY-CLARK CORP	176,350	124.93	22,031,405.50
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,238,943	161.66	200,287,525.38
ABBOTT LABORATORIES	915,367	110.57	101,212,129.19
ALIGN TECHNOLOGY INC	39,533	319.42	12,627,630.86
BAXTER INTERNATIONAL INC	277,171	41.94	11,624,551.74
BECTON DICKINSON AND CO	149,623	246.25	36,844,663.75
BOSTON SCIENTIFIC CORP	776,150	67.62	52,483,263.00
CARDINAL HEALTH INC	124,521	111.01	13,823,076.21
CENCORA INC	88,799	242.50	21,533,757.50
CENTENE CORP	278,086	76.93	21,393,155.98
COOPER COS INC/THE	103,973	100.42	10,440,968.66
CVS HEALTH CORP	679,187	78.48	53,302,595.76
DAVITA INC	29,535	134.11	3,960,938.85
DEXCOM INC	198,301	133.18	26,409,727.18
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	314,722	93.79	29,517,776.38
ELEVANCE HEALTH INC	123,701	513.85	63,563,758.85
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	218,981	89.73	19,649,165.13
HCA HEALTHCARE INC	105,962	329.94	34,961,102.28
HENRY SCHEIN INC	70,861	73.12	5,181,356.32
HOLOGIC INC	124,965	75.26	9,404,865.90
HUMANA INC	63,330	348.54	22,073,038.20
IDEXX LABORATORIES INC	43,020	530.72	22,831,574.40

INSULET CORP	33,794	164.31	5,552,692.14
INTUITIVE SURGICAL INC	186,271	394.07	73,403,812.97
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	44,780	213.26	9,549,782.80
MCKESSON CORP	70,350	532.57	37,466,299.50
MEDTRONIC PLC	703,956	83.08	58,484,664.48
MOLINA HEALTHCARE INC	31,568	414.72	13,091,880.96
QUEST DIAGNOSTICS INC	59,413	129.30	7,682,100.90
RESMED INC	75,279	192.00	14,453,568.00
STERIS PLC	50,647	229.00	11,598,163.00
STRYKER CORP	180,715	352.62	63,723,723.30
TELEFLEX INC	25,117	220.94	5,549,349.98
THE CIGNA GROUP	154,681	351.78	54,413,682.18
UNITEDHEALTH GROUP INC	486,568	490.07	238,452,379.76
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	31,888	180.49	5,755,465.12
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	81,549	230.42	18,790,520.58
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	106,395	127.20	13,533,444.00
ABBVIE INC	929,869	178.45	165,935,123.05
AGILENT TECHNOLOGIES INC	156,987	147.45	23,147,733.15
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	64,878	146.51	9,505,275.78
AMGEN INC	282,466	276.17	78,008,635.22
AVANTOR INC	338,278	26.07	8,818,907.46
BIO-RAD LABORATORIES-A	11,720	350.46	4,107,391.20
BIO-TECHNE CORP	84,689	71.50	6,055,263.50
BIOGEN INC	73,822	218.10	16,100,578.20
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	99,283	85.13	8,451,961.79
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,076,926	51.93	55,924,767.18
CATALENT INC	93,028	55.79	5,190,032.12
CHARLES RIVER LABORATORIES	25,059	272.57	6,830,331.63
DANAHER CORP	370,331	254.80	94,360,338.80
ELI LILLY & CO	424,522	770.61	327,140,898.42
EXACT SCIENCES CORP	85,934	62.10	5,336,501.40
GILEAD SCIENCES INC	660,242	72.61	47,940,171.62
ILLUMINA INC	81,564	137.24	11,193,843.36
INCYTE CORP	92,287	56.98	5,258,513.26
IQVIA HOLDINGS INC	95,027	252.41	23,985,765.07
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	31,964	121.81	3,893,534.84

JOHNSON & JOHNSON	1, 265, 926	155.23	196, 509, 692.98
MERCK & CO. INC.	1, 332, 893	123.85	165, 078, 798.05
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	11, 128	1, 327.60	14, 773, 532.80
MODERNA INC	165, 154	105.43	17, 412, 186.22
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	51, 839	141.43	7, 331, 589.77
PFIZER INC	2, 984, 723	27.36	81, 662, 021.28
REGENERON PHARMACEUTICALS	56, 663	967.24	54, 806, 720.12
REPLIGEN CORP	27, 634	198.03	5, 472, 361.02
REVVITY INC	64, 189	103.25	6, 627, 514.25
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	208, 355	30.27	6, 306, 905.85
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	608, 467	13.89	8, 451, 606.63
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	203, 687	583.09	118, 767, 852.83
UNITED THERAPEUTICS CORP	24, 588	237.90	5, 849, 485.20
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	136, 460	415.66	56, 720, 963.60
VIATRIS INC	629, 398	11.84	7, 452, 072.32
WATERS CORP	30, 950	347.31	10, 749, 244.50
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	39, 886	393.92	15, 711, 893.12
ZOETIS INC	242, 746	168.90	40, 999, 799.40
BANK OF AMERICA CORP	3, 756, 052	37.05	139, 161, 726.60
CITIGROUP INC	1, 006, 507	60.82	61, 215, 755.74
CITIZENS FINANCIAL GROUP	256, 640	35.15	9, 020, 896.00
FIFTH THIRD BANCORP	349, 373	36.37	12, 706, 696.01
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	5, 538	1, 600.23	8, 862, 073.74
HUNTINGTON BANCSHARES INC	784, 804	13.31	10, 445, 741.24
JPMORGAN CHASE & CO	1, 520, 258	196.62	298, 913, 127.96
KEYCORP	488, 764	15.03	7, 346, 122.92
M & T BANK CORP	84, 340	142.15	11, 988, 931.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	212, 634	155.51	33, 066, 713.34
REGIONS FINANCIAL CORP	526, 791	19.86	10, 462, 069.26
TRUIST FINANCIAL CORP	693, 342	37.69	26, 132, 059.98
US BANCORP	806, 739	43.59	35, 165, 753.01
WELLS FARGO & CO	1, 915, 804	57.13	109, 449, 882.52
ALLY FINANCIAL INC	150, 075	39.29	5, 896, 446.75
AMERICAN EXPRESS CO	307, 096	225.96	69, 391, 412.16
AMERIPRISE FINANCIAL INC	52, 466	430.16	22, 568, 774.56
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	269, 558	19.96	5, 380, 377.68

APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	206,711	112.58	23,271,524.38
ARES MANAGEMENT CORP - A	87,774	133.87	11,750,305.38
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	404,131	56.47	22,821,277.57
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	688,770	411.60	283,497,732.00
BLACKROCK INC	78,511	824.83	64,758,228.13
BLACKSTONE INC	377,083	127.86	48,213,832.38
BLOCK INC	288,125	80.77	23,271,856.25
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	202,455	141.16	28,578,547.80
CARLYLE GROUP INC/THE	126,277	46.42	5,861,778.34
CBOE GLOBAL MARKETS INC	55,335	180.92	10,011,208.20
CME GROUP INC	186,079	214.50	39,913,945.50
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	92,523	255.51	23,640,551.73
COREBRIDGE FINANCIAL INC	135,682	27.54	3,736,682.28
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	135,085	125.76	16,988,289.60
EQUITABLE HOLDINGS INC	194,443	36.39	7,075,780.77
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	19,418	447.46	8,688,778.28
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	316,336	70.52	22,308,014.72
FISERV INC	316,296	156.29	49,433,901.84
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	36,582	303.26	11,093,857.32
FRANKLIN RESOURCES INC	152,703	27.37	4,179,481.11
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	20,000	54.19	1,083,800.00
GLOBAL PAYMENTS INC	138,881	132.13	18,350,346.53
GOLDMAN SACHS GROUP INC	172,008	406.82	69,976,294.56
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	296,097	136.23	40,337,294.31
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	37,305	168.95	6,302,679.75
KKR & CO INC	298,533	100.76	30,080,185.08
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	37,429	260.37	9,745,388.73
MARKETAXESS HOLDINGS INC	18,161	221.70	4,026,293.70
MASTERCARD INC - A	439,977	481.67	211,923,721.59
MOODY'S CORP	85,322	387.64	33,074,220.08
MORGAN STANLEY	650,276	91.95	59,792,878.20
MSCI INC	40,395	553.11	22,342,878.45
NASDAQ INC	178,267	61.63	10,986,595.21
NORTHERN TRUST CORP	106,892	85.54	9,143,541.68
PAYPAL HOLDINGS INC	544,623	64.77	35,275,231.71
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	101,506	125.59	12,748,138.54

ROBINHOOD MARKETS INC - A	227,332	18.30	4,160,175.60
S&P GLOBAL INC	171,150	419.13	71,734,099.50
SCHWAB (CHARLES) CORP	795,776	71.60	56,977,561.60
SEI INVESTMENTS COMPANY	60,138	70.08	4,214,471.04
STATE STREET CORP	159,341	75.84	12,084,421.44
SYNCHRONY FINANCIAL	229,216	41.55	9,523,924.80
T ROWE PRICE GROUP INC	114,509	118.62	13,583,057.58
TOAST INC-CLASS A	172,934	23.80	4,115,829.20
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	56,615	105.23	5,957,596.45
VISA INC-CLASS A SHARES	831,835	283.26	235,625,582.10
AFLAC INC	285,283	84.16	24,009,417.28
ALLSTATE CORP	135,600	165.25	22,407,900.00
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	36,267	131.17	4,757,142.39
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	362,174	76.38	27,662,850.12
AON PLC-CLASS A	105,945	326.79	34,621,766.55
ARCH CAPITAL GROUP LTD	199,746	90.68	18,112,967.28
ARTHUR J GALLAGHER & CO	114,590	246.53	28,249,872.70
ASSURANT INC	28,492	179.68	5,119,442.56
BROWN & BROWN INC	126,932	86.00	10,916,152.00
CHUBB LTD	214,505	255.51	54,808,172.55
CINCINNATI FINANCIAL CORP	80,217	117.42	9,419,080.14
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	12,973	400.21	5,191,924.33
EVEREST GROUP LTD	22,854	384.17	8,779,821.18
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	125,557	51.63	6,482,507.91
GLOBE LIFE INC	49,712	115.47	5,740,244.64
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	152,913	100.16	15,315,766.08
LOEWS CORP	91,815	76.45	7,019,256.75
MARKEL GROUP INC	7,277	1,518.63	11,051,070.51
MARSH & MCLENNAN COS	260,012	204.42	53,151,653.04
METLIFE INC	326,302	72.63	23,699,314.26
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	124,711	83.53	10,417,109.83
PROGRESSIVE CORP	308,469	205.70	63,452,073.30
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	194,569	114.60	22,297,607.40
TRAVELERS COS INC/THE	121,035	224.45	27,166,305.75
WILLIS TOWERS WATSON PLC	52,685	273.21	14,394,068.85
WR BERKLEY CORP	107,041	86.23	9,230,145.43

ACCENTURE PLC-CL A	330,229	337.50	111,452,287.50
ADOBE INC	238,132	499.52	118,951,696.64
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	77,497	108.97	8,444,848.09
ANSYS INC	46,959	349.24	16,399,961.16
APPROVIN CORP-CLASS A	84,427	71.23	6,013,735.21
ASPEN TECHNOLOGY INC	16,366	200.75	3,285,474.50
ATLASSIAN CORP-CL A	82,743	192.53	15,930,509.79
AUTODESK INC	114,108	262.86	29,994,428.88
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	115,702	51.86	6,000,305.72
BILL HOLDINGS INC	41,762	68.05	2,841,904.10
CADENCE DESIGN SYS INC	144,105	322.74	46,508,447.70
CHECK POINT SOFTWARE TECH	45,465	165.08	7,505,362.20
CLOUDFLARE INC - CLASS A	154,189	96.57	14,890,031.73
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	268,180	71.90	19,282,142.00
CONFLUENT INC-CLASS A	90,238	30.96	2,793,768.48
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	121,152	327.58	39,686,972.16
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	21,827	268.14	5,852,691.78
DATADOG INC - CLASS A	142,310	123.02	17,506,976.20
DOCUSIGN INC	99,141	58.27	5,776,946.07
DROPBOX INC-CLASS A	143,057	24.35	3,483,437.95
DYNATRACE INC	144,110	46.33	6,676,616.30
EPAM SYSTEMS INC	29,589	270.82	8,013,292.98
FAIR ISAAC CORP	13,244	1,276.74	16,909,144.56
FORTINET INC	335,290	68.30	22,900,307.00
GARTNER INC	39,704	479.34	19,031,715.36
GEN DIGITAL INC	292,070	22.10	6,454,747.00
GODADDY INC - CLASS A	71,554	121.62	8,702,397.48
HUBSPOT INC	25,866	621.75	16,082,185.50
INTL BUSINESS MACHINES CORP	480,851	190.84	91,765,604.84
INTUIT INC	147,765	643.74	95,122,241.10
MANHATTAN ASSOCIATES INC	31,317	250.84	7,855,556.28
MICROSOFT CORP	3,712,803	428.74	1,591,827,158.22
MONDAY.COM LTD	14,400	228.00	3,283,200.00
MONGODB INC	37,557	355.50	13,351,513.50
OKTA INC	81,404	106.13	8,639,406.52
ORACLE CORP	868,623	127.79	111,001,333.17

PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	967,365	24.18	23,390,885.70
PALO ALTO NETWORKS INC	167,158	286.78	47,937,571.24
PTC INC	65,062	190.28	12,379,997.36
ROPER TECHNOLOGIES INC	55,235	556.38	30,731,649.30
SALESFORCE INC	510,018	307.77	156,968,239.86
SAMSARA INC-CL A	92,043	37.10	3,414,795.30
SERVICENOW INC	108,307	774.15	83,845,864.05
SNOWFLAKE INC-CLASS A	149,297	159.03	23,742,701.91
SYNOPSYS INC	80,489	594.20	47,826,563.80
TWILIO INC - A	83,044	61.57	5,113,019.08
TYLER TECHNOLOGIES INC	21,498	419.29	9,013,896.42
UIPATH INC - CLASS A	198,903	22.97	4,568,801.91
UNITY SOFTWARE INC	132,776	26.99	3,583,624.24
VERISIGN INC	47,953	188.85	9,055,924.05
WIX.COM LTD	30,341	139.34	4,227,714.94
WORKDAY INC-CLASS A	108,290	277.50	30,050,475.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	121,952	65.96	8,043,953.92
ZSCALER INC	45,777	194.95	8,924,226.15
AMPHENOL CORP-CL A	317,664	114.42	36,347,114.88
APPLE INC	7,723,804	172.28	1,330,656,953.12
ARISTA NETWORKS INC	139,973	306.42	42,890,526.66
CDW CORP/DE	68,136	255.67	17,420,331.12
CISCO SYSTEMS INC	2,138,074	49.78	106,433,323.72
CORNING INC	440,158	32.57	14,335,946.06
DELL TECHNOLOGIES -C	130,598	112.24	14,658,319.52
F5 INC	28,851	190.57	5,498,135.07
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	666,505	17.37	11,577,191.85
HP INC	487,515	30.05	14,649,825.75
JABIL INC	66,575	131.19	8,733,974.25
JUNIPER NETWORKS INC	170,230	37.05	6,307,021.50
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	92,134	154.39	14,224,568.26
MOTOROLA SOLUTIONS INC	87,572	348.56	30,524,096.32
NETAPP INC	109,921	104.73	11,512,026.33
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	104,000	89.01	9,257,040.00
SUPER MICRO COMPUTER INC	26,009	972.74	25,299,994.66
TE CONNECTIVITY LTD	158,831	143.31	22,762,070.61

TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	24,649	424.03	10,451,915.47
TRIMBLE INC	130,417	64.20	8,372,771.40
WESTERN DIGITAL CORP	168,961	63.94	10,803,366.34
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	26,405	291.44	7,695,473.20
AT&T INC	3,765,472	16.98	63,937,714.56
LIBERTY GLOBAL LTD-C	110,741	17.39	1,925,785.99
T-MOBILE US INC	273,413	160.61	43,912,861.93
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,212,611	40.37	89,323,106.07
AES CORP	353,972	16.24	5,748,505.28
ALLIANT ENERGY CORP	149,496	48.67	7,275,970.32
AMEREN CORPORATION	142,796	71.68	10,235,617.28
AMERICAN ELECTRIC POWER	276,526	82.95	22,937,831.70
AMERICAN WATER WORKS CO INC	108,003	117.75	12,717,353.25
ATMOS ENERGY CORP	78,414	116.57	9,140,719.98
CENTERPOINT ENERGY INC	354,590	27.83	9,868,239.70
CMS ENERGY CORP	149,917	58.97	8,840,605.49
CONSOLIDATED EDISON INC	186,386	88.60	16,513,799.60
CONSTELLATION ENERGY	169,499	178.24	30,211,501.76
DOMINION ENERGY INC	437,078	48.32	21,119,608.96
DTE ENERGY COMPANY	105,664	108.88	11,504,696.32
DUKE ENERGY CORP	400,779	94.61	37,917,701.19
EDISON INTERNATIONAL	197,028	69.56	13,705,267.68
ENTERGY CORP	115,804	103.17	11,947,498.68
ESSENTIAL UTILITIES INC	146,859	36.63	5,379,445.17
EVERGY INC	112,565	51.63	5,811,730.95
EVERSOURCE ENERGY	188,220	57.89	10,896,055.80
EXELON CORP	520,462	36.70	19,100,955.40
FIRSTENERGY CORP	282,040	38.21	10,776,748.40
NEXTERA ENERGY INC	1,084,336	61.78	66,990,278.08
NISOURCE INC	260,713	27.10	7,065,322.30
NRG ENERGY INC	109,791	67.17	7,374,661.47
P G & E CORP	1,085,886	16.41	17,819,389.26
PPL CORP	371,135	27.08	10,050,335.80
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	252,388	65.03	16,412,791.64
SEMPRA	323,773	69.77	22,589,642.21
SOUTHERN CO/THE	566,418	69.80	39,535,976.40

	VISTRA CORP	168,052	69.09	11,610,712.68	
	WEC ENERGY GROUP INC	160,659	80.01	12,854,326.59	
	XCEL ENERGY INC	301,014	52.27	15,734,001.78	
	ADVANCED MICRO DEVICES	851,136	179.65	152,906,582.40	
	ANALOG DEVICES INC	262,486	193.51	50,793,665.86	
	APPLIED MATERIALS INC	438,848	210.25	92,267,792.00	
	BROADCOM INC	233,980	1,353.47	316,684,910.60	
	ENPHASE ENERGY INC	69,133	114.61	7,923,333.13	
	ENTEGRIS INC	75,432	140.76	10,617,808.32	
	FIRST SOLAR INC	53,586	153.31	8,215,269.66	
	INTEL CORP	2,221,650	42.57	94,575,640.50	
	KLA CORP	71,817	710.56	51,030,287.52	
	LAM RESEARCH CORP	69,557	977.90	68,019,790.30	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	71,939	79.68	5,732,099.52	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	459,020	66.54	30,543,190.80	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	277,287	88.04	24,412,347.48	
	MICRON TECHNOLOGY INC	583,207	110.21	64,275,243.47	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	24,829	672.31	16,692,784.99	
	NVIDIA CORP	1,299,001	942.89	1,224,815,052.89	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	133,042	244.33	32,506,151.86	
	ON SEMICONDUCTOR	230,191	74.68	17,190,663.88	
	QORVO INC	47,965	114.38	5,486,236.70	
	QUALCOMM INC	589,007	170.10	100,190,090.70	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	83,794	105.57	8,846,132.58	
	TERADYNE INC	85,879	110.75	9,511,099.25	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	478,913	172.48	82,602,914.24	
	CBRE GROUP INC - A	154,213	96.59	14,895,433.67	
	COSTAR GROUP INC	218,844	95.72	20,947,747.68	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	487,100	3.13	1,524,623.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	82,122	50.83	4,174,261.26	
	アメリカドル 小計	178,897,228		23,676,461,707.83 (3,585,326,596,416)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	312,000	23.58	7,356,960.00	
	CAMECO CORP	227,900	58.78	13,395,962.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	570,300	100.79	57,480,537.00	
	CENOVUS ENERGY INC	731,500	26.35	19,275,025.00	

ENBRIDGE INC	1, 128, 100	48.21	54, 385, 701.00
IMPERIAL OIL LTD	106, 800	92.16	9, 842, 688.00
KEYERA CORP	124, 900	33.94	4, 239, 106.00
MEG ENERGY CORP	137, 000	30.63	4, 196, 310.00
PARKLAND CORP	59, 200	42.82	2, 534, 944.00
PEMBINA PIPELINE CORP	293, 932	47.28	13, 897, 104.96
SUNCOR ENERGY INC	667, 000	48.85	32, 582, 950.00
TC ENERGY CORP	539, 400	54.97	29, 650, 818.00
TOURMALINE OIL CORP	176, 100	59.63	10, 500, 843.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	250, 940	75.75	19, 008, 705.00
BARRICK GOLD CORP	896, 400	21.12	18, 931, 968.00
CCL INDUSTRIES INC - CL B	82, 500	71.14	5, 869, 050.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	400, 400	13.62	5, 453, 448.00
FRANCO-NEVADA CORP	101, 700	155.71	15, 835, 707.00
IVANHOE MINES LTD-CL A	329, 600	16.07	5, 296, 672.00
KINROSS GOLD CORP	677, 600	7.69	5, 210, 744.00
LUNDIN MINING CORP	362, 100	13.30	4, 815, 930.00
NUTRIEN LTD	253, 059	71.09	17, 989, 964.31
PAN AMERICAN SILVER CORP	166, 900	18.84	3, 144, 396.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	231, 500	59.34	13, 737, 210.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	26, 600	118.72	3, 157, 952.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	238, 000	61.11	14, 544, 180.00
CAE INC	166, 100	27.56	4, 577, 716.00
STANTEC INC	65, 700	116.98	7, 685, 586.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	49, 100	127.49	6, 259, 759.00
WSP GLOBAL INC	68, 400	229.27	15, 682, 068.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	211, 400	21.99	4, 648, 686.00
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	120, 300	48.11	5, 787, 633.00
RB GLOBAL INC	94, 600	104.70	9, 904, 620.00
THOMSON REUTERS CORP	80, 732	212.65	17, 167, 659.80
AIR CANADA	62, 200	18.83	1, 171, 226.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	280, 400	179.28	50, 270, 112.00
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	494, 100	121.52	60, 043, 032.00
TFI INTERNATIONAL INC	42, 800	219.06	9, 375, 768.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	134, 500	74.62	10, 036, 390.00
BRP INC/CA- SUB VOTING	15, 700	85.27	1, 338, 739.00

GILDAN ACTIVEWEAR INC	74,300	50.93	3,784,099.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	153,310	107.87	16,537,549.70
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	25,300	133.51	3,377,803.00
DOLLARAMA INC	153,500	101.32	15,552,620.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	394,700	77.90	30,747,130.00
EMPIRE CO LTD 'A'	55,300	32.95	1,822,135.00
LOBLAW COMPANIES LTD	82,100	152.83	12,547,343.00
METRO INC/CN	119,000	72.48	8,625,120.00
WESTON (GEORGE) LTD	36,011	184.75	6,653,032.25
SAPUTO INC	150,300	25.99	3,906,297.00
BANK OF MONTREAL	384,300	130.00	49,959,000.00
BANK OF NOVA SCOTIA	629,900	68.38	43,072,562.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	484,700	68.28	33,095,316.00
NATIONAL BANK OF CANADA	172,400	114.60	19,757,040.00
ROYAL BANK OF CANADA	741,300	135.26	100,268,238.00
TORONTO-DOMINION BANK	938,400	81.27	76,263,768.00
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	187,188	57.62	10,785,772.56
BROOKFIELD CORP	720,850	56.88	41,001,948.00
IGM FINANCIAL INC	39,400	35.06	1,381,364.00
ONEX CORPORATION	41,700	100.98	4,210,866.00
TMX GROUP LTD	127,600	33.80	4,312,880.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	10,700	1,504.46	16,097,722.00
GREAT-WEST LIFECO INC	133,600	42.97	5,740,792.00
IA FINANCIAL CORP INC	58,800	85.33	5,017,404.00
INTACT FINANCIAL CORP	96,500	219.30	21,162,450.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	965,300	32.66	31,526,698.00
POWER CORP OF CANADA	305,600	37.98	11,606,688.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	295,700	73.80	21,822,660.00
CGI INC	110,700	151.46	16,766,622.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	10,500	3,752.85	39,404,925.00
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	50,600	126.19	6,385,214.00
OPEN TEXT CORP	144,900	53.25	7,715,925.00
SHOPIFY INC - CLASS A	638,600	107.13	68,413,218.00
BCE INC	57,900	45.86	2,655,294.00
QUEBECOR INC -CL B	98,000	30.12	2,951,760.00
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	175,400	56.18	9,853,972.00

	TELUS CORP	231,200	21.76	5,030,912.00	
	ALTAGAS LTD	172,600	29.14	5,029,564.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	54,950	33.00	1,813,350.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	58,500	30.77	1,800,045.00	
	EMERA INC	160,600	47.68	7,657,408.00	
	FORTIS INC	276,200	53.79	14,856,798.00	
	HYDRO ONE LTD	169,900	40.71	6,916,629.00	
	NORTHLAND POWER INC	148,200	22.65	3,356,730.00	
	FIRSTSERVICE CORP	24,100	225.71	5,439,611.00	
	カナダドル 小計	21,138,072		1,402,968,144.58 (156,038,117,040)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	111,261	40.29	4,482,705.69	
	SANTOS LTD	1,632,935	7.50	12,247,012.50	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	986,208	29.73	29,319,963.84	
	BHP GROUP LTD	2,675,882	43.79	117,176,872.78	
	BLUESCOPE STEEL LTD	246,529	22.74	5,606,069.46	
	FORTESCUE LTD	858,136	24.64	21,144,471.04	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	228,836	60.50	13,844,578.00	
	MINERAL RESOURCES LTD	95,706	69.15	6,618,069.90	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	568,880	13.72	7,805,033.60	
	ORICA LTD	225,412	17.51	3,946,964.12	
	PILBARA MINERALS LTD	1,540,998	3.91	6,025,302.18	
	RIO TINTO LTD	190,497	120.56	22,966,318.32	
	SOUTH32 LTD	2,464,507	2.91	7,171,715.37	
	REECE LTD	130,639	27.65	3,612,168.35	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	92,198	40.86	3,767,210.28	
	BRAMBLES LTD	723,076	15.37	11,113,678.12	
	COMPUTERSHARE LTD	288,146	25.64	7,388,063.44	
	AURIZON HOLDINGS LTD	799,349	4.00	3,197,396.00	
	QANTAS AIRWAYS LTD	318,258	5.29	1,683,584.82	
	TRANSURBAN GROUP	1,582,783	13.00	20,576,179.00	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	316,075	43.66	13,799,834.50	
	IDP EDUCATION LTD	98,033	18.49	1,812,630.17	
	LOTTERY CORP LTD/THE	1,165,622	5.21	6,072,890.62	
	CAR GROUP LTD	174,947	35.88	6,277,098.36	
	REA GROUP LTD	32,440	185.75	6,025,730.00	

	SEEK LTD	199,466	25.22	5,030,532.52	
	WESFARMERS LTD	606,497	67.24	40,780,858.28	
	COLES GROUP LTD	725,274	16.49	11,959,768.26	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	801,622	5.28	4,232,564.16	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	627,988	32.32	20,296,572.16	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	476,918	12.24	5,837,476.32	
	COCHLEAR LTD	32,214	331.75	10,686,994.50	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	89,028	55.00	4,896,540.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	252,714	28.54	7,212,457.56	
	CSL LTD	256,663	280.94	72,106,903.22	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	1,598,137	29.04	46,409,898.48	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	881,894	117.48	103,604,907.12	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,652,280	34.76	57,433,252.80	
	WESTPAC BANKING CORP	1,858,135	26.47	49,184,833.45	
	ASX LTD	113,672	66.52	7,561,461.44	
	MACQUARIE GROUP LTD	195,448	199.00	38,894,152.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	138,803	35.01	4,859,493.03	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,221,541	6.32	7,720,139.12	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	1,517,475	3.72	5,645,007.00	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	816,152	17.87	14,584,636.24	
	SUNCORP GROUP LTD	676,331	16.30	11,024,195.30	
	WISETECH GLOBAL LTD	85,300	95.78	8,170,034.00	
	XERO LTD	75,597	135.29	10,227,518.13	
	TELSTRA GROUP LTD	2,180,806	3.76	8,199,830.56	
	APA GROUP	737,148	8.23	6,066,728.04	
	ORIGIN ENERGY LTD	844,040	9.13	7,706,085.20	
	オーストラリアドル 小計	36,208,496		914,014,379.35 (90,158,378,379)	
イギリスポンド	BP PLC	9,034,951	4.98	45,070,853.06	
	SHELL PLC	3,428,155	26.32	90,229,039.60	
	ANGLO AMERICAN PLC	643,977	19.29	12,424,892.23	
	ANTOFAGASTA PLC	229,746	20.07	4,611,002.22	
	CRH PLC	370,777	68.24	25,301,822.48	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	61,968	50.92	3,155,410.56	
	ENDEAVOUR MINING PLC	106,898	14.58	1,558,572.84	
	GLENORE PLC	5,530,451	4.28	23,717,339.11	

MONDI PLC	239,805	13.63	3,269,741.17
RIO TINTO PLC	580,829	49.97	29,024,025.13
ASHTED GROUP PLC	225,284	55.94	12,602,386.96
BAE SYSTEMS PLC	1,569,662	13.63	21,402,341.37
BUNZL PLC	171,510	30.73	5,270,502.30
DCC PLC	56,482	56.84	3,210,436.88
MELROSE INDUSTRIES PLC	662,878	6.70	4,441,282.60
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	4,492,841	4.19	18,865,439.35
SMITHS GROUP PLC	180,764	16.80	3,036,835.20
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	35,331	105.95	3,743,319.45
EXPERIAN PLC	475,954	34.86	16,591,756.44
INTERTEK GROUP PLC	82,511	49.13	4,053,765.43
RELX PLC	996,110	34.58	34,445,483.80
RENTOKIL INITIAL PLC	1,426,851	4.69	6,704,772.84
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	519,922	4.74	2,467,029.89
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	65,065	47.73	3,105,552.45
BURBERRY GROUP PLC	223,981	11.83	2,650,815.13
PERSIMMON PLC	151,061	13.36	2,018,174.96
TAYLOR WIMPEY PLC	1,572,933	1.40	2,212,330.26
COMPASS GROUP PLC	873,085	22.66	19,784,106.10
ENTAIN PLC	318,737	7.84	2,500,173.02
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	94,856	171.95	16,310,489.20
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	88,617	81.58	7,229,374.86
PEARSON PLC	322,789	10.37	3,348,935.87
WHITBREAD PLC	109,945	32.92	3,619,389.40
AUTO TRADER GROUP PLC	520,853	7.62	3,970,983.27
INFORMA PLC	723,961	8.35	6,049,418.11
WPP PLC	574,384	7.42	4,261,929.28
JD SPORTS FASHION PLC	1,458,356	1.09	1,600,545.71
KINGFISHER PLC	1,064,697	2.33	2,487,132.19
NEXT PLC	62,633	91.92	5,757,225.36
OCADO GROUP PLC	232,705	4.68	1,089,757.51
SAINSBURY (J) PLC	864,017	2.56	2,218,795.65
TESCO PLC	3,594,831	2.94	10,575,992.80
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	178,973	24.26	4,341,884.98
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,043,296	23.76	24,788,712.96

COCA-COLA HBC AG-DI	102,274	24.79	2,535,372.46
DIAGEO PLC	1,186,455	29.01	34,419,059.55
IMPERIAL BRANDS PLC	423,171	17.34	7,337,785.14
HALEON PLC	3,640,669	3.28	11,961,417.99
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	384,572	44.06	16,944,242.32
UNILEVER PLC	1,317,139	39.76	52,376,032.33
SMITH & NEPHEW PLC	437,711	10.39	4,547,817.29
ASTRAZENECA PLC	818,035	104.82	85,746,428.70
GSK PLC	2,124,171	16.86	35,830,516.42
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	72,292	19.15	1,384,753.26
BARCLAYS PLC	7,782,671	1.80	14,071,069.16
HSBC HOLDINGS PLC	10,109,235	6.24	63,172,609.51
LLOYDS BANKING GROUP PLC	32,574,857	0.52	16,997,560.38
NATWEST GROUP PLC	3,044,015	2.61	7,947,923.16
STANDARD CHARTERED PLC	1,163,430	6.72	7,825,230.18
3I GROUP PLC	491,715	27.61	13,576,251.15
ABRDN PLC	805,516	1.45	1,172,831.29
HARGREAVES LANSDOWN PLC	208,222	7.18	1,495,033.96
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	222,266	96.52	21,453,114.32
M&G PLC	1,211,540	2.38	2,893,157.52
SCHRODERS PLC	465,209	3.77	1,755,233.55
ST JAMES' S PLACE PLC	312,234	4.58	1,431,905.12
WISE PLC - A	304,193	9.73	2,960,406.27
ADMIRAL GROUP PLC	145,253	28.18	4,093,229.54
AVIVA PLC	1,466,553	4.94	7,252,104.58
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,328,554	2.56	8,527,755.34
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	427,896	5.29	2,264,425.63
PRUDENTIAL PLC	1,408,407	7.78	10,963,040.08
SAGE GROUP PLC/THE	521,667	12.61	6,580,829.20
HALMA PLC	207,364	23.41	4,854,391.24
BT GROUP PLC	3,495,838	1.07	3,761,521.68
VODAFONE GROUP PLC	12,220,327	0.68	8,362,369.76
CENTRICA PLC	2,862,357	1.26	3,633,762.21
NATIONAL GRID PLC	1,988,860	10.66	21,211,191.90
SEVERN TRENT PLC	147,941	25.68	3,799,124.88
SSE PLC	557,418	16.19	9,024,597.42

	UNITED UTILITIES GROUP PLC	366,180	10.53	3,855,875.40
	イギリスポンド 小計	143,609,639		1,013,139,739.87 (193,215,879,790)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	99,007	12.30	1,217,786.10
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	3,236	689.00	2,229,604.00
	GIVAUDAN-REG	4,942	4,105.00	20,286,910.00
	HOLCIM LTD	270,658	80.54	21,798,795.32
	SIG GROUP AG	180,750	19.59	3,540,892.50
	SIKA AG-REG	79,478	270.40	21,490,851.20
	ABB LTD-REG	828,677	42.81	35,475,662.37
	GEBERIT AG-REG	17,833	535.40	9,547,788.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	11,030	224.40	2,475,132.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	22,674	233.30	5,289,844.20
	VAT GROUP AG	14,382	473.90	6,815,629.80
	ADECCO GROUP AG-REG	89,253	34.97	3,121,177.41
	SGS SA-REG	79,187	87.02	6,890,852.74
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	28,395	243.90	6,925,540.50
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	285,308	134.25	38,302,599.00
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	15,105	200.80	3,033,084.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	14,795	39.15	579,224.25
	AVOLTA AG	58,100	33.84	1,966,104.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	1,816	1,319.00	2,395,304.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	516	10,890.00	5,619,240.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	55	108,400.00	5,962,000.00
	NESTLE SA-REG	1,406,774	94.36	132,743,194.64
	ALCON INC	267,563	74.92	20,045,819.96
	SONOVA HOLDING AG-REG	25,802	262.40	6,770,444.80
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	57,574	141.95	8,172,629.30
	BACHEM HOLDING AG	12,632	83.20	1,050,982.40
	LONZA GROUP AG-REG	39,935	529.80	21,157,563.00
	NOVARTIS AG-REG	1,079,615	86.51	93,397,493.65
	ROCHE HOLDING AG-BR	17,136	237.00	4,061,232.00
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	370,929	225.30	83,570,303.70
SANDOZ GROUP AG	196,209	27.00	5,297,643.00	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	14,828	104.20	1,545,077.60	
JULIUS BAER GROUP LTD	101,083	51.80	5,236,099.40	

	PARTNERS GROUP HOLDING AG	12,277	1,303.50	16,003,069.50	
	UBS GROUP AG-REG	1,738,452	27.97	48,624,502.44	
	BALOISE HOLDING AG - REG	24,788	142.40	3,529,811.20	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	20,883	124.40	2,597,845.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	15,249	640.80	9,771,559.20	
	SWISS RE AG	162,404	115.60	18,773,902.40	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	75,714	484.90	36,713,718.60	
	TEMENOS AG - REG	34,525	65.32	2,255,173.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	89,920	81.42	7,321,286.40	
	SWISSCOM AG-REG	12,427	535.60	6,655,901.20	
	BKW AG	9,300	137.30	1,276,890.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	41,126	88.50	3,639,651.00	
	スイスフラン 小計	7,932,342		745,175,815.18 (125,606,835,406)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,515,868	39.35	59,649,405.80	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	696,000	103.90	72,314,400.00	
	MTR CORP	706,500	25.45	17,980,425.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	622,000	13.54	8,421,880.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,163,000	39.75	46,229,250.00	
	SANDS CHINA LTD	1,265,600	22.15	28,033,040.00	
	WH GROUP LTD	3,953,000	5.16	20,397,480.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,992,000	21.00	41,832,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	379,500	87.80	33,320,100.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	660,800	238.20	157,402,560.00	
	AIA GROUP LTD	6,057,000	55.95	338,889,150.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	1,589,000	9.17	14,571,130.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	253,000	46.60	11,789,800.00	
	CLP HOLDINGS LTD	855,000	62.75	53,651,250.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	5,821,348	6.22	36,208,784.56	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	675,500	46.70	31,545,850.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	978,868	32.85	32,155,813.80	
	ESR GROUP LTD	1,052,000	7.45	7,837,400.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	724,000	8.25	5,973,000.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	965,641	23.55	22,740,845.55	
	SINO LAND CO	1,773,400	8.24	14,612,816.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	761,500	74.30	56,579,450.00	

	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	221,500	63.15	13,987,725.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	500,800	16.38	8,203,104.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	527,000	25.20	13,280,400.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,110,000	25.90	28,749,000.00	
	香港ドル 小計	36,819,825		1,176,356,059.71 (22,774,253,315)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	30,200	24.35	735,370.00	
	KEPPEL LTD	801,600	7.35	5,891,760.00	
	SEATRIM LTD	15,794,803	0.07	1,247,789.43	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	754,200	3.99	3,009,258.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	860,940	6.42	5,527,234.80	
	GENTING SINGAPORE LTD	2,772,500	0.88	2,453,662.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	897,000	3.39	3,040,830.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	943,300	35.83	33,798,439.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,768,400	13.60	24,050,240.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	644,000	29.07	18,721,080.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	409,000	9.33	3,815,970.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,413,360	2.53	11,165,800.80	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	348,700	5.28	1,841,136.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	1,432,100	2.73	3,909,633.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	224,100	5.91	1,324,431.00	
	シンガポールドル 小計	32,094,203		120,532,634.53 (13,523,761,594)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	743,217	8.18	6,079,515.06	
	EBOS GROUP LTD	54,700	35.60	1,947,320.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	313,297	26.04	8,158,253.88	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	788,533	4.81	3,792,843.73	
	MERCURY NZ LTD	288,052	6.78	1,952,992.56	
	MERIDIAN ENERGY LTD	765,945	5.94	4,549,713.30	
	ニュージーランドドル 小計	2,953,744		26,480,638.53 (2,403,117,946)	
スウェーデンクローネ	BOLIDEN AB	142,133	300.75	42,746,499.75	
	HOLMEN AB-B SHARES	33,017	444.30	14,669,453.10	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	304,602	162.30	49,436,904.60	
	ALFA LAVAL AB	159,289	438.20	69,800,439.80	
	ASSA ABLOY AB-B	537,275	313.90	168,650,622.50	

ATLAS COPCO AB-A SHS	1, 404, 386	187.00	262, 620, 182.00	
ATLAS COPCO AB-B SHS	859, 982	166.35	143, 058, 005.70	
BEIJER REF AB	222, 900	141.10	31, 451, 190.00	
EPIROC AB-A	337, 627	208.40	70, 361, 466.80	
EPIROC AB-B	210, 487	187.40	39, 445, 263.80	
HUSQVARNA AB-B SHS	159, 232	90.20	14, 362, 726.40	
INDUTRADE AB	150, 700	295.40	44, 516, 780.00	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	58, 459	282.50	16, 514, 667.50	
LIFCO AB-B SHS	130, 200	291.50	37, 953, 300.00	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	745, 899	51.70	38, 562, 978.30	
SAAB AB-B	40, 100	934.40	37, 469, 440.00	
SANDVIK AB	557, 653	246.20	137, 294, 168.60	
SKANSKA AB-B SHS	209, 707	193.85	40, 651, 701.95	
SKF AB-B SHARES	208, 393	231.80	48, 305, 497.40	
VOLVO AB-A SHS	76, 112	317.60	24, 173, 171.20	
VOLVO AB-B SHS	808, 013	314.95	254, 483, 694.35	
SECURITAS AB-B SHS	235, 929	108.00	25, 480, 332.00	
VOLVO CAR AB-B	442, 279	38.56	17, 054, 278.24	
EVOLUTION AB	92, 625	1, 245.80	115, 392, 225.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	375, 134	152.14	57, 072, 886.76	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	316, 309	241.80	76, 483, 516.20	
GETINGE AB-B SHS	131, 116	208.20	27, 298, 351.20	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	93, 763	269.20	25, 240, 999.60	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	801, 012	147.95	118, 509, 725.40	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	803, 955	109.05	87, 671, 292.75	
SWEDBANK AB - A SHARES	427, 225	224.00	95, 698, 400.00	
EQT AB	212, 742	349.50	74, 353, 329.00	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	44, 871	372.90	16, 732, 395.90	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	89, 196	371.90	33, 171, 992.40	
INVESTOR AB-B SHS	898, 695	269.45	242, 153, 367.75	
LUNDBERGS AB-B SHS	43, 685	591.80	25, 852, 783.00	
ERICSSON LM-B SHS	1, 531, 407	57.40	87, 902, 761.80	
HEXAGON AB-B SHS	1, 050, 335	127.60	134, 022, 746.00	
TELE2 AB-B SHS	367, 709	86.98	31, 983, 328.82	
TELIA CO AB	1, 284, 253	26.73	34, 328, 082.69	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	296, 348	77.26	22, 895, 846.48	

	SAGAX AB-B	105,140	277.00	29,123,780.00	
	スウェーデンクローネ 小計	16,999,894		2,964,950,574.74 (42,487,741,736)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	166,028	270.30	44,877,368.40	
	EQUINOR ASA	448,379	286.80	128,595,097.20	
	NORSK HYDRO ASA	701,222	60.90	42,704,419.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	83,488	343.30	28,661,430.40	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	46,700	737.00	34,417,900.00	
	ADEVINTA ASA	214,807	113.50	24,380,594.50	
	MOWI ASA	251,136	202.10	50,754,585.60	
	ORKLA ASA	312,992	76.32	23,887,549.44	
	SALMAR ASA	40,591	714.00	28,981,974.00	
	DNB BANK ASA	455,082	212.60	96,750,433.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	114,704	156.80	17,985,587.20	
	TELENOR ASA	333,379	118.10	39,372,059.90	
	ノルウェークローネ 小計	3,168,508		561,368,999.64 (7,898,461,824)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	185,052	408.90	75,667,762.80	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	3,501	2,222.00	7,779,222.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	544,248	200.65	109,203,361.20	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	870	8,945.00	7,782,150.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	2,834	9,130.00	25,874,420.00	
	DSV A/S	90,805	1,115.00	101,247,575.00	
	PANDORA A/S	44,829	1,122.00	50,298,138.00	
	CARLSBERG AS-B	50,000	927.60	46,380,000.00	
	COLOPLAST-B	70,770	931.80	65,943,486.00	
	DEMANT A/S	60,610	344.40	20,874,084.00	
	GENMAB A/S	34,576	2,082.00	71,987,232.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	1,717,638	887.20	1,523,888,433.60	
	DANSKE BANK A/S	358,091	203.60	72,907,327.60	
	TRYG A/S	186,282	140.55	26,181,935.10	
	ORSTED A/S	94,899	380.90	36,147,029.10	
	デンマーククローネ 小計	3,445,005		2,242,162,156.40 (49,193,037,711)	
イスラエルシケル	ICL GROUP LTD	547,223	19.68	10,769,348.64	
	ELBIT SYSTEMS LTD	14,469	736.80	10,660,759.20	

	BANK HAPOALIM BM	615,641	33.88	20,857,917.08	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	900,703	29.87	26,903,998.61	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	759,946	18.47	14,036,202.62	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	63,104	134.60	8,493,798.40	
	NICE LTD	32,481	914.20	29,694,130.20	
	AZRIELI GROUP LTD	14,806	270.00	3,997,620.00	
	イスラエルシェケル 小計	2,948,373		125,413,774.75 (5,222,229,580)	
ユーロ	ENI SPA	1,123,284	14.35	16,123,618.53	
	GALP ENERGIA SGPS SA	244,234	15.06	3,678,164.04	
	NESTE OYJ	240,492	24.68	5,935,342.56	
	OMV AG	76,362	43.02	3,285,093.24	
	REPSOL SA	673,115	15.28	10,285,197.20	
	TENARIS SA	260,856	18.26	4,763,230.56	
	TOTALENERGIES SE	1,143,761	62.85	71,885,378.85	
	AIR LIQUIDE SA	277,738	190.48	52,903,534.24	
	AKZO NOBEL N.V.	91,917	66.58	6,119,833.86	
	ARCELORMITTAL	264,434	24.99	6,609,527.83	
	ARKEMA	35,633	94.98	3,384,422.34	
	BASF SE	464,782	52.72	24,503,307.04	
	COVESTRO AG	104,095	50.58	5,265,125.10	
	DSM-FIRMENICH AG	96,644	106.14	10,257,794.16	
	EVONIK INDUSTRIES AG	123,314	17.95	2,214,102.87	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	73,831	99.12	7,318,128.72	
	OCI NV	34,955	25.33	885,410.15	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	134,656	41.72	5,617,848.32	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	298,391	12.66	3,779,122.01	
	SYENSCO SA	37,756	86.70	3,273,445.20	
	SYMRISE AG	70,651	110.70	7,821,065.70	
	UMICORE	118,677	21.00	2,492,217.00	
	UPM-KYMMENE OYJ	271,685	30.68	8,335,295.80	
	VOESTALPINE AG	62,408	25.92	1,617,615.36	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	99,597	40.46	4,029,694.62	
	AIRBUS SE	314,025	169.90	53,352,847.50	
	ALSTOM	192,488	13.11	2,523,517.68	
	BOUYGUES SA	103,648	37.76	3,913,748.48	

BRENTAG SE	71,852	79.00	5,676,308.00
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	235,479	70.87	16,688,396.73
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	271,444	46.54	12,633,003.76
DASSAULT AVIATION SA	9,266	192.90	1,787,411.40
EIFFAGE	38,587	103.80	4,005,330.60
FERROVIAL SE	265,630	36.92	9,807,059.60
GEA GROUP AG	88,362	39.67	3,505,320.54
IMCD NV	29,880	167.60	5,007,888.00
KINGSPAN GROUP PLC	79,503	84.28	6,700,512.84
KNORR-BREMSE AG	40,814	69.78	2,848,000.92
KONE OYJ-B	180,414	43.03	7,763,214.42
LEGRAND SA	135,000	98.52	13,300,200.00
LEONARDO SPA	188,516	22.36	4,215,217.76
METSO CORP	358,750	11.07	3,971,362.50
MTU AERO ENGINES AG	28,240	230.00	6,495,200.00
PRYSMIAN SPA	139,842	49.39	6,906,796.38
RATIONAL AG	2,060	770.00	1,586,200.00
REXEL SA	122,383	25.34	3,101,185.22
RHEINMETALL AG	21,843	500.40	10,930,237.20
SAFRAN SA	182,530	207.25	37,829,342.50
SCHNEIDER ELECTRIC SE	287,746	218.05	62,743,015.30
SIEMENS AG-REG	401,469	175.40	70,417,662.60
SIEMENS ENERGY AG	300,754	16.52	4,969,959.85
THALES SA	52,989	157.20	8,329,870.80
VINCI SA	265,247	116.36	30,864,140.92
WARTSILA OYJ ABP	210,609	14.35	3,022,239.15
BUREAU VERITAS SA	155,284	27.74	4,307,578.16
RANDSTAD NV	52,875	51.26	2,710,372.50
TELEPERFORMANCE	29,501	91.20	2,690,491.20
WOLTERS KLUWER	133,712	146.65	19,608,864.80
ADP	17,115	126.60	2,166,759.00
AENA SME SA	40,448	180.10	7,284,684.80
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	338,250	7.06	2,390,074.50
DHL GROUP	531,440	39.75	21,124,740.00
GETLINK SE	172,576	16.13	2,784,513.76
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	163,505	104.12	17,024,140.60

BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	27,087	98.70	2,673,486.90
CONTINENTAL AG	51,684	66.32	3,427,682.88
DR ING HC F PORSCHE AG	58,770	93.52	5,496,170.40
FERRARI NV	65,147	401.50	26,156,520.50
MERCEDES-BENZ GROUP AG	415,761	73.50	30,558,433.50
MICHELIN (CGDE)	344,899	35.45	12,226,669.55
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	83,301	49.00	4,081,749.00
RENAULT SA	114,124	45.43	5,185,223.94
STELLANTIS NV	1,145,526	26.93	30,854,742.81
VOLKSWAGEN AG	19,218	137.60	2,644,396.80
VOLKSWAGEN AG-PREF	106,660	118.08	12,594,412.80
ADIDAS AG	82,332	200.25	16,486,983.00
HERMES INTERNATIONAL	16,391	2,386.00	39,108,926.00
KERING	38,430	358.05	13,759,861.50
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	145,728	828.60	120,750,220.80
MONCLER SPA	104,582	68.16	7,128,309.12
PUMA SE	43,656	39.20	1,711,315.20
SEB SA	9,694	115.70	1,121,595.80
ACCOR SA	103,418	42.67	4,412,846.06
AMADEUS IT GROUP SA	230,406	59.30	13,663,075.80
DELIVERY HERO SE	104,269	26.98	2,813,177.62
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	68,879	37.42	2,577,452.18
SODEXO SA	45,147	78.68	3,552,165.96
BOLLORE SE	416,392	6.19	2,577,466.48
PUBLICIS GROUPE	117,189	99.36	11,643,899.04
SCOUT24 SE	41,543	68.08	2,828,247.44
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	418,246	27.47	11,489,217.62
VIVENDI SE	404,329	10.00	4,045,311.64
D' IETEREN GROUP	13,308	202.00	2,688,216.00
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	565,617	46.23	26,148,473.91
PROSUS NV	749,946	27.74	20,803,502.04
ZALANDO SE	125,157	24.66	3,086,371.62
CARREFOUR SA	330,839	16.06	5,314,928.53
JERONIMO MARTINS	169,984	18.68	3,175,301.12
KESKO OYJ-B SHS	133,348	17.32	2,310,254.10
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	498,002	27.32	13,607,904.65

ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	458,055	55.17	25,270,894.35
DANONE	334,872	59.57	19,948,325.04
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	367,895	9.21	3,388,312.95
HEINEKEN HOLDING NV	65,661	72.35	4,750,573.35
HEINEKEN NV	157,616	86.38	13,614,870.08
JDE PEET' S NV	53,600	20.44	1,095,584.00
KERRY GROUP PLC-A	86,856	81.72	7,097,872.32
LOTUS BAKERIES	163	8,850.00	1,442,550.00
PERNOD RICARD SA	111,019	148.15	16,447,464.85
REMY COINTREAU	9,646	92.36	890,904.56
BEIERSDORF AG	56,324	133.00	7,491,092.00
HENKEL AG & CO KGAA	57,972	65.72	3,809,919.84
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	85,868	72.08	6,189,365.44
L' OREAL	127,086	432.65	54,983,757.90
AMPLIFON SPA	68,691	31.85	2,187,808.35
BIOMERIEUX	22,555	100.60	2,269,033.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	22,646	118.25	2,677,889.50
DIASORIN SPA	9,103	88.18	802,702.54
ESSILORLUXOTTICA	152,259	208.70	31,776,453.30
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	102,446	34.61	3,545,656.06
FRESENIUS SE & CO KGAA	203,543	24.75	5,037,689.25
KONINKLIJKE PHILIPS NV	398,231	18.58	7,399,131.98
SIEMENS HEALTHINEERS AG	147,240	55.36	8,151,206.40
ARGENX SE	31,005	370.10	11,474,950.50
BAYER AG-REG	502,242	26.74	13,432,462.29
EUROFINS SCIENTIFIC	69,815	55.96	3,906,847.40
GRIFOLS SA	126,564	7.91	1,001,627.49
IPSEN	21,710	109.10	2,368,561.00
MERCK KGAA	70,217	161.80	11,361,110.60
ORION OYJ-CLASS B	50,154	34.80	1,745,359.20
QIAGEN N. V.	131,652	39.98	5,264,105.22
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	58,531	52.36	3,064,683.16
SANOFI	602,252	88.65	53,389,639.80
SARTORIUS AG-VORZUG	12,941	381.70	4,939,579.70
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	13,983	280.00	3,915,240.00
UCB SA	68,376	114.25	7,811,958.00

ABN AMRO BANK NV-CVA	220,601	15.34	3,384,019.34
AIB GROUP PLC	865,126	4.48	3,882,685.48
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,025,315	10.90	32,975,933.50
BANCO BPM SPA	723,370	6.02	4,360,474.36
BANCO SANTANDER SA	8,636,005	4.36	37,709,115.83
BANK OF IRELAND GROUP PLC	523,076	9.09	4,754,760.84
BNP PARIBAS	549,789	62.80	34,526,749.20
CAIXABANK SA	1,977,800	4.73	9,370,816.40
COMMERZBANK AG	549,585	12.47	6,853,324.95
CREDIT AGRICOLE SA	530,480	13.40	7,108,432.00
ERSTE GROUP BANK AG	176,125	40.24	7,087,270.00
FINECOBANK SPA	326,073	13.73	4,476,982.29
ING GROEP NV	1,727,493	14.65	25,318,137.40
INTESA SANPAOLO	7,883,189	3.29	25,975,107.75
KBC GROUP NV	137,336	68.26	9,374,555.36
MEDIOBANCA SPA	298,281	13.40	3,996,965.40
NORDEA BANK ABP	1,651,811	10.43	17,228,388.73
SOCIETE GENERALE SA	386,842	24.52	9,487,300.05
UNICREDIT SPA	803,772	33.59	27,002,720.34
ADYEN NV	11,105	1,500.00	16,657,500.00
AMUNDI SA	42,569	62.85	2,675,461.65
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	998,804	14.17	14,161,043.11
DEUTSCHE BOERSE AG	101,770	185.60	18,888,512.00
EDENRED	121,828	49.84	6,071,907.52
EURAZEO SE	19,619	80.90	1,587,177.10
EURONEXT NV	49,351	87.45	4,315,744.95
EXOR NV	49,620	103.60	5,140,632.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	40,261	69.32	2,790,892.52
NEXI SPA	338,814	5.91	2,004,423.62
SOFINA	9,693	201.60	1,954,108.80
WORLDLINE SA	93,323	10.75	1,003,222.25
AEGON LTD	856,692	5.53	4,737,506.76
AGEAS	85,112	40.75	3,468,314.00
ALLIANZ SE-REG	206,930	271.85	56,253,920.50
ASR NEDERLAND NV	95,241	43.72	4,163,936.52
ASSICURAZIONI GENERALI	510,440	23.20	11,842,208.00

AXA SA	936,362	34.48	32,285,761.76
HANNOVER RUECK SE	29,464	247.10	7,280,554.40
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	72,445	436.50	31,622,242.50
NN GROUP NV	133,570	41.67	5,565,861.90
POSTE ITALIANE SPA	269,406	11.44	3,082,004.64
SAMPO OYJ-A SHS	235,831	40.36	9,518,139.16
TALANX AG	40,850	71.65	2,926,902.50
BECHTLE AG	39,938	47.50	1,897,055.00
CAPGEMINI SE	80,635	215.70	17,392,969.50
DASSAULT SYSTEMES SE	358,943	41.64	14,946,386.52
NEMETSCHEK SE	32,589	89.94	2,931,054.66
SAP SE	551,166	180.28	99,364,206.48
NOKIA OYJ	2,735,040	3.28	8,988,708.96
CELLNEX TELECOM SA	242,115	33.48	8,106,010.20
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,703,519	21.85	37,230,407.74
ELISA OYJ	88,430	42.63	3,769,770.90
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	180,053	10.54	1,897,758.62
KONINKLIJKE KPN NV	1,778,922	3.37	5,994,967.14
ORANGE	961,890	10.62	10,215,271.80
TELECOM ITALIA SPA	3,630,827	0.21	781,353.97
TELEFONICA SA	2,489,293	3.96	9,880,003.91
ACCIONA SA	13,178	111.15	1,464,734.70
E.ON SE	1,152,009	12.45	14,348,272.09
EDP RENOVAVEIS SA	131,444	12.95	1,702,199.80
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,709,490	3.60	6,157,582.98
ELIA GROUP SA/NV	17,969	102.20	1,836,431.80
ENAGAS SA	120,868	13.42	1,622,048.56
ENDESA SA	199,107	16.64	3,313,140.48
ENEL SPA	4,323,614	6.08	26,291,896.73
ENGIE	925,077	15.43	14,273,938.11
FORTUM OYJ	254,538	11.86	3,020,093.37
IBERDROLA SA	3,254,141	11.29	36,739,251.89
REDEIA CORP SA	220,809	15.97	3,526,319.73
RWE AG	323,767	31.15	10,085,342.05
SNAM SPA	1,023,585	4.36	4,464,877.77
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	732,192	7.72	5,655,451.00

	VEOLIA ENVIRONNEMENT	350,365	29.64	10,384,818.60	
	VERBUND AG	48,497	68.05	3,300,220.85	
	ASM INTERNATIONAL NV	24,165	574.00	13,870,710.00	
	ASML HOLDING NV	212,359	906.10	192,418,489.90	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	37,508	147.25	5,523,053.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	699,507	31.21	21,835,111.00	
	STMICROELECTRONICS NV	346,699	39.95	13,852,358.54	
	LEG IMMOBILIEN SE	41,849	78.00	3,264,222.00	
	VONOVIA SE	384,665	26.70	10,270,555.50	
	ユーロ 小計	92,707,073		2,743,509,382.23 (448,838,134,932)	
	合 計	578,922,402		4,742,686,545,669 (4,742,686,545,669)	

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
アメリカ ドル	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	87,367	10,967,179.51	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	170,912	6,209,232.96	
		AMERICAN TOWER CORP	246,427	47,508,661.33	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	73,030	13,376,905.10	
		BOSTON PROPERTIES INC	73,566	4,654,520.82	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	53,715	5,275,887.30	
		CROWN CASTLE INC	225,009	23,130,925.20	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	157,071	21,755,904.21	
		EQUINIX INC	49,643	39,762,553.71	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	94,973	6,141,903.91	
		EQUITY RESIDENTIAL	182,584	11,351,247.28	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	32,716	7,916,944.84	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	113,426	16,033,899.36	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	138,287	6,236,743.70	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	357,160	6,264,586.40	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	370,078	7,716,126.30	
INVITATION HOMES INC	314,306	10,871,844.54			

		IRON MOUNTAIN INC	147,169	11,694,048.74	
		KIMCO REALTY CORP	388,713	7,420,531.17	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	61,851	8,093,203.35	
		PROLOGIS INC	488,681	62,854,150.22	
		PUBLIC STORAGE	81,918	22,885,431.66	
		REALTY INCOME CORP	449,235	23,396,158.80	
		REGENCY CENTERS CORP	92,410	5,483,609.40	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	55,141	11,881,231.27	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	173,354	26,325,538.44	
		SUN COMMUNITIES INC	64,459	8,288,782.81	
		UDR INC	183,019	6,800,986.04	
		VENTAS INC	209,135	9,068,093.60	
		VICI PROPERTIES INC	536,294	15,455,993.08	
		WELLTOWER INC	286,192	26,352,559.36	
		WEYERHAEUSER CO	369,860	13,170,714.60	
		WP CAREY INC	115,948	6,488,450.08	
アメリカドル合計			6,443,649	510,834,549.09	(77,355,675,768)
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	36,100	1,703,559.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	58,600	1,075,896.00	
カナダドル合計			94,700	2,779,455.00	(309,130,985)
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS/AU	603,939	4,662,409.08	
		GOODMAN GROUP	893,369	28,632,476.45	
		GPT GROUP	891,183	4,010,323.50	
		MIRVAC GROUP	2,214,980	4,939,405.40	
		SCENTRE GROUP	2,622,903	8,891,641.17	
		STOCKLAND	1,319,965	6,309,432.70	
		VICINITY CENTRES	1,843,215	3,870,751.50	
オーストラリアドル合計			10,389,554	61,316,439.80	(6,048,253,621)
イギリスポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	352,124	2,292,327.24	
		SEGRO PLC	726,973	6,528,217.54	
イギリスポンド合計			1,079,097	8,820,544.78	(1,682,166,094)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	1,336,000	46,359,200.00	

香港ドル合計			1,336,000	46,359,200.00 (897,514,112)
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	2,228,300	6,105,542.00
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	2,977,171	5,865,026.87
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,470,700	2,147,222.00
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	1,782,700	2,264,029.00
シンガポールドル合計			8,458,871	16,381,819.87 (1,838,040,189)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	26,523	1,209,448.80
		GECINA SA	24,517	2,275,177.60
		KLEPIERRE	129,417	3,041,299.50
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	64,908	4,778,526.96
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	98,953	2,552,987.40
ユーロ合計			344,318	13,857,440.26 (2,267,077,226)
合計				90,397,857,995 (90,397,857,995)

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 590 銘柄	97.89%	—	74.18%
	投資証券 33 銘柄	—	2.11%	1.60%
カナダドル	株式 85 銘柄	99.80%	—	3.23%
	投資証券 2 銘柄	—	0.20%	0.01%
オーストラリアドル	株式 51 銘柄	93.71%	—	1.87%
	投資証券 7 銘柄	—	6.29%	0.13%
イギリスポンド	株式 81 銘柄	99.14%	—	4.00%
	投資証券 2 銘柄	—	0.86%	0.03%
スイスフラン	株式 45 銘柄	100.00%	—	2.60%
香港ドル	株式 26 銘柄	96.21%	—	0.47%
	投資証券 1 銘柄	—	3.79%	0.02%
シンガポールドル	株式 15 銘柄	88.03%	—	0.28%
	投資証券 4 銘柄	—	11.97%	0.04%
ニュージーランドドル	株式 6 銘柄	100.00%	—	0.05%
スウェーデンクローネ	株式 42 銘柄	100.00%	—	0.88%

ノルウェークローネ	株式	12 銘柄	100.00%	—	0.16%
デンマーククローネ	株式	15 銘柄	100.00%	—	1.02%
イスラエルシェケル	株式	8 銘柄	100.00%	—	0.11%
ユーロ	株式	217 銘柄	99.50%	—	9.29%
	投資証券	5 銘柄	—	0.50%	0.05%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

新興国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年3月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	25,711,546,762
コール・ローン	391,097,586
株式	690,869,109,049
投資証券	851,375,004
派生商品評価勘定	2,363,065
未収入金	18,081,608
未収配当金	1,855,890,990
未収利息	754
差入委託証拠金	5,608,738,905
流動資産合計	725,308,203,723
資産合計	725,308,203,723
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	405,646,035
未払金	1,614,882
未払解約金	160,870,840
流動負債合計	568,131,757
負債合計	568,131,757
純資産の部	
元本等	
元本	194,952,402,151
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	529,787,669,815
元本等合計	724,740,071,966
純資産合計	724,740,071,966
負債純資産合計	725,308,203,723

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

1. ロシア株式（以下、「当該株式」）の時価の算定

(1) 当期の財務諸表に計上した金額

当該株式の評価額 0 円（2022 年 3 月 11 日評価額 1,506,109,929 円（保有割合 0.55%））

(2) 会計上の見積りの内容について財務諸表利用者の理解に資するその他の情報

① 当期の財務諸表に計上した金額の算出方法及び算出に用いた主要な仮定

2022 年 2 月 24 日以降、ロシアのウクライナ侵攻を受けた米欧の経済制裁やそれに対抗措置をロシアが設けたことにより、取引の規制、決済機構や SWIFT からの除外による取引後の受渡が行えない状況となり、市場でのロシア関連資産の取引が成立しない状況となりました。このため、組入株式の時価については金融商品取引所等における最終相場で評価していますが、当該株式の取引停止等に伴い、取引停止日以降の最終相場の価格が入手できない状況となりました。当該株式のロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引についても、実現が困難な状況となっております。

時価の算定に関する会計基準に基づきますと、組入有価証券に係る時価は秩序ある取引が行われると想定した場合の出口価格である必要があり、上記状況を総合的に勘案した結果、当ファンドが組み入れている当該株式において、2022 年 3 月 14 日付けで評価額をゼロとすることとし、期末日時点においても当該取り扱いを継続しております。

なお、2022 年 3 月 24 日にモスクワ証券取引所は一部取引を再開しておりますが、ロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引について、実現が困難な状況に変わりありません。

② 翌期の財務諸表への影響

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

(貸借対照表に関する注記)

[2024 年 3 月 25 日現在]	
1. 期首	2023 年 3 月 28 日
期首元本額	132,357,255,077 円
期中追加設定元本額	81,513,377,192 円
期中一部解約元本額	18,918,230,118 円
元本の内訳※	
MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信	1,199,014,790 円
eMAXIS 新興国株式インデックス	10,280,871,803 円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,711,385,204 円
eMAXIS バランス（波乗り型）	180,772,969 円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	604,342,640 円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	8,895,661,390 円
eMAXIS Slim 新興国株式インデックス	39,222,010,127 円
つみたて新興国株式	8,568,338,208 円

つみたて8資産均等バランス	4,383,074,455円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	574,044円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,469,863円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	6,778,678円
eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本)	12,830,164,320円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	1,191,223,783円
eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カントリー)	77,377,473,634円
新興国株式インデックス・オープン (ラップ向け)	3,152,150,312円
つみたて全世界株式	414,284,000円
ラップ向けインデックスf 新興国株式	1,000,171,180円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	47,918,887円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	1,390,827,285円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	1,177,017,856円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	16,743,931,737円
新興国株式インデックスオープン	423,056,084円
eMAXIS 全世界株式インデックス	1,294,592,656円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	304,476,938円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	34,997,770円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	212,204,816円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	227,410,056円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	874,803,039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)	908,658,926円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	18,990,351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)	18,484,254円
グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定)	73,507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)	294,804円
MUKAM バランスファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	54,049,359円
MUKAM バランスファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	52,940,703円
MUKAM バランスファンド2020-10 (適格機関投資家限定)	53,411,773円
MUKAM バランスファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	47,269,664円
MUKAM バランスファンド2021-06 (適格機関投資家限定)	47,230,286円
合計	194,952,402,151円
2. 受益権の総数	194,952,402,151円

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023年3月28日 至 2024年3月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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。</p>
-------------------	--

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年 3月 25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024年 3月 25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	50,057,343,521
投資証券	79,218,248
合計	50,136,561,769

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[2024年 3月 25日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	37,559,254,829	—	37,156,181,483	△403,073,346
合計		37,559,254,829	—	37,156,181,483	△403,073,346

(注) 時価の算定方法

- 1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

[2024年3月25日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカドル	4,325,415,306	—	4,325,205,682	△209,624
	合計	4,325,415,306	—	4,325,205,682	△209,624

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[2024年3月25日現在]
1口当たり純資産額	3,7175円
(1万口当たり純資産額)	(37,175円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM PJSC	3,587,358	—	—	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	535,200	1.92	1,027,584.00	
	LUKOIL PJSC	122,600	—	—	
	NOVATEK PJSC	282,700	—	—	

ROSNEFT OIL CO PJSC	384,962	—	—
SURGUTNEFTEGAS PJSC	2,405,300	—	—
SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	2,315,000	—	—
TATNEFT PJSC	455,759	—	—
ALROSA PJSC	745,960	—	—
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	130,323	17.06	2,223,310.38
MMC NORILSK NICKEL PJSC	19,483	—	—
NOVOLIPETSK STEEL PJSC	439,080	—	—
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	53,979	—	—
POLYUS PJSC	10,871	—	—
SEVERSTAL PJSC	62,882	—	—
SOUTHERN COPPER CORP	54,613	104.36	5,699,412.68
UNITED CO RUSAL INTERNATIONA	1,071,810	—	—
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	257,421	21.02	5,410,989.42
NIO INC - ADR	840,560	4.89	4,110,338.40
H WORLD GROUP LTD-ADR	134,299	37.80	5,076,502.20
TAL EDUCATION GROUP- ADR	267,204	11.86	3,169,039.44
YUM CHINA HOLDINGS INC	262,854	37.88	9,956,909.52
AUTOHOME INC-ADR	38,791	25.97	1,007,402.27
IQIYI INC-ADR	241,668	4.04	976,338.72
KANZHUN LTD - ADR	150,279	18.57	2,790,681.03
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	454,971	10.95	4,981,932.45
YANDEX NV-A	92,564	—	—
OZON HOLDINGS PLC - ADR	20,405	—	—
PDD HOLDINGS INC	384,224	122.99	47,255,709.76
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	210,499	16.62	3,498,493.38
MAGNIT PJSC	23,556	—	—
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	34,286	—	—
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	48,700	58.14	2,831,418.00
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	3,442,213	1.72	5,920,606.36
CREDICORP LTD	41,945	173.72	7,286,685.40
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	796,628	—	—
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	38,258	—	—
VTB BANK PJSC	1,305,990,000	—	—
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	425,170	—	—
QIFU TECHNOLOGY INC	54,200	18.96	1,027,632.00

	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	580,572	2.07	1,202,364.61	
	VK IPJSC	34,689	—	—	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	172,850	—	—	
	INTER RAO UES PJSC	12,239,000	—	—	
	KE HOLDINGS INC-ADR	393,483	13.64	5,367,108.12	
	アメリカドル 小計	1,340,349,169		120,820,458.14 (18,295,841,976)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	1,149,000	7.61	8,743,890.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	1,104,000	8.12	8,964,480.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	15,716,000	4.45	69,936,200.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	2,292,500	30.10	69,004,250.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	628,000	8.17	5,130,760.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	14,125,000	6.41	90,541,250.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	1,301,000	17.58	22,871,580.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	2,018,000	4.79	9,666,220.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	911,500	16.80	15,313,200.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1,420,500	7.39	10,497,495.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	2,036,000	2.73	5,558,280.00	
	CMOC GROUP LTD-H	2,154,000	6.14	13,225,560.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H	185,120	24.80	4,590,976.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	679,000	13.22	8,976,380.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	465,250	15.26	7,099,715.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	660,000	9.19	6,065,400.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	3,998,000	15.22	60,849,560.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	1,247,000	3.16	3,940,520.00	
	BOC AVIATION LTD	97,300	61.00	5,935,300.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	1,132,000	3.49	3,950,680.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	2,285,000	3.86	8,820,100.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	570,000	9.10	5,187,000.00	
	CITIC LTD	3,377,000	8.00	27,016,000.00	
	CRRC CORP LTD - H	2,519,000	4.19	10,554,610.00	
	FOSUN INTERNATIONAL LTD	1,324,500	4.16	5,509,920.00	
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	339,000	22.50	7,627,500.00	
	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	537,000	5.33	2,862,210.00	
	SINOTRUK HONG KONG LTD	316,000	19.58	6,187,280.00	
	WEICHAI POWER CO LTD-H	1,303,800	14.84	19,348,392.00	

ZHUUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	268,300	23.30	6,251,390.00
AIR CHINA LTD-H	1,220,000	3.92	4,782,400.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	788,000	9.44	7,438,720.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	2,116,600	8.02	16,975,132.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	654,000	4.28	2,799,120.00
JD LOGISTICS INC	1,037,800	7.94	8,240,132.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	806,000	7.93	6,391,580.00
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	68,000	99.70	6,779,600.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	1,034,000	5.97	6,172,980.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1,694,000	5.66	9,588,040.00
BYD CO LTD-H	646,000	214.00	138,244,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	1,236,000	3.46	4,276,560.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	319,200	38.35	12,241,320.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	3,979,000	9.20	36,606,800.00
GREAT WALL MOTOR CO LTD-H	1,278,000	8.97	11,463,660.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	1,458,945	3.29	4,799,929.05
LI AUTO INC-CLASS A	729,344	120.40	87,813,017.60
XPENG INC - CLASS A SHARES	662,824	34.55	22,900,569.20
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	944,000	13.76	12,989,440.00
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	289,400	24.50	7,090,300.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	890,800	79.50	70,818,600.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	2,144,000	4.04	8,661,760.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	1,487,000	22.70	33,754,900.00
LI NING CO LTD	1,506,500	20.45	30,807,925.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	502,400	63.70	32,002,880.00
EAST BUY HOLDING LTD	237,500	22.65	5,379,375.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	879,000	17.58	15,452,820.00
MEITUAN-CLASS B	3,346,420	88.25	295,321,565.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	889,780	75.15	66,866,967.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	630,000	19.84	12,499,200.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	548,000	9.25	5,069,000.00
TRIP.COM GROUP LTD	344,229	354.80	122,132,449.20
BAIDU INC-CLASS A	1,414,674	98.20	138,920,986.80
BILIBILI INC-CLASS Z	101,435	86.75	8,799,486.25
CHINA LITERATURE LTD	220,600	27.15	5,989,290.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	2,556,000	2.11	5,393,160.00

KINGSOFT CORP LTD	568,000	25.00	14,200,000.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	1,625,800	49.00	79,664,200.00	
NETEASE INC	1,248,095	166.80	208,182,246.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	4,237,200	288.80	1,223,703,360.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	10,437,000	71.00	741,027,000.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	62,300	75.05	4,675,615.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	1,480,400	11.82	17,498,328.00	
JD.COM INC-CLASS A	1,487,233	103.60	154,077,338.80	
MINISO GROUP HOLDING LTD	187,832	41.45	7,785,636.40	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	231,000	27.65	6,387,150.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	970,000	5.33	5,170,100.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	638,500	13.44	8,581,440.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	5,342,000	3.29	17,575,180.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	702,550	28.05	19,706,527.50	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	66,063	110.35	7,290,052.05	
CHINA FEIHE LTD	2,716,000	3.47	9,424,520.00	
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS	372,000	—	—	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	1,996,000	19.52	38,961,920.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	1,016,000	35.95	36,525,200.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	1,413,600	40.65	57,462,840.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	1,128,000	6.96	7,850,880.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	1,138,000	9.25	10,526,500.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	456,000	53.75	24,510,000.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	3,443,000	4.63	15,941,090.00	
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	286,400	42.80	12,257,920.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	483,000	24.85	12,002,550.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	175,000	23.45	4,103,750.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	324,200	26.45	8,575,090.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	2,087,200	5.01	10,456,872.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	265,300	11.72	3,109,316.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	958,400	20.65	19,790,960.00	
AKESO INC	274,000	46.10	12,631,400.00	
BEIGENE LTD	419,623	92.45	38,794,146.35	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	781,000	12.36	9,653,160.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	847,500	5.14	4,356,150.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	5,445,840	6.43	35,016,751.20	

GENSCRIPT BIOTECH CORP	628,000	14.64	9,193,920.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	696,000	14.66	10,203,360.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	744,000	36.00	26,784,000.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	240,500	13.60	3,270,800.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	6,275,500	3.05	19,140,275.00
WUXI APPTEC CO LTD-H	196,040	37.05	7,263,282.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2,297,500	13.04	29,959,400.00
ZAI LAB LTD	534,210	12.72	6,795,151.20
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	17,552,000	3.30	57,921,600.00
BANK OF CHINA LTD-H	48,864,000	3.26	159,296,640.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	5,861,900	5.25	30,774,975.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	6,040,000	4.19	25,307,600.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	62,154,550	4.80	298,341,840.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	1,464,000	2.58	3,777,120.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	2,565,550	30.20	77,479,610.00
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	3,850,820	2.73	10,512,738.60
IND & COMM BK OF CHINA-H	42,752,350	3.96	169,299,306.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	5,586,000	4.05	22,623,300.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	5,572,000	0.69	3,844,680.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	1,749,000	4.05	7,083,450.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	1,246,000	9.89	12,322,940.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	1,676,500	13.72	23,001,580.00
FAR EAST HORIZON LTD	1,246,000	5.93	7,388,780.00
GF SECURITIES CO LTD-H	442,400	8.49	3,755,976.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	1,531,200	3.86	5,910,432.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	1,048,600	9.22	9,668,092.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	5,376,000	9.45	50,803,200.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	1,814,800	13.56	24,608,688.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	723,200	6.69	4,838,208.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	445,900	14.26	6,358,534.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	4,392,000	2.50	10,980,000.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	4,140,000	10.50	43,470,000.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	4,477,000	33.45	149,755,650.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	422,100	12.16	5,132,736.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	1,487,000	9.40	13,977,800.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	383,500	25.00	9,587,500.00

	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	439,000	30.70	13,477,300.00	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	409,000	16.82	6,879,380.00	
	LENOVO GROUP LTD	5,696,000	9.73	55,422,080.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	478,400	43.70	20,906,080.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	9,646,800	14.80	142,772,640.00	
	ZTE CORP-H	409,531	15.92	6,519,733.52	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	26,118,000	0.92	24,028,560.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	288,500	30.40	8,770,400.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	1,930,000	1.98	3,821,400.00	
	CGN POWER CO LTD-H	7,115,000	2.31	16,435,650.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,904,200	7.63	14,529,046.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	1,903,000	5.25	9,990,750.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	2,292,000	3.24	7,426,080.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	617,000	25.25	15,579,250.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	1,110,000	17.94	19,913,400.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	520,600	64.70	33,682,820.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	2,154,000	4.69	10,102,260.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	2,348,000	4.44	10,425,120.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	2,588,000	7.10	18,374,800.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	146,000	19.52	2,849,920.00	
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	14,212,000	1.38	19,612,560.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROU	960,000	3.91	3,753,600.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	382,000	15.78	6,027,960.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	3,406,000	6.31	21,491,860.00	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	434,000	14.02	6,084,680.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	2,791,000	10.64	29,696,240.00	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	610,000	5.77	3,519,700.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	2,250,000	24.25	54,562,500.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	423,800	23.50	9,959,300.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	2,723,851	5.38	14,654,318.38	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	1,239,000	5.38	6,665,820.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	1,011,000	10.18	10,291,980.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	800,000	4.47	3,576,000.00	
	香港ドル 小計	505,960,059		6,675,401,303.10 (129,235,769,228)	
マレーシアリン	PETRONAS DAGANGAN BHD	149,300	21.80	3,254,740.00	

ギット	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	1,815,500	6.79	12,327,245.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	2,265,100	4.61	10,442,111.00	
	GAMUDA BHD	2,080,800	5.17	10,757,736.00	
	SIME DARBY BERHAD	1,697,300	2.61	4,429,953.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	554,900	9.10	5,049,590.00	
	MISC BHD	744,800	7.53	5,608,344.00	
	GENTING BHD	1,154,400	4.84	5,587,296.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	1,757,300	2.78	4,885,294.00	
	MR DIY GROUP M BHD	1,949,000	1.49	2,904,010.00	
	IOI CORP BHD	1,440,600	4.04	5,820,024.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	337,100	22.40	7,551,040.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	39,900	117.90	4,704,210.00	
	PPB GROUP BERHAD	371,240	15.88	5,895,291.20	
	QL RESOURCES BHD	521,250	5.87	3,059,737.50	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	967,000	4.33	4,187,110.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	1,220,300	6.02	7,346,206.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	1,376,300	4.11	5,656,593.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	4,175,000	6.55	27,346,250.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	366,400	19.44	7,122,816.00	
	MALAYAN BANKING BHD	3,414,700	9.59	32,746,973.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	9,187,900	4.24	38,956,696.00	
	RHB BANK BHD	1,098,049	5.64	6,192,996.36	
	AXIATA GROUP BERHAD	2,339,000	2.82	6,595,980.00	
	CELCOMDIGI BHD	2,553,800	4.40	11,236,720.00	
	MAXIS BHD	1,803,400	3.51	6,329,934.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	653,000	6.03	3,937,590.00	
	PETRONAS GAS BHD	447,000	17.56	7,849,320.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	1,554,000	11.56	17,964,240.00	
	YTL CORP BHD	2,972,300	2.71	8,054,933.00	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	2,094,100	3.87	8,104,167.00		
INARI AMERTRON BHD	1,618,200	3.25	5,259,150.00		
	マレーシアリングット 小計	54,718,939		297,164,296.06 (9,492,824,288)	
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	873,500	152.00	132,772,000.00	
	PTT PCL-NVDR	7,550,400	34.00	256,713,600.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	757,900	59.25	44,905,575.00	

	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	787,000	24.40	19,202,800.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	2,231,461	39.00	87,026,979.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	561,600	29.25	16,426,800.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	439,550	252.00	110,766,600.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	3,107,700	65.25	202,777,425.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	3,539,400	8.05	28,492,170.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	4,492,200	5.45	24,482,490.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	3,667,900	3.96	14,524,884.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,806,900	33.50	60,531,150.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	955,517	36.50	34,876,370.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	9,757,701	10.90	106,358,940.90	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	1,787,200	18.00	32,169,600.00	
	CP ALL PCL-NVDR	4,605,100	54.25	249,826,675.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	1,119,100	30.75	34,412,325.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,996,400	18.40	36,733,760.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	8,114,700	28.75	233,297,625.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	318,900	227.00	72,390,300.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	304,300	124.00	37,733,200.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	1,770,600	16.80	29,746,080.00	
	SCB X PCL-NVDR	472,000	115.50	54,516,000.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	12,000,000	1.85	22,200,000.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	493,000	45.50	22,431,500.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	402,800	46.00	18,528,800.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	1,742,200	72.75	126,745,050.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	690,100	209.00	144,230,900.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	513,100	70.50	36,173,550.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	5,276,828	7.95	41,950,782.60	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	943,600	35.50	33,497,800.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	372,600	55.25	20,586,150.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	1,556,200	44.75	69,639,950.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	1,146,200	63.75	73,070,250.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	5,245,100	7.00	36,715,700.00	
	タイパーツ 小計	91,398,757		2,566,453,782.00 (10,702,112,270)	
フィリピンペン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	924,980	47.00	43,474,060.00	
	AYALA CORPORATION	175,105	632.00	110,666,360.00	

	JG SUMMIT HOLDINGS INC	1,371,849	35.70	48,975,009.30	
	SM INVESTMENTS CORP	150,555	980.00	147,543,900.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	640,250	318.40	203,855,600.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	261,310	264.20	69,038,102.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	536,200	103.00	55,228,600.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	1,250,397	121.50	151,923,235.50	
	BDO UNIBANK INC	1,549,316	154.20	238,904,527.20	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	1,349,456	65.80	88,794,204.80	
	PLDT INC	35,425	1,338.00	47,398,650.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	169,260	364.00	61,610,640.00	
	AYALA LAND INC	4,129,620	31.60	130,495,992.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	5,640,100	32.60	183,867,260.00	
	フィリピンペソ 小計	18,183,823		1,581,776,140.80 (4,256,401,417)	
インドネシア ピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	9,845,800	2,650.00	26,091,370,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	821,600	24,600.00	20,211,360,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	3,732,100	8,775.00	32,749,177,500.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	3,302,400	1,670.00	5,515,008,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	13,337,270	945.00	12,603,720,150.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	1,329,300	9,350.00	12,428,955,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	4,827,300	2,320.00	11,199,336,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	1,836,700	5,800.00	10,652,860,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	15,172,000	5,375.00	81,549,500,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	475,281,400	68.00	32,319,135,200.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	10,376,500	2,900.00	30,091,850,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	4,136,800	5,300.00	21,925,040,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	1,153,300	11,125.00	12,830,462,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	2,112,200	6,425.00	13,570,885,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	4,456,700	2,720.00	12,122,224,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	11,171,100	1,485.00	16,589,083,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	34,338,100	10,100.00	346,814,810,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	24,996,600	7,050.00	176,226,030,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	13,768,700	5,850.00	80,546,895,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	45,858,200	6,125.00	280,881,475,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	11,186,200	875.00	9,787,925,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	29,076,600	3,900.00	113,398,740,000.00	

	インドネシアルピア 小計	722,116,870		1,360,105,841,850.00 (13,057,016,081)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	10,804,968	14.40	155,591,539.20
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	2,154,870	97.84	210,832,480.80
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	102,805	222.58	22,882,336.90
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	673,098	34.01	22,892,062.98
	ALFA S. A. B. -A	1,531,900	12.09	18,520,671.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	370,100	145.42	53,819,942.00
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	224,200	258.88	58,040,896.00
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	175,290	518.80	90,940,452.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	183,300	154.29	28,281,357.00
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	106,465	177.30	18,876,244.50
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	3,227,100	66.95	216,054,345.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	363,866	183.59	66,802,158.94
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	420,000	162.23	68,136,600.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	1,183,600	217.48	257,409,328.00
	GRUMA S. A. B. -B	108,475	296.59	32,172,600.25
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	782,000	73.98	57,852,360.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	819,500	37.75	30,936,125.00
	BANCO DEL BAJIO SA	469,600	62.79	29,486,184.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	1,621,600	172.59	279,871,944.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	991,400	50.69	50,254,066.00
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER B	11,735,400	15.45	181,311,930.00	
	メキシコペソ 小計	38,049,537		1,950,965,623.57 (17,637,509,623)
ブラジルリアル	COSAN SA	1,214,700	16.42	19,945,374.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	2,415,700	36.86	89,042,702.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	3,004,500	36.05	108,312,225.00
	PRIOR SA	483,200	46.69	22,560,608.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	394,700	27.80	10,972,660.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	421,200	15.87	6,684,444.00
	GERDAU SA-PREF	807,100	21.61	17,441,431.00
	KLABIN SA - UNIT	527,200	24.46	12,895,312.00
	SUZANO SA	472,422	62.15	29,361,027.30
	VALE SA	2,151,329	60.95	131,123,502.55
	WEG SA	1,152,588	39.74	45,803,847.12

CCR SA	527,800	14.05	7,415,590.00
LOCALIZA RENT A CAR	637,113	52.85	33,671,422.05
RUMO SA	1,023,000	21.87	22,373,010.00
LOJAS RENNER S.A.	700,422	15.64	10,954,600.08
MAGAZINE LUIZA SA	1,497,500	1.92	2,875,200.00
VIBRA ENERGIA SA	777,600	24.83	19,307,808.00
ATACADA0 SA	343,900	13.51	4,646,089.00
RAIA DROGASIL SA	755,812	27.19	20,550,528.28
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	832,500	14.37	11,963,025.00
AMBEV SA	2,716,700	12.41	33,714,247.00
JBS SA	518,300	23.05	11,946,815.00
NATURA &CO HOLDING SA	525,900	17.82	9,371,538.00
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	2,830,971	3.88	10,984,167.48
REDE D'OR SAO LUIZ SA	340,500	26.40	8,989,200.00
HYPERA SA	379,200	34.11	12,934,512.00
BANCO BRADESCO S. A.	653,037	12.52	8,176,023.24
BANCO BRADESCO SA-PREF	3,805,586	13.96	53,125,980.56
BANCO DO BRASIL S. A.	502,500	55.41	27,843,525.00
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	177,400	28.01	4,968,974.00
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	2,994,730	33.72	100,982,295.60
ITAUSA SA	3,395,062	10.35	35,138,891.70
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	3,789,225	12.00	45,470,700.00
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	747,800	36.69	27,436,782.00
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	457,300	32.34	14,789,082.00
CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	480,900	16.18	7,780,962.00
TOTVS SA	313,600	30.52	9,571,072.00
TELEFONICA BRASIL S. A.	219,375	51.71	11,343,881.25
TIM SA	494,977	18.25	9,033,330.25
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	142,400	46.60	6,635,840.00
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	717,100	42.06	30,161,226.00
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	721,390	12.35	8,909,166.50
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	184,700	80.30	14,831,410.00
COMPANHIA PARANAENSE -PREF B	616,900	10.05	6,199,845.00
CPFL ENERGIA SA	104,700	34.67	3,629,949.00
ENERGISA SA-UNITS	179,600	48.37	8,687,252.00
ENEVA SA	483,000	12.75	6,158,250.00

	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	96,550	40.27	3,888,068.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	811,400	33.42	27,116,988.00	
	ブラジルリアル 小計	49,541,089		1,187,720,379.46 (35,948,376,409)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	231,184	6,975.00	1,612,508,400.00	
	EMPRESAS CMPC SA	876,729	1,899.50	1,665,346,735.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	95,019	47,300.00	4,494,398,700.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	11,707,800	72.50	848,815,500.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	103,210,400	11.71	1,208,593,784.00	
	FALABELLA SA	447,714	2,500.00	1,119,285,000.00	
	CENCOSUD SA	686,091	1,689.00	1,158,807,699.00	
	BANCO DE CHILE	29,371,536	112.70	3,310,172,107.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	51,686	27,295.00	1,410,769,370.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	34,054,503	47.58	1,620,313,252.00	
	ENEL AMERICAS SA	14,141,398	95.20	1,346,261,089.00	
	ENEL CHILE SA	13,798,839	57.00	786,533,823.00	
	チリペソ 小計	208,672,899		20,581,805,459.00 (3,170,174,331)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	23,432	68,900.00	1,614,464,800.00	
	S-OIL CORP	32,311	77,800.00	2,513,795,800.00	
	SK INNOVATION CO LTD	39,280	120,000.00	4,713,600,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	65,451	27,600.00	1,806,447,600.00	
	HYUNDAI STEEL CO	47,819	32,850.00	1,570,854,150.00	
	KOREA ZINC CO LTD	5,353	440,000.00	2,355,320,000.00	
	KUM YANG CO LTD	18,000	120,000.00	2,160,000,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	8,081	140,300.00	1,133,764,300.00	
	LG CHEM LTD	31,597	449,500.00	14,202,851,500.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	4,322	303,000.00	1,309,566,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	9,469	121,000.00	1,145,749,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	47,656	428,500.00	20,420,596,000.00	
	SKC CO LTD	8,074	114,800.00	926,895,200.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	32,378	52,400.00	1,696,607,200.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	276,499	17,890.00	4,946,567,110.00	
	ECOPRO BM CO LTD	29,449	277,000.00	8,157,373,000.00	
	ECOPRO CO LTD	12,018	628,000.00	7,547,304,000.00	
ECOPRO MATERIALS CO LTD	11,600	149,800.00	1,737,680,000.00		

GS HOLDINGS	27,669	50,200.00	1,388,983,800.00	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	23,194	202,000.00	4,685,188,000.00	
HANWHA OCEAN CO LTD	37,899	30,700.00	1,163,499,300.00	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	12,400	125,100.00	1,551,240,000.00	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	28,548	125,900.00	3,594,193,200.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	43,467	34,100.00	1,482,224,700.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	41,812	50,300.00	2,103,143,600.00	
L&F CO LTD	16,089	186,100.00	2,994,162,900.00	
LG CORP	69,138	90,400.00	6,250,075,200.00	
LG ENERGY SOLUTION	30,392	413,500.00	12,567,092,000.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	20,214	318,500.00	6,438,159,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	26,266	56,500.00	1,484,029,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	66,756	160,000.00	10,680,960,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	83,943	24,650.00	2,069,194,950.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	354,731	9,080.00	3,220,957,480.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	17,800	74,700.00	1,329,660,000.00	
SK INC	34,469	191,200.00	6,590,472,800.00	
SK SQUARE CO LTD	63,840	80,000.00	5,107,200,000.00	
HANJIN KAL CORP	24,797	59,400.00	1,472,941,800.00	
HMM CO LTD	170,430	15,560.00	2,651,890,800.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	11,173	187,400.00	2,093,820,200.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	107,148	21,800.00	2,335,826,400.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	43,655	54,500.00	2,379,197,500.00	
HANON SYSTEMS	106,991	5,730.00	613,058,430.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	44,441	262,000.00	11,643,542,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	92,825	243,500.00	22,602,887,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	17,752	158,800.00	2,819,017,600.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	10,895	158,700.00	1,729,036,500.00	
KIA CORP	164,127	112,900.00	18,529,938,300.00	
COWAY CO LTD	30,042	56,300.00	1,691,364,600.00	
LG ELECTRONICS INC	67,537	99,400.00	6,713,177,800.00	
KANGWON LAND INC	47,178	16,830.00	794,005,740.00	
HYBE CO LTD	11,933	195,800.00	2,336,481,400.00	
KAKAO CORP	216,569	53,600.00	11,608,098,400.00	
KRAFTON INC	18,966	236,000.00	4,475,976,000.00	
NAVER CORP	80,161	188,900.00	15,142,412,900.00	

NCSOFT CORP	7,497	191,400.00	1,434,925,800.00	
NETMARBLE CORP	12,296	58,700.00	721,775,200.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	3,867	289,500.00	1,119,496,500.00	
KT&G CORP	67,130	92,500.00	6,209,525,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	12,195	90,800.00	1,107,306,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	14,756	116,100.00	1,713,171,600.00	
LG H&H	5,202	381,500.00	1,984,563,000.00	
HLB INC	67,462	111,800.00	7,542,251,600.00	
CELLTRION INC	96,759	188,200.00	18,210,043,800.00	
CELLTRION PHARM INC	10,459	114,400.00	1,196,509,600.00	
HANMI PHARM CO LTD	3,690	333,000.00	1,228,770,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	12,838	840,000.00	10,783,920,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	17,376	94,600.00	1,643,769,600.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	14,700	63,000.00	926,100,000.00	
YUHAN CORP	30,223	76,300.00	2,306,014,900.00	
HANA FINANCIAL GROUP	177,231	64,000.00	11,342,784,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	195,743	15,280.00	2,990,953,040.00	
KAKAOBANK CORP	103,900	28,100.00	2,919,590,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	240,035	74,900.00	17,978,621,500.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	296,204	50,600.00	14,987,922,400.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	346,472	15,200.00	5,266,374,400.00	
KAKAOPAY CORP	11,248	39,400.00	443,171,200.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	20,102	71,400.00	1,435,282,800.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	67,490	84,200.00	5,682,658,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	119,622	8,460.00	1,012,002,120.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	60,045	12,930.00	776,381,850.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	36,061	42,000.00	1,514,562,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	26,050	103,600.00	2,698,780,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	20,215	335,000.00	6,772,025,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	48,282	97,900.00	4,726,807,800.00	
POSCO DX CO LTD	30,200	53,000.00	1,600,600,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	24,444	158,100.00	3,864,596,400.00	
COSMOAM&T CO LTD	12,657	169,200.00	2,141,564,400.00	
LG DISPLAY CO LTD	345,973	10,750.00	3,719,209,750.00	
LG INNOTEK CO LTD	7,648	192,400.00	1,471,475,200.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	34,488	144,900.00	4,997,311,200.00	

	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	3,056,963	78,900.00	241,194,380,700.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	530,151	66,700.00	35,361,071,700.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	35,148	472,500.00	16,607,430,000.00	
	KT CORP	30,000	38,750.00	1,162,500,000.00	
	LG UPLUS CORP	107,515	10,020.00	1,077,300,300.00	
	SK TELECOM	31,200	53,200.00	1,659,840,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	145,027	22,800.00	3,306,615,600.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	22,700	93,800.00	2,129,260,000.00	
	SK HYNIX INC	353,670	169,800.00	60,053,166,000.00	
	韓国ウォン 小計	9,880,970		785,314,925,420.00 (88,583,523,587)	
ニュー台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	597,150	68.10	40,665,915.00	
	ASIA CEMENT CORP	1,312,281	41.25	54,131,591.25	
	CHINA STEEL CORP	7,062,947	23.95	169,157,580.65	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	2,277,430	54.60	124,347,678.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	2,802,600	67.00	187,774,200.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	3,598,557	54.80	197,200,923.60	
	TAIWAN CEMENT	4,058,696	31.15	126,428,380.40	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	93,000	1,090.00	101,370,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	1,512,138	32.50	49,144,485.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	38,000	1,635.00	62,130,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	1,629,000	37.55	61,168,950.00	
	CHINA AIRLINES LTD	1,582,000	19.35	30,611,700.00	
	EVA AIRWAYS CORP	1,334,000	31.35	41,820,900.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	563,353	170.00	95,770,010.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	1,077,000	29.95	32,256,150.00	
	WAN HAI LINES LTD	322,845	45.30	14,624,878.50	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	1,065,000	45.15	48,084,750.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,145,413	48.10	55,094,365.30	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	100,728	541.00	54,493,848.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	344,098	161.00	55,399,778.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	132,000	352.50	46,530,000.00	
	POU CHEN	1,066,500	35.10	37,434,150.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	181,880	644.00	117,130,720.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	369,000	267.50	98,707,500.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	2,828,624	75.40	213,278,249.60	

PHARMAESSENTIA CORP	136,000	326.00	44,336,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	2,858,387	18.25	52,165,562.75
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	10,880,955	31.90	347,102,464.50
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	9,977,067	27.10	270,378,515.70
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	8,334,648	27.60	230,036,284.80
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	5,228,109	22.95	119,985,101.55
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	7,646,703	40.10	306,632,790.30
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	8,103,405	21.15	171,387,015.75
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	8,862,716	18.05	159,972,023.80
TAIWAN BUSINESS BANK	3,048,448	15.75	48,013,056.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	8,067,572	26.00	209,756,872.00
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	2,848,000	47.90	136,419,200.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	918,275	171.50	157,484,162.50
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	6,302,117	29.45	185,597,345.65
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	6,383,366	48.55	309,912,419.30
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	9,177,255	14.05	128,940,432.75
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	5,158,556	69.60	359,035,497.60
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	6,948,852	8.13	56,494,166.76
ACCTON TECHNOLOGY CORP	319,000	481.00	153,439,000.00
ACER INC	1,664,168	45.95	76,468,519.60
ADVANTECH CO LTD	288,020	400.00	115,208,000.00
ASUSTEK COMPUTER INC	424,774	421.50	179,042,241.00
AUO CORP	4,165,800	18.40	76,650,720.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	526,000	214.00	112,564,000.00
COMPAL ELECTRONICS	2,830,775	38.65	109,409,453.75
DELTA ELECTRONICS INC	1,268,220	358.00	454,022,760.00
E INK HOLDINGS INC	517,000	236.50	122,270,500.00
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	335,000	303.00	101,505,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	8,208,272	145.50	1,194,303,576.00
INNOLUX CORP	5,345,461	15.55	83,121,918.55
INVENTEC CORP	1,536,429	61.10	93,875,811.90
LARGAN PRECISION CO LTD	59,820	2,445.00	146,259,900.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,320,160	121.50	160,399,440.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	432,000	171.00	73,872,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	114,000	211.00	24,054,000.00
PEGATRON CORP	1,231,976	102.00	125,661,552.00

	QUANTA COMPUTER INC	1,706,150	257.50	439,333,625.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	874,193	78.40	68,536,731.20	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	875,000	200.00	175,000,000.00	
	WISTRON CORP	1,576,000	123.00	193,848,000.00	
	WIWYNN CORP	59,000	2,295.00	135,405,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	1,540,168	89.20	137,382,985.60	
	YAGEO CORPORATION	218,738	588.00	128,617,944.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	346,000	115.00	39,790,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	2,600,000	124.00	322,400,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	962,000	79.20	76,190,400.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	896,400	99.90	89,550,360.00	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	45,000	3,450.00	155,250,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	2,131,294	159.00	338,875,746.00	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	42,000	2,495.00	104,790,000.00	
	GLOBAL UNICHIP CORP	57,000	1,320.00	75,240,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	124,000	592.00	73,408,000.00	
	MEDIATEK INC	970,236	1,125.00	1,091,515,500.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	706,000	69.60	49,137,600.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	350,000	594.00	207,900,000.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	47,000	980.00	46,060,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	2,108,000	26.60	56,072,800.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	316,703	591.00	187,171,473.00	
	SILERGY CORP	184,000	367.00	67,528,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	15,734,000	785.00	12,351,190,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	7,099,000	52.40	371,987,600.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	473,000	87.90	41,576,700.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	1,887,000	27.50	51,892,500.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	865,141	35.10	30,366,449.10	
	ニュー台湾ドル 小計	223,354,569		25,916,551,421.71 (122,725,237,602)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	425,063	592.80	251,977,346.40	
	COAL INDIA LTD	991,773	431.95	428,396,347.35	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	358,066	473.45	169,526,347.70	
	INDIAN OIL CORP LTD	1,830,107	165.15	302,242,171.05	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	1,986,297	263.25	522,892,685.25	
	PETRONET LNG LTD	548,841	259.35	142,341,913.35	

RELIANCE INDUSTRIES LTD	1,945,524	2,910.05	5,661,572,116.20
AMBUJA CEMENTS LTD	355,073	589.35	209,262,272.55
APL APOLLO TUBES LTD	93,400	1,518.85	141,860,590.00
ASIAN PAINTS LTD	240,546	2,841.50	683,511,459.00
BERGER PAINTS INDIA LTD	170,784	558.35	95,357,246.40
GRASIM INDUSTRIES LTD	191,879	2,223.55	426,652,550.45
HINDALCO INDUSTRIES LTD	940,910	547.75	515,383,452.50
JINDAL STEEL & POWER LTD	179,644	832.90	149,625,487.60
JSW STEEL LTD	411,469	824.80	339,379,631.20
NMDC LTD	859,046	203.70	174,987,670.20
PI INDUSTRIES LTD	56,131	3,791.15	212,801,040.65
PIDILITE INDUSTRIES LTD	81,687	2,960.10	241,801,688.70
SHREE CEMENT LTD	4,903	25,366.05	124,369,743.15
SRF LTD	79,900	2,550.95	203,820,905.00
SUPREME INDUSTRIES LTD	38,100	3,930.30	149,744,430.00
TATA STEEL LTD	4,278,189	151.80	649,429,090.20
ULTRATECH CEMENT LTD	75,858	9,681.75	734,438,191.50
UPL LTD	331,172	470.00	155,650,840.00
VEDANTA LTD	555,382	271.10	150,564,060.20
ABB INDIA LTD	32,000	5,967.40	190,956,800.00
ADANI ENTERPRISES LTD	97,587	3,107.70	303,271,119.90
ASHOK LEYLAND LTD	810,688	166.65	135,101,155.20
ASTRAL LTD	72,159	1,938.90	139,909,085.10
BHARAT ELECTRONICS LTD	2,768,047	197.50	546,689,282.50
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	827,457	239.10	197,844,968.70
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	334,557	535.95	179,305,824.15
CUMMINS INDIA LTD	91,700	2,930.80	268,754,360.00
HAVELLS INDIA LTD	144,146	1,469.25	211,786,510.50
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	128,154	3,170.80	406,350,703.20
LARSEN & TOUBRO LTD	411,182	3,617.80	1,487,574,239.60
POLYCAB INDIA LTD	24,700	4,909.90	121,274,530.00
SIEMENS LTD	50,469	4,991.55	251,918,536.95
SUZLON ENERGY LTD	4,883,900	37.35	182,413,665.00
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	128,900	928.70	119,709,430.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	314,258	1,281.60	402,753,052.80
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	181,594	868.10	157,641,751.40

GMR AIRPORTS INFRASTRUCTURE	1, 925, 807	78. 65	151, 464, 720. 55
INTERGLOBE AVIATION LTD	108, 908	3, 286. 80	357, 958, 814. 40
BAJAJ AUTO LTD	49, 126	8, 945. 25	439, 444, 351. 50
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	38, 519	2, 276. 05	87, 671, 169. 95
BHARAT FORGE LTD	214, 903	1, 128. 95	242, 614, 741. 85
EICHER MOTORS LTD	81, 325	3, 988. 40	324, 356, 630. 00
HERO MOTOCORP LTD	87, 235	4, 684. 00	408, 608, 740. 00
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	591, 720	1, 878. 80	1, 111, 723, 536. 00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	96, 126	12, 337. 70	1, 185, 973, 750. 20
MRF LTD	2, 162	131, 302. 95	283, 876, 977. 90
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	1, 263, 368	116. 30	146, 929, 698. 40
SONA BLW PRECISION FORGINGS	213, 720	691. 45	147, 776, 694. 00
TATA MOTORS LTD	1, 083, 589	979. 80	1, 061, 700, 502. 20
TATA MOTORS LTD-A-DVR	263, 600	649. 15	171, 115, 940. 00
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	65, 000	3, 743. 95	243, 356, 750. 00
TVS MOTOR CO LTD	141, 207	2, 050. 80	289, 587, 315. 60
PAGE INDUSTRIES LTD	4, 006	34, 449. 85	138, 006, 099. 10
TITAN CO LTD	233, 390	3, 706. 70	865, 106, 713. 00
INDIAN HOTELS CO LTD	546, 100	557. 05	304, 205, 005. 00
JUBILANT FOODWORKS LTD	240, 560	452. 45	108, 841, 372. 00
ZOMATO LTD	4, 074, 200	174. 20	709, 725, 640. 00
INFO EDGE INDIA LTD	55, 197	5, 243. 10	289, 403, 390. 70
TRENT LTD	108, 950	3, 948. 60	430, 199, 970. 00
AVENUE SUPERMARTS LTD	89, 907	4, 297. 60	386, 384, 323. 20
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	61, 472	4, 865. 00	299, 061, 280. 00
ITC LTD	1, 851, 031	428. 60	793, 351, 886. 60
MARICO LTD	303, 092	497. 75	150, 864, 043. 00
NESTLE INDIA LTD	197, 412	2, 573. 40	508, 020, 040. 80
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	451, 186	1, 122. 75	506, 569, 081. 50
UNITED SPIRITS LTD	167, 525	1, 134. 50	190, 057, 112. 50
VARUN BEVERAGES LTD	271, 393	1, 402. 40	380, 601, 543. 20
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	93, 686	2, 708. 05	253, 706, 372. 30
DABUR INDIA LTD	355, 562	520. 80	185, 176, 689. 60
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	267, 674	1, 221. 65	327, 003, 942. 10
HINDUSTAN UNILEVER LTD	511, 759	2, 256. 55	1, 154, 809, 771. 45
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	74, 763	6, 375. 90	476, 681, 411. 70

MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	472,438	739.05	349,155,303.90
AUROBINDO PHARMA LTD	141,068	1,019.85	143,868,199.80
CIPLA LTD	344,661	1,481.25	510,529,106.25
DIVI'S LABORATORIES LTD	72,484	3,431.45	248,725,221.80
DR. REDDY'S LABORATORIES	84,374	6,203.20	523,388,796.80
LUPIN LTD	175,501	1,608.25	282,249,483.25
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	605,266	1,608.90	973,812,467.40
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	54,086	2,559.80	138,449,342.80
AU SMALL FINANCE BANK LTD	80,800	564.25	45,591,400.00
AXIS BANK LTD	1,484,218	1,033.30	1,533,642,459.40
BANDHAN BANK LTD	404,531	181.75	73,523,509.25
BANK OF BARODA	683,608	259.80	177,601,358.40
HDFC BANK LIMITED	1,752,725	1,442.85	2,528,919,266.25
ICICI BANK LTD	3,318,827	1,090.30	3,618,517,078.10
IDFC FIRST BANK LTD	1,793,641	78.05	139,993,680.05
INDUSIND BANK LTD	161,100	1,512.10	243,599,310.00
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	673,470	1,776.40	1,196,352,108.00
PUNJAB NATIONAL BANK	1,670,300	122.75	205,029,325.00
STATE BANK OF INDIA	1,104,560	746.70	824,774,952.00
UNION BANK OF INDIA	1,145,700	148.10	169,678,170.00
YES BANK LTD	7,091,633	23.90	169,490,028.70
BAJAJ FINANCE LTD	170,580	6,760.90	1,153,274,322.00
BAJAJ FINSERV LTD	219,021	1,587.55	347,706,788.55
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	16,100	8,395.05	135,160,305.00
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	249,500	1,089.40	271,805,300.00
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	72,853	3,773.40	274,903,510.20
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	1,900,623	344.65	655,049,716.95
MUTHOOT FINANCE LTD	70,100	1,424.35	99,846,935.00
ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	125,900	402.35	50,655,865.00
POWER FINANCE CORPORATION	1,073,612	391.65	420,480,139.80
REC LTD	967,835	460.10	445,300,883.50
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	152,600	704.10	107,445,660.00
SHRIRAM FINANCE LTD	170,222	2,330.70	396,736,415.40
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	619,035	623.85	386,184,984.75
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	138,845	1,669.85	231,850,323.25
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	194,605	581.85	113,230,919.25

	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	318,541	1,501.10	478,161,895.10
	HCL TECHNOLOGIES LTD	591,951	1,557.85	922,170,865.35
	INFOSYS LTD	2,136,099	1,508.85	3,223,052,976.15
	LTIMINDTREE LTD	57,510	5,005.00	287,837,550.00
	MPHASIS LTD	43,391	2,389.40	103,678,455.40
	PERSISTENT SYSTEMS LTD	28,000	7,971.40	223,199,200.00
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	572,675	3,910.90	2,239,674,657.50
	TATA ELXSI LTD	19,600	7,665.00	150,234,000.00
	TECH MAHINDRA LTD	322,469	1,262.65	407,165,482.85
	WIPRO LTD	773,095	487.10	376,574,574.50
	BHARTI AIRTEL LTD	1,466,970	1,236.10	1,813,321,617.00
	TATA COMMUNICATIONS LTD	66,300	1,922.65	127,471,695.00
	ADANI GREEN ENERGY LTD	200,688	1,851.75	371,624,004.00
	ADANI POWER LTD	465,107	531.05	246,995,072.35
	GAIL INDIA LTD	1,369,662	174.10	238,458,154.20
	INDRAPRASTHA GAS LTD	213,723	412.75	88,214,168.25
	NTPC LTD	2,832,789	324.75	919,948,227.75
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	2,915,060	275.75	803,827,795.00
	TATA POWER CO LTD	1,226,910	390.70	479,353,737.00
	DLF LTD	493,476	865.90	427,300,868.40
	GODREJ PROPERTIES LTD	68,467	2,246.45	153,807,692.15
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	138,700	1,158.20	160,642,340.00
	インドルピー 小計	90,294,027		66,682,017,975.65 (121,361,272,715)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	39,958	826.00	33,005,308.00
	MONETA MONEY BANK AS	174,521	98.70	17,225,222.70
	CEZ AS	144,745	835.00	120,862,075.00
	チェココルナ 小計	359,224		171,092,605.70 (1,103,341,995)
クウェートディ ナール	AGILITY	847,283	0.60	513,453.49
	BOUBYAN BANK K. S. C	782,041	0.61	481,737.25
	GULF BANK	1,288,775	0.29	376,322.30
	KUWAIT FINANCE HOUSE	5,666,657	0.80	4,567,325.54
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	5,085,148	0.97	4,947,849.00
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	1,118,010	0.50	560,123.01
	MABANEE CO KPSC	345,094	0.85	295,745.55

	クウェートディナール 小計	15,133,008		11,742,556.14 (5,790,254,432)
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	210,054	35,100.00	7,372,895,400.00
	BANCOLOMBIA SA-PREF	237,560	32,980.00	7,834,728,800.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	241,634	19,420.00	4,692,532,280.00
	コロンビアペソ 小計	689,248		19,900,156,480.00 (773,698,183)
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	298,686	2,932.00	875,747,352.00
	RICHTER GEDEON NYRT	78,795	9,200.00	724,914,000.00
	OTP BANK PLC	141,641	17,000.00	2,407,897,000.00
	ハンガリーフォリント 小計	519,122		4,008,558,352.00 (1,649,393,487)
アラブディルハム	MULTIPLY GROUP	2,382,334	2.29	5,455,544.86
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	1,481,824	3.48	5,156,747.52
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	2,712,209	3.72	10,089,417.48
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	2,086,479	8.60	17,943,719.40
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	944,352	11.28	10,652,290.56
	DUBAI ISLAMIC BANK	2,117,807	5.87	12,431,527.09
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	2,919,400	13.54	39,528,676.00
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	2,520,489	18.32	46,175,358.48
	ALDAR PROPERTIES PJSC	2,874,678	5.77	16,586,892.06
	EMAAR PROPERTIES PJSC	4,408,287	8.38	36,941,445.06
		アラブディルハム 小計	24,447,859	
ポーランドズロチ	ORLEN SA	342,553	62.84	21,526,030.52
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	79,255	117.05	9,276,797.75
	BUDIMEX	7,879	730.00	5,751,670.00
	LPP SA	672	13,880.00	9,327,360.00
	CD PROJEKT SA	39,305	114.90	4,516,144.50
	ALLEGRO. EU SA	294,056	32.74	9,627,393.44
	PEPCO GROUP NV	65,200	18.89	1,231,628.00
	DINO POLSKA SA	32,029	369.80	11,844,324.20
	BANK PEKAO SA	113,342	177.50	20,118,205.00
	MBANK SA	8,679	737.00	6,396,423.00
	PKO BANK POLSKI SA	552,714	57.62	31,847,380.68
	SANTANDER BANK POLSKA SA	23,502	551.00	12,949,602.00

	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	457,338	48.44	22,153,452.72	
	PGE SA	422,950	7.06	2,986,872.90	
	ポーランドズロチ 小計	2,439,474		169,553,284.71 (6,417,286,630)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	127,751	175.12	22,371,755.12	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	49,359	793.28	39,155,507.52	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	249,911	398.88	99,684,499.68	
	GOLD FIELDS LTD	575,713	287.33	165,419,616.29	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	325,035	148.29	48,199,440.15	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	590,056	81.47	48,071,862.32	
	KUMBA IRON ORE LTD	35,041	464.82	16,287,757.62	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	183,913	116.77	21,475,521.01	
	SASOL LTD	464,362	144.14	66,933,138.68	
	SIBANYE STILLWATER LTD	1,896,239	21.69	41,129,423.91	
	BIDVEST GROUP LTD	248,683	246.02	61,180,991.66	
	NASPERS LTD-N SHS	114,881	3,095.26	355,586,564.06	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	1,021,247	18.52	18,913,494.44	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	810,593	60.80	49,284,054.40	
	BID CORP LTD	213,322	455.20	97,104,174.40	
	CLICKS GROUP LTD	148,332	297.44	44,119,870.08	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	281,193	250.99	70,576,631.07	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	223,949	215.25	48,205,022.25	
	ABSA GROUP LTD	499,810	148.06	74,001,868.60	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	54,324	2,078.57	112,916,236.68	
	NEDBANK GROUP LTD	332,898	230.00	76,566,540.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	902,914	184.13	166,253,554.82	
	FIRSTRAND LTD	3,094,590	62.00	191,864,580.00	
	REINET INVESTMENTS SCA	84,585	457.87	38,728,933.95	
	REMGRO LTD	267,319	122.32	32,698,460.08	
	DISCOVERY LTD	299,449	127.00	38,030,023.00	
	OLD MUTUAL LTD	2,345,236	11.63	27,275,094.68	
	OUTSURANCE GROUP LTD	394,727	42.17	16,645,637.59	
	SANLAM LTD	1,266,679	69.86	88,490,194.94	
	MTN GROUP LTD	1,220,409	90.36	110,276,157.24	
VODACOM GROUP LTD	430,847	96.85	41,727,531.95		
NEPI ROCKCASTLE N. V.	424,179	130.13	55,198,413.27		

	南アフリカランド 小計	19,177,546		2,384,372,551.46 (18,979,605,509)	
オフショア元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	176,500	7.67	1,353,755.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	1,126,325	6.20	6,983,215.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	236,728	37.94	8,981,460.32	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	124,900	16.20	2,023,380.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	235,000	7.61	1,788,350.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	42,000	6.01	252,420.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	685,100	9.08	6,220,708.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	409,600	25.38	10,395,648.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	222,000	9.75	2,164,500.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	142,970	10.53	1,505,474.10	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	100,900	22.69	2,289,421.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	150,082	24.02	3,604,969.64	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	9,100	29.36	267,176.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	650,300	6.90	4,487,070.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	173,900	22.27	3,872,753.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	681,496	6.48	4,416,094.08	
	CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	20,540	20.90	429,286.00	
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	27,200	20.15	548,080.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	110,447	9.74	1,075,753.78	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	123,100	19.67	2,421,377.00	
	CHINA RARE EARTH RESOURCES-A	32,500	28.20	916,500.00	
	CIOC GROUP LTD-A	515,101	7.48	3,852,955.48	
	CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	54,324	52.43	2,848,207.32	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	102,531	37.58	3,853,114.98	
	GEM CO LTD-A	131,700	6.27	825,759.00	
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	84,280	20.87	1,758,923.60	
	HENAN SHENHUO COAL & POWER-A	125,100	19.54	2,444,454.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	257,100	13.34	3,429,714.00	
	HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	537,748	6.46	3,473,852.08	
	HESTEEL CO LTD-A	1,596,100	2.14	3,415,654.00	
	HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	27,200	51.31	1,395,632.00	
	HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	106,636	6.68	712,328.48	
	HUAIBEI MINING HOLDINGS CO-A	131,200	16.85	2,210,720.00	
	HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	185,200	5.30	981,560.00	

INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	2,282,300	1.61	3,674,503.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	482,916	3.72	1,796,447.52
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	290,586	10.06	2,923,295.16
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	30,160	51.42	1,550,827.20
JIANGXI COPPER CO LTD-A	99,100	22.20	2,200,020.00
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	181,400	11.07	2,008,098.00
LB GROUP CO LTD-A	59,600	18.16	1,082,336.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	338,100	12.11	4,094,391.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	319,800	15.72	5,027,256.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	697,700	3.16	2,204,732.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	211,600	16.21	3,430,036.00
RONGSHENG PETROCHEMICAL CO-A	325,971	10.82	3,527,006.22
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	84,740	17.10	1,449,054.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	90,424	25.41	2,297,673.84
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	199,150	24.39	4,857,268.50
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	336,100	3.33	1,119,213.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	233,900	13.97	3,267,583.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	101,726	18.98	1,930,759.48
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	145,500	7.13	1,037,415.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	1,174,400	3.63	4,263,072.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	20,880	36.23	756,482.40
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	47,100	15.27	719,217.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	13,524	35.00	473,340.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	59,200	49.80	2,948,160.00
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	100,000	6.23	623,000.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	60,900	13.43	817,887.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	510,800	3.81	1,946,148.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	206,800	77.24	15,973,232.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	7,840	31.36	245,862.40
WESTERN MINING CO -A	163,200	17.80	2,904,960.00
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	23,240	38.89	903,803.60
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	13,400	19.09	255,806.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	199,060	16.40	3,264,584.00
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	14,560	49.60	722,176.00
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	122,042	12.79	1,560,917.18
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A	34,651	42.52	1,473,360.52

YUNNAN YUNTIANHUA CO-A	40,000	18.50	740,000.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	34,400	29.01	997,944.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	55,015	27.26	1,499,708.90
ZHEJIANG JUHUA CO-A	107,700	22.42	2,414,634.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	204,800	8.32	1,703,936.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	349,900	12.00	4,198,800.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	673,600	15.39	10,366,704.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	78,931	18.40	1,452,330.40
AECC AVIATION POWER CO-A	79,200	34.50	2,732,400.00
AVICOPTER PLC-A	37,400	39.97	1,494,878.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	66,800	27.45	1,833,660.00
CHINA BAOAN GROUP-A	49,260	10.96	539,889.60
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	73,000	35.00	2,555,000.00
CHINA ENERGY ENGINEERING C-A	1,252,100	2.12	2,654,452.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	98,000	6.67	653,660.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	1,045,600	6.73	7,036,888.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	1,305,480	5.17	6,749,331.60
CHINA XD ELECTRIC CO LTD-A	391,100	5.44	2,127,584.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	208,174	186.51	38,826,532.74
CRRC CORP LTD-A	1,139,000	6.47	7,369,330.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	144,760	15.77	2,282,865.20
EVE ENERGY CO LTD-A	67,288	40.42	2,719,780.96
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	1,305,243	4.91	6,408,743.13
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	73,700	9.00	663,300.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	9,750	60.22	587,145.00
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	129,800	7.64	991,672.00
GONEO GROUP CO LTD-A	34,400	101.52	3,492,288.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	231,800	20.25	4,693,950.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	9,940	25.11	249,593.40
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	62,532	53.63	3,353,591.16
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	103,700	14.75	1,529,575.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	47,400	17.35	822,390.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	527,534	3.36	1,772,514.24
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	47,900	9.94	476,126.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	272,409	24.51	6,676,744.59
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	26,700	94.99	2,536,233.00

NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	24,000	46.51	1,116,240.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	512,700	4.97	2,548,119.00
RANGE INTELLIGENT COMPUTI-A	79,700	33.73	2,688,281.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	340,616	13.95	4,751,593.20
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	84,500	2.38	201,110.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	407,700	4.20	1,712,340.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	49,851	61.39	3,060,352.89
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	185,640	7.50	1,392,300.00
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	60,100	58.36	3,507,436.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	63,100	102.97	6,497,407.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	37,600	14.08	529,408.00
TBEA CO LTD-A	217,100	15.58	3,382,418.00
WEICHAI POWER CO LTD-A	285,251	16.05	4,578,278.55
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	363,600	5.86	2,130,696.00
XIAMEN C & D INC-A	26,900	10.07	270,883.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	36,000	20.63	742,680.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	4,620	56.10	259,182.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	113,500	24.54	2,785,290.00
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	221,000	15.37	3,396,770.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-A	45,200	43.26	1,955,352.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	143,900	7.72	1,110,908.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	74,300	35.66	2,649,538.00
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	58,110	18.44	1,071,548.40
AIR CHINA LTD-A	287,800	7.36	2,118,208.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	1,533,100	4.96	7,604,176.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	547,400	3.71	2,030,854.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	444,100	5.67	2,518,047.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	469,130	10.24	4,803,891.20
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	361,700	7.31	2,644,027.00
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	2,330,900	1.38	3,216,642.00
LIAONING PORT CO LTD-A	2,697,000	1.41	3,802,770.00
S F HOLDING CO LTD-A	389,600	38.04	14,820,384.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	38,100	36.40	1,386,840.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	139,900	5.24	733,076.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	54,200	55.14	2,988,588.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	75,200	15.05	1,131,760.00

YUNDA HOLDING CO LTD-A	78,060	7.40	577,644.00
ANHUI JIANGHUAI AUTO GROUP-A	109,000	18.10	1,972,900.00
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	288,700	8.01	2,312,487.00
BYD CO LTD -A	124,500	216.95	27,010,275.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	20,100	144.00	2,894,400.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	274,190	17.81	4,883,323.90
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	46,838	42.41	1,986,399.58
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	92,554	23.35	2,161,135.90
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	348,900	8.88	3,098,232.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	68,200	16.66	1,136,212.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	12,000	111.57	1,338,840.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	12,360	17.21	212,715.60
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	51,300	62.64	3,213,432.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	159,244	14.85	2,364,773.40
SAILUN GROUP CO LTD-A	107,100	14.07	1,506,897.00
SERES GROUP CO L-A	55,300	100.70	5,568,710.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	37,400	20.70	774,180.00
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	8,700	82.01	713,487.00
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	5,900	326.28	1,925,052.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	11,400	36.45	415,530.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	77,853	38.14	2,969,313.42
HAIER SMART HOME CO LTD-A	208,929	23.35	4,878,492.15
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	9,000	24.05	216,450.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	16,120	36.73	592,087.60
MIDEA GROUP CO LTD-A	195,800	62.62	12,260,996.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	12,917	63.85	824,750.45
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	5,200	54.40	282,880.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	27,000	29.48	795,960.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	24,843	10.56	262,342.08
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	75,300	18.96	1,427,688.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	27,900	10.58	295,182.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	626,202	6.73	4,214,339.46
KUNLUN TECH CO LTD-A	56,000	41.95	2,349,200.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	80,780	26.79	2,164,096.20
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	241,100	7.69	1,854,059.00
PEOPLE.CN CO LTD-A	55,400	31.12	1,724,048.00

PERFECT WORLD CO LTD-A	18,300	12.16	222,528.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	126,520	5.24	662,964.80
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	159,499	84.31	13,447,360.69
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	30,800	6.21	191,268.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	48,200	4.43	213,526.00
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	344,500	9.15	3,152,175.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	19,704	21.31	419,892.24
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	84,971	38.51	3,272,233.21
ANGEL YEAST CO LTD-A	7,800	29.07	226,746.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	10,200	261.50	2,667,300.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	46,625	41.42	1,931,207.50
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	21,800	67.00	1,460,600.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	5,900	87.82	518,138.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	40,300	5.29	213,187.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	234,000	9.04	2,115,360.00
CHONGQING BREWERY CO-A	16,080	65.35	1,050,828.00
EASTROC BEVERAGE GROUP CO -A	17,500	180.41	3,157,175.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	143,133	39.83	5,700,987.39
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	9,800	16.31	159,838.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	49,519	43.51	2,154,571.69
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	118,600	12.16	1,442,176.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	87,500	28.46	2,490,250.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	293,000	28.65	8,394,450.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	32,590	58.00	1,890,220.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	44,981	101.11	4,548,028.91
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	3,600	59.84	215,424.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	7,600	24.85	188,860.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	47,853	1,701.35	81,414,701.55
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	48,255	183.14	8,837,420.70
MUYUAN FOODS CO LTD-A	190,980	42.25	8,068,905.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	209,700	9.46	1,983,762.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	24,705	18.68	461,489.40
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	44,360	246.85	10,950,266.00
SHEDE SPIRITS CO LTD-A	22,300	82.50	1,839,750.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	12,600	48.86	615,636.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	18,161	84.05	1,526,432.05

WENS FOODSTUFFS GROUP CO L-A	261,140	19.08	4,982,551.20
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	147,900	153.43	22,692,297.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	23,700	31.17	738,729.00
BY-HEALTH CO LTD-A	133,500	16.71	2,230,785.00
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A	9,700	62.33	604,601.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	276,792	13.27	3,673,029.84
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	128,900	28.87	3,721,343.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	4,400	58.02	255,288.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	57,140	31.70	1,811,338.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	64,300	33.88	2,178,484.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	37,130	7.80	289,614.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	95,160	14.32	1,362,691.20
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	35,560	5.22	185,623.20
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	183,900	17.10	3,144,690.00
SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A	31,700	132.50	4,200,250.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	38,300	289.29	11,079,807.00
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	49,300	77.67	3,829,131.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	7,000	64.22	449,540.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	19,040	93.60	1,782,144.00
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	281,500	26.18	7,369,670.00
BEIJING TONGRENTANG CO-A	29,900	42.00	1,255,800.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	13,804	75.01	1,035,438.04
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	34,200	57.85	1,978,470.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	8,700	125.95	1,095,765.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	36,000	54.53	1,963,080.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	90,296	47.32	4,272,806.72
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	109,500	60.48	6,622,560.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	7,089	47.92	339,704.88
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	54,190	19.60	1,062,124.00
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	29,900	19.85	593,515.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	8,100	338.60	2,742,660.00
JIANGSU HENGRUI PHARMACEUT-A	374,183	45.93	17,186,225.19
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	18,400	11.22	206,448.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	5,800	37.65	218,370.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	210,622	11.53	2,428,471.66
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	28,125	21.27	598,218.75

SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	112,400	24.10	2,708,840.00
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	24,600	27.44	675,024.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	240,500	7.15	1,719,575.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	129,825	22.68	2,944,431.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	89,800	27.73	2,490,154.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	76,100	20.82	1,584,402.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	106,800	30.22	3,227,496.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	180,580	16.76	3,026,520.80
WUXI APPTEC CO LTD-A	87,811	47.91	4,207,025.01
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	80,260	50.62	4,062,761.20
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	19,300	233.91	4,514,463.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	13,860	13.24	183,506.40
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	85,176	16.93	1,442,029.68
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	2,735,000	4.18	11,432,300.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	751,100	5.65	4,243,715.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	137,793	13.01	1,792,686.93
BANK OF CHINA LTD-A	1,412,300	4.39	6,199,997.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	1,209,833	6.24	7,549,357.92
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	151,000	10.83	1,635,330.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	576,750	7.69	4,435,207.50
BANK OF NANJING CO LTD -A	321,500	8.91	2,864,565.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	236,111	20.73	4,894,581.03
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	543,311	6.64	3,607,585.04
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	257,100	6.86	1,763,706.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	1,913,010	3.28	6,274,672.80
CHINA MERCHANTS BANK-A	653,899	31.20	20,401,648.80
CHINA MINSHENG BANKING-A	1,426,128	3.96	5,647,466.88
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	1,093,500	2.95	3,225,825.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	650,600	4.49	2,921,194.00
CNPC CAPITAL CO LTD-A	361,100	5.76	2,079,936.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	679,150	6.32	4,292,228.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	2,029,428	5.25	10,654,497.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	740,574	16.27	12,049,138.98
PING AN BANK CO LTD-A	679,061	10.36	7,035,071.96
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	874,400	4.74	4,144,656.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	884,337	7.04	6,225,732.48

SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	749,400	6.65	4,983,510.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	461,900	3.09	1,427,271.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	452,855	7.66	3,468,869.30
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	322,834	5.27	1,701,335.18
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	223,500	12.52	2,798,220.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	58,000	7.65	443,700.00
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	96,092	33.97	3,264,245.24
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	699,900	14.00	9,798,600.00
CITIC SECURITIES CO-A	397,445	20.50	8,147,622.50
CSC FINANCIAL CO LTD-A	192,700	22.67	4,368,509.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	26,200	8.21	215,102.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	522,334	13.55	7,077,625.70
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	101,600	16.83	1,709,928.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	97,100	5.61	544,731.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	299,965	8.31	2,492,709.15
GF SECURITIES CO LTD-A	281,900	13.85	3,904,315.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	110,261	5.93	653,847.73
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	51,600	12.24	631,584.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	229,500	8.52	1,955,340.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	745,625	14.65	10,923,406.25
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	31,900	6.76	215,644.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,293,479	8.91	11,524,897.89
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	13,530	143.78	1,945,343.40
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	313,740	14.24	4,467,657.60
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	180,700	5.65	1,020,955.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	226,900	8.02	1,819,738.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	341,800	8.60	2,939,480.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	343,400	6.61	2,269,874.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	634,714	4.50	2,856,213.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	210,300	8.83	1,856,949.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	246,100	7.01	1,725,161.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	53,700	3.97	213,189.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	567,600	3.01	1,708,476.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	247,600	7.04	1,743,104.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	74,000	10.97	811,780.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	132,200	6.78	896,316.00

CHINA LIFE INSURANCE CO-A	85,400	28.40	2,425,360.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	212,000	22.66	4,803,920.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	135,086	30.60	4,133,631.60
PICC HOLDING CO-A	647,000	5.02	3,247,940.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	412,422	40.56	16,727,836.32
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	319,600	9.22	2,946,712.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	17,500	329.74	5,770,450.00
EMPYREAN TECHNOLOGY CO LTD-A	17,600	85.74	1,509,024.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	50,398	24.87	1,253,398.26
IFLYTEK CO LTD - A	82,885	51.08	4,233,765.80
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	8,500	78.80	669,800.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	42,276	39.50	1,669,902.00
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	12,400	57.50	713,000.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	87,015	13.14	1,143,377.10
ANKER INNOVATIONS TECHNOLO-A	20,100	82.41	1,656,441.00
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	36,700	24.33	892,911.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	1,238,900	3.92	4,856,488.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	48,197	25.05	1,207,334.85
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	164,000	10.52	1,725,280.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	296,998	5.25	1,559,239.50
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	13,700	55.73	763,501.00
EVERDISPLAY OPTRONICS SHAN-A	696,400	2.21	1,539,044.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	473,900	24.43	11,577,377.00
GOERTEK INC -A	71,400	17.60	1,256,640.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	166,500	12.42	2,067,930.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	1,330,300	10.95	14,566,785.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	49,000	36.36	1,781,640.00
IEIT SYSTEMS CO LTD-A	54,900	40.71	2,234,979.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	109,400	13.49	1,475,806.00
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	217,700	5.64	1,227,828.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	210,512	31.84	6,702,702.08
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	10,752	105.81	1,137,669.12
NINESTAR CORP-A	39,700	23.82	945,654.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	140,200	18.19	2,550,238.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	27,780	89.90	2,497,422.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	31,000	159.52	4,945,120.00

SUPCON TECHNOLOGY CO LTD-A	51,475	45.49	2,341,597.75
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	72,200	15.70	1,133,540.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	918,300	4.48	4,113,984.00
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	9,000	26.72	240,480.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	111,100	8.72	968,792.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	110,648	22.83	2,526,093.84
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	25,000	38.17	954,250.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	157,032	7.60	1,193,443.20
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	132,040	31.84	4,204,153.60
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	6,300	102.50	645,750.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	31,430	25.75	809,322.50
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	75,700	19.07	1,443,599.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	30,100	167.68	5,047,168.00
ZTE CORP-A	154,100	27.88	4,296,308.00
CHINA UNITED NETWORK-A	1,185,800	4.66	5,525,828.00
CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A	323,800	5.38	1,742,044.00
CGN POWER CO LTD-A	632,800	3.85	2,436,280.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	240,000	8.84	2,121,600.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	1,122,300	4.63	5,196,249.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	856,242	25.01	21,414,612.42
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	73,600	19.14	1,408,704.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	570,400	5.01	2,857,704.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	367,600	6.45	2,371,020.00
HUANENG POWER INTL INC-A	324,300	9.00	2,918,700.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	390,500	14.59	5,697,395.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	300,860	6.75	2,030,805.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	180,400	16.50	2,976,600.00
WINTIME ENERGY GROUP CO L-A	2,307,800	1.35	3,115,530.00
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	838,200	6.08	5,096,256.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	20,700	158.81	3,287,367.00
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	10,000	181.31	1,813,100.00
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	51,000	40.40	2,060,400.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	101,300	28.01	2,837,413.00
GALAXYCORE INC-A	100,100	17.78	1,779,778.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTO-CL A	35,556	78.38	2,786,879.28
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	62,322	28.18	1,756,233.96

HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	33,200	21.01	697,532.00	
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	71,200	80.12	5,704,544.00	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	10,100	69.13	698,213.00	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	144,480	17.94	2,591,971.20	
JCET GROUP CO LTD-A	47,200	28.25	1,333,400.00	
JINKO SOLAR CO LTD-A	351,000	8.30	2,913,300.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	385,389	20.09	7,742,465.01	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	52,600	49.29	2,592,654.00	
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	189,500	14.03	2,658,685.00	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	20,900	312.51	6,531,459.00	
PIOTECH INC-A	7,900	216.50	1,710,350.00	
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	358,200	12.95	4,638,690.00	
SG MICRO CORP-A	7,897	68.61	541,813.17	
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A	102,200	14.46	1,477,812.00	
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	8,600	62.85	540,510.00	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	3,500	156.00	546,000.00	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	5,632	111.50	627,968.00	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	164,500	12.60	2,072,700.00	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	201,300	8.26	1,662,738.00	
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	29,100	24.80	721,680.00	
TONGWEI CO LTD-A	157,700	25.52	4,024,504.00	
TRINA SOLAR CO LTD-A	56,200	24.37	1,369,594.00	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	36,299	67.04	2,433,484.96	
WILL SEMICONDUCTOR CO LTD-A	38,915	98.75	3,842,856.25	
XINJIANG DAQO NEW ENERGY C-A	87,400	27.68	2,419,232.00	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	61,400	35.60	2,185,840.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	242,622	9.33	2,263,663.26	
CHINA VANKE CO LTD -A	424,956	9.26	3,935,092.56	
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	498,187	3.60	1,793,473.20	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	357,000	9.37	3,345,090.00	
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	58,700	9.80	575,260.00	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	160,740	9.89	1,589,718.60	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	268,100	2.82	756,042.00	
YOUNGOR FASHION CO LTD-A	106,400	6.96	740,544.00	
オフショア元 小計	107,947,123		1,416,563,773.33 (29,484,075,065)	

サウジアラビア リヤル	ADES HOLDING CO	302,942	21.28	6,446,605.76
	SAUDI ARABIAN OIL CO	1,620,168	31.20	50,549,241.60
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	101,795	39.30	4,000,543.50
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	141,314	122.80	17,353,359.20
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	202,755	31.15	6,315,818.25
	SAUDI ARABIAN MINING CO	869,711	52.00	45,224,972.00
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	26,867	171.60	4,610,377.20
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	554,628	77.90	43,205,521.20
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	194,677	22.00	4,282,894.00
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	362,675	9.19	3,332,983.25
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	158,529	37.60	5,960,690.40
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	23,810	314.80	7,495,388.00
	JARIR MARKETING CO	303,520	14.62	4,437,462.40
	NAHDI MEDICAL CO	18,802	150.40	2,827,820.80
	ALMARAI CO	144,974	57.80	8,379,497.20
	SAVOLA	136,987	54.00	7,397,298.00
	DALLAH HEALTHCARE CO	17,729	177.00	3,138,033.00
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	56,083	315.00	17,666,145.00
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	60,419	122.40	7,395,285.60
	AL RAJHI BANK	1,271,247	88.20	112,123,985.40
	ALINMA BANK	773,259	43.25	33,443,451.75
	ARAB NATIONAL BANK	405,036	29.15	11,806,799.40
	BANK AL-JAZIRA	286,486	20.44	5,855,773.84
	BANK ALBILAD	290,677	49.45	14,373,977.65
	BANQUE SAUDI FRANSI	352,854	38.75	13,673,092.50
	RIYAD BANK	1,010,630	30.95	31,278,998.50
	SAUDI AWWAL BANK	702,713	40.70	28,600,419.10
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	268,331	16.80	4,507,960.80
	THE SAUDI NATIONAL BANK	1,830,883	39.90	73,052,231.70
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	29,391	268.60	7,894,422.60
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	49,780	246.00	12,245,880.00
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	40,167	168.60	6,772,156.20
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	16,778	381.00	6,392,418.00
ELM CO	14,004	956.80	13,399,027.20	
ETIHAD ETISALAT CO	246,942	54.10	13,359,562.20	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	228,789	12.96	2,965,105.44	

	SAUDI TELECOM CO	1,329,690	39.85	52,988,146.50	
	ACWA POWER CO	56,238	343.00	19,289,634.00	
	POWER & WATER UTILITY CO FOR	34,137	74.80	2,553,447.60	
	SAUDI ELECTRICITY CO	540,535	19.86	10,735,025.10	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	274,619	14.74	4,047,884.06	
	サウジアラビアリアル 小計	15,351,571		731,379,335.90 (29,576,980,343)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	544,304	172.00	93,620,288.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	884,882	43.30	38,315,390.60	
	SASA POLYESTER SANAYI	755,799	40.94	30,942,411.06	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	715,526	56.35	40,319,890.10	
	KOC HOLDING AS	575,490	194.80	112,105,452.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	1,407,472	47.76	67,220,862.72	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	23,874	813.50	19,421,499.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	399,830	291.25	116,450,487.50	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	41,470	1,144.00	47,441,680.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	53,584	275.75	14,775,788.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	323,604	370.50	119,895,282.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	67,796	580.50	39,355,578.00	
	AKBANK T. A. S.	1,630,071	45.82	74,689,853.22	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	560,781	79.15	44,385,816.15	
	TURKIYE IS BANKASI-C	4,925,110	11.02	54,274,712.20	
	YAPI VE KREDI BANKASI	1,948,324	26.64	51,903,351.36	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	650,401	69.65	45,300,429.65	
	トルコリラ 小計	15,508,318		1,010,418,771.56 (4,793,830,819)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	40,905	27.50	1,124,887.50	
	MYTILINEOS S. A.	59,964	36.22	2,171,896.08	
	OPAP SA	103,580	16.49	1,708,034.20	
	FF GROUP	5,889	—	—	
	JUMBO SA	66,836	26.04	1,740,409.44	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	1,184,493	1.72	2,043,250.42	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	1,907,754	1.80	3,437,772.70	
	NATIONAL BANK OF GREECE	647,914	7.32	4,747,913.79	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	680,120	3.90	2,652,468.00	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	95,037	13.78	1,309,609.86	

	PUBLIC POWER CORP	111,882	11.85	1,325,801.70	
	ユーロ 小計	4,904,374		22,262,043.69 (3,642,070,347)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	422,627	14.83	6,267,558.41	
	QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT)	1,857,028	4.13	7,669,525.64	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	5,078,546	1.93	9,811,750.87	
	INDUSTRIES QATAR	832,122	12.09	10,060,354.98	
	COMMERCIAL BANK PSQC	1,761,049	5.10	8,981,349.90	
	DUKHAN BANK	1,104,320	3.94	4,353,229.44	
	MASRAF AL RAYAN	3,510,349	2.52	8,846,079.48	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	555,729	11.24	6,246,393.96	
	QATAR ISLAMIC BANK	1,029,304	19.41	19,978,790.64	
	QATAR NATIONAL BANK	2,837,702	14.70	41,714,219.40	
	OOREDOO QPSC	397,674	10.85	4,314,762.90	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	266,231	16.49	4,390,149.19	
	BARWA REAL ESTATE CO	3,105,300	2.90	9,005,370.00	
	カタールリアル 小計	22,757,981		141,639,534.81 (5,890,788,252)	
	合計	3,581,755,556		690,869,109,049 (690,869,109,049)	

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
メキシコ ペソ	投資証券	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	648,200	13,164,942.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	424,363	30,027,925.88	
		TRUST FIBRA UNO	1,759,200	50,981,616.00	
メキシコペソ合計			2,831,763	94,174,483.88 (851,375,004)	
合計				851,375,004 (851,375,004)	

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 45 銘柄	100.00%	—	2.64%
香港ドル	株式 170 銘柄	100.00%	—	18.68%
マレーシアリングgit	株式 32 銘柄	100.00%	—	1.37%
タイバーツ	株式 35 銘柄	100.00%	—	1.55%
フィリピンペソ	株式 14 銘柄	100.00%	—	0.62%
インドネシアルピア	株式 22 銘柄	100.00%	—	1.89%
メキシコペソ	株式 21 銘柄	95.40%	—	2.55%
	投資証券 3 銘柄	—	4.60%	0.12%
ブラジルリアル	株式 49 銘柄	100.00%	—	5.20%
チリペソ	株式 12 銘柄	100.00%	—	0.46%
韓国ウォン	株式 99 銘柄	100.00%	—	12.81%
ニュー台湾ドル	株式 89 銘柄	100.00%	—	17.74%
インドルピー	株式 136 銘柄	100.00%	—	17.54%
チェココルナ	株式 3 銘柄	100.00%	—	0.16%
クウェートディナール	株式 7 銘柄	100.00%	—	0.84%
コロンビアペソ	株式 3 銘柄	100.00%	—	0.11%
ハンガリーフォリント	株式 3 銘柄	100.00%	—	0.24%
アラブディルハム	株式 10 銘柄	100.00%	—	1.20%
ポーランドズロチ	株式 14 銘柄	100.00%	—	0.93%
南アフリカランド	株式 32 銘柄	100.00%	—	2.74%
オフショア元	株式 428 銘柄	100.00%	—	4.26%
サウジアラビアリヤル	株式 41 銘柄	100.00%	—	4.28%
トルコリラ	株式 17 銘柄	100.00%	—	0.69%
ユーロ	株式 11 銘柄	100.00%	—	0.53%
カタールリアル	株式 13 銘柄	100.00%	—	0.85%

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)

[2024年3月25日現在]

資産の部

流動資産

コール・ローン

1,055,900,462

国債証券	164,436,849,880
地方債証券	10,926,895,000
特殊債証券	9,145,087,007
社債証券	11,226,857,700
未収入金	7,803,597,700
未収利息	182,364,175
前払金	720,000
前払費用	28,177,043
差入委託証拠金	3,237,381
流動資産合計	204,809,686,348
資産合計	204,809,686,348
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	421,870
未払解約金	68,280,093
流動負債合計	68,701,963
負債合計	68,701,963
純資産の部	
元本等	
元本	221,057,167,943
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	△16,316,183,558
元本等合計	204,740,984,385
純資産合計	204,740,984,385
負債純資産合計	204,809,686,348

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)

	[2024年3月25日現在]
1. 期首	2023年3月28日
期首元本額	162,384,089,172円
期中追加設定元本額	399,017,796,654円
期中一部解約元本額	340,344,717,883円
元本の内訳※	
ファンド・マネジャー(国内債券)	19,161,881,514円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	12,231,447,721円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	293,180,929円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	44,135,284円
アクティブアロケーションファンド(ラップ向け)	59,258,329円

三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	6,925,905,524 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	1,516,032,012 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	308,506,970 円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	9,239,635,988 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	4,705,815,721 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)	20,691,169,864 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)	6,657,288,722 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)	24,169,699,034 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)	2,563,174,592 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)	112,293,528,123 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)	196,507,616 円
合計	221,057,167,943 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。	16,316,183,558 円
3. 受益権の総数	221,057,167,943 円

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023 年 3 月 28 日 至 2024 年 3 月 25 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和 26 年法律第 198 号)第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024 年 3 月 25 日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。
----------------------------	---

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024年3月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△2,716,372,560
地方債証券	△111,608,410
特殊債券	△157,303,782
社債券	△69,531,600
合計	△3,054,816,352

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

債券関連

[2024年3月25日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	291,540,000	—	291,120,000	△420,000
合計		291,540,000	—	291,120,000	△420,000

(注) 時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[2024年3月25日現在]
1口当たり純資産額	0.9262円
(1万口当たり純資産額)	(9,262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447回利付国債(2年)	340,000,000	339,809,600	
	第448回利付国債(2年)	810,000,000	809,465,400	
	第449回利付国債(2年)	180,000,000	179,850,600	
	第450回利付国債(2年)	850,000,000	849,133,000	
	第451回利付国債(2年)	1,900,000,000	1,897,815,000	
	第452回利付国債(2年)	1,070,000,000	1,068,459,200	
	第453回利付国債(2年)	970,000,000	968,234,600	
	第454回利付国債(2年)	1,100,000,000	1,099,472,000	
	第455回利付国債(2年)	1,830,000,000	1,825,077,300	
	第457回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,297,829,000	
	第144回利付国債(5年)	200,000,000	200,060,000	
	第145回利付国債(5年)	400,000,000	399,940,000	
	第146回利付国債(5年)	1,420,000,000	1,418,523,200	
	第147回利付国債(5年)	3,400,000,000	3,387,896,000	
	第148回利付国債(5年)	3,420,000,000	3,405,533,400	
	第149回利付国債(5年)	1,120,000,000	1,114,444,800	
	第150回利付国債(5年)	740,000,000	735,870,800	
	第151回利付国債(5年)	1,850,000,000	1,838,197,000	
	第152回利付国債(5年)	550,000,000	548,042,000	
	第153回利付国債(5年)	2,520,000,000	2,501,377,200	
	第154回利付国債(5年)	2,940,000,000	2,924,241,600	
	第155回利付国債(5年)	70,000,000	70,051,100	
	第156回利付国債(5年)	2,310,000,000	2,303,162,400	
	第157回利付国債(5年)	580,000,000	577,598,800	
	第158回利付国債(5年)	690,000,000	684,431,700	
	第159回利付国債(5年)	390,000,000	386,412,000	
	第160回利付国債(5年)	90,000,000	89,548,200	
	第161回利付国債(5年)	1,550,000,000	1,548,698,000	
	第162回利付国債(5年)	170,000,000	169,586,900	
	第163回利付国債(5年)	2,650,000,000	2,655,247,000	
	第164回利付国債(5年)	110,000,000	109,078,200	
	第165回利付国債(5年)	1,660,000,000	1,653,808,200	
第1回利付国債(40年)	540,000,000	622,425,600		

第2回利付国債（40年）	370,000,000	410,355,900	
第3回利付国債（40年）	300,000,000	331,818,000	
第4回利付国債（40年）	500,000,000	551,340,000	
第5回利付国債（40年）	340,000,000	359,339,200	
第6回利付国債（40年）	271,000,000	279,623,220	
第7回利付国債（40年）	450,000,000	441,234,000	
第8回利付国債（40年）	460,000,000	417,174,000	
第9回利付国債（40年）	710,000,000	469,189,300	
第10回利付国債（40年）	740,000,000	573,100,400	
第11回利付国債（40年）	530,000,000	393,360,700	
第12回利付国債（40年）	531,000,000	349,095,330	
第13回利付国債（40年）	860,000,000	557,959,400	
第14回利付国債（40年）	700,000,000	482,930,000	
第15回利付国債（40年）	930,000,000	706,381,500	
第16回利付国債（40年）	670,000,000	556,890,600	
第339回利付国債（10年）	230,000,000	230,922,300	
第340回利付国債（10年）	750,000,000	753,225,000	
第341回利付国債（10年）	300,000,000	300,726,000	
第342回利付国債（10年）	110,000,000	109,815,200	
第343回利付国債（10年）	540,000,000	538,855,200	
第344回利付国債（10年）	770,000,000	767,998,000	
第345回利付国債（10年）	150,000,000	149,550,000	
第346回利付国債（10年）	300,000,000	298,887,000	
第347回利付国債（10年）	940,000,000	935,920,400	
第349回利付国債（10年）	1,200,000,000	1,192,008,000	
第350回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,388,702,000	
第351回利付国債（10年）	280,000,000	277,424,000	
第352回利付国債（10年）	1,600,000,000	1,582,320,000	
第353回利付国債（10年）	413,000,000	407,713,600	
第354回利付国債（10年）	1,800,000,000	1,774,476,000	
第355回利付国債（10年）	690,000,000	679,380,900	
第356回利付国債（10年）	920,000,000	904,930,400	
第357回利付国債（10年）	2,300,000,000	2,260,026,000	
第358回利付国債（10年）	280,000,000	274,769,600	
第359回利付国債（10年）	1,700,000,000	1,665,422,000	
第360回利付国債（10年）	720,000,000	704,109,600	

第361回利付国債（10年）	2,080,000,000	2,029,726,400	
第362回利付国債（10年）	2,060,000,000	2,005,739,600	
第363回利付国債（10年）	1,440,000,000	1,398,787,200	
第364回利付国債（10年）	1,560,000,000	1,510,594,800	
第365回利付国債（10年）	1,730,000,000	1,670,972,400	
第366回利付国債（10年）	880,000,000	854,480,000	
第367回利付国債（10年）	1,190,000,000	1,152,634,000	
第368回利付国債（10年）	1,610,000,000	1,555,469,300	
第369回利付国債（10年）	1,760,000,000	1,740,323,200	
第370回利付国債（10年）	1,390,000,000	1,371,707,600	
第371回利付国債（10年）	1,190,000,000	1,161,035,400	
第372回利付国債（10年）	2,240,000,000	2,260,921,600	
第373回利付国債（10年）	1,470,000,000	1,452,624,600	
第5回利付国債（30年）	50,000,000	55,984,000	
第7回利付国債（30年）	50,000,000	56,848,000	
第10回利付国債（30年）	50,000,000	51,975,500	
第12回利付国債（30年）	470,000,000	530,427,900	
第14回利付国債（30年）	190,000,000	220,242,300	
第15回利付国債（30年）	100,000,000	117,080,000	
第16回利付国債（30年）	520,000,000	609,663,600	
第17回利付国債（30年）	250,000,000	290,842,500	
第18回利付国債（30年）	280,000,000	323,218,000	
第19回利付国債（30年）	230,000,000	265,702,900	
第20回利付国債（30年）	300,000,000	353,469,000	
第21回利付国債（30年）	250,000,000	289,147,500	
第22回利付国債（30年）	80,000,000	94,407,200	
第23回利付国債（30年）	650,000,000	767,585,000	
第24回利付国債（30年）	380,000,000	449,008,000	
第25回利付国債（30年）	510,000,000	590,911,500	
第26回利付国債（30年）	540,000,000	631,956,600	
第27回利付国債（30年）	450,000,000	532,435,500	
第28回利付国債（30年）	380,000,000	449,650,200	
第29回利付国債（30年）	270,000,000	316,032,300	
第30回利付国債（30年）	640,000,000	740,217,600	
第31回利付国債（30年）	530,000,000	604,745,900	
第32回利付国債（30年）	350,000,000	403,798,500	

第33回利付国債（30年）	810,000,000	896,718,600	
第34回利付国債（30年）	700,000,000	794,269,000	
第35回利付国債（30年）	780,000,000	859,014,000	
第36回利付国債（30年）	920,000,000	1,012,386,400	
第37回利付国債（30年）	650,000,000	703,410,500	
第38回利付国債（30年）	410,000,000	435,247,800	
第39回利付国債（30年）	340,000,000	366,037,200	
第40回利付国債（30年）	451,000,000	476,792,690	
第41回利付国債（30年）	410,000,000	425,399,600	
第42回利付国債（30年）	470,000,000	486,694,400	
第43回利付国債（30年）	490,000,000	506,782,500	
第44回利付国債（30年）	400,000,000	413,184,000	
第45回利付国債（30年）	470,000,000	468,148,200	
第46回利付国債（30年）	560,000,000	556,886,400	
第47回利付国債（30年）	520,000,000	525,829,200	
第48回利付国債（30年）	676,000,000	658,058,960	
第49回利付国債（30年）	360,000,000	349,797,600	
第50回利付国債（30年）	630,000,000	540,558,900	
第51回利付国債（30年）	610,000,000	464,698,000	
第52回利付国債（30年）	530,000,000	421,726,300	
第53回利付国債（30年）	490,000,000	397,698,700	
第54回利付国債（30年）	590,000,000	499,765,400	
第55回利付国債（30年）	430,000,000	363,117,800	
第56回利付国債（30年）	460,000,000	387,255,600	
第57回利付国債（30年）	500,000,000	419,635,000	
第58回利付国債（30年）	350,000,000	292,593,000	
第59回利付国債（30年）	450,000,000	365,854,500	
第60回利付国債（30年）	340,000,000	288,972,800	
第61回利付国債（30年）	368,000,000	296,935,520	
第62回利付国債（30年）	480,000,000	366,148,800	
第63回利付国債（30年）	450,000,000	332,311,500	
第64回利付国債（30年）	440,000,000	323,606,800	
第65回利付国債（30年）	420,000,000	307,910,400	
第66回利付国債（30年）	420,000,000	306,146,400	
第67回利付国債（30年）	550,000,000	422,224,000	
第68回利付国債（30年）	590,000,000	450,878,000	

第69回利付国債（30年）	510,000,000	399,365,700	
第70回利付国債（30年）	440,000,000	343,362,800	
第71回利付国債（30年）	520,000,000	404,372,800	
第72回利付国債（30年）	620,000,000	480,444,200	
第73回利付国債（30年）	410,000,000	316,889,000	
第74回利付国債（30年）	600,000,000	501,798,000	
第75回利付国債（30年）	480,000,000	432,235,200	
第76回利付国債（30年）	480,000,000	442,176,000	
第77回利付国債（30年）	570,000,000	549,970,200	
第78回利付国債（30年）	710,000,000	652,177,600	
第79回利付国債（30年）	370,000,000	324,060,800	
第80回利付国債（30年）	570,000,000	573,864,600	
第81回利付国債（30年）	360,000,000	345,049,200	
第78回利付国債（20年）	100,000,000	102,252,000	
第80回利付国債（20年）	100,000,000	102,499,000	
第81回利付国債（20年）	100,000,000	102,807,000	
第83回利付国債（20年）	200,000,000	206,720,000	
第84回利付国債（20年）	200,000,000	206,374,000	
第86回利付国債（20年）	140,000,000	145,866,000	
第89回利付国債（20年）	200,000,000	208,948,000	
第90回利付国債（20年）	300,000,000	314,850,000	
第92回利付国債（20年）	700,000,000	736,099,000	
第93回利付国債（20年）	50,000,000	52,645,500	
第94回利付国債（20年）	60,000,000	63,352,800	
第95回利付国債（20年）	400,000,000	426,592,000	
第96回利付国債（20年）	100,000,000	106,005,000	
第97回利付国債（20年）	100,000,000	106,742,000	
第98回利付国債（20年）	200,000,000	212,792,000	
第99回利付国債（20年）	300,000,000	320,250,000	
第100回利付国債（20年）	650,000,000	698,750,000	
第102回利付国債（20年）	200,000,000	217,474,000	
第103回利付国債（20年）	200,000,000	216,638,000	
第105回利付国債（20年）	220,000,000	237,061,000	
第106回利付国債（20年）	140,000,000	151,475,800	
第107回利付国債（20年）	250,000,000	270,260,000	
第108回利付国債（20年）	300,000,000	321,516,000	

第109回利付国債（20年）	300,000,000	322,380,000	
第110回利付国債（20年）	100,000,000	108,438,000	
第111回利付国債（20年）	40,000,000	43,725,600	
第112回利付国債（20年）	500,000,000	544,005,000	
第113回利付国債（20年）	620,000,000	677,139,200	
第114回利付国債（20年）	100,000,000	109,595,000	
第115回利付国債（20年）	100,000,000	110,156,000	
第116回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,160,439,000	
第117回利付国債（20年）	560,000,000	615,630,400	
第118回利付国債（20年）	350,000,000	383,719,000	
第119回利付国債（20年）	100,000,000	108,418,000	
第120回利付国債（20年）	250,000,000	267,925,000	
第121回利付国債（20年）	610,000,000	666,595,800	
第122回利付国債（20年）	160,000,000	173,833,600	
第123回利付国債（20年）	180,000,000	199,485,000	
第124回利付国債（20年）	400,000,000	440,684,000	
第125回利付国債（20年）	510,000,000	570,042,300	
第126回利付国債（20年）	110,000,000	121,420,200	
第127回利付国債（20年）	40,000,000	43,882,400	
第128回利付国債（20年）	190,000,000	208,792,900	
第129回利付国債（20年）	490,000,000	535,040,800	
第130回利付国債（20年）	180,000,000	196,745,400	
第131回利付国債（20年）	540,000,000	586,342,800	
第132回利付国債（20年）	290,000,000	315,215,500	
第133回利付国債（20年）	702,000,000	768,254,760	
第134回利付国債（20年）	610,000,000	668,566,100	
第135回利付国債（20年）	100,000,000	108,794,000	
第136回利付国債（20年）	100,000,000	108,030,000	
第137回利付国債（20年）	780,000,000	849,326,400	
第138回利付国債（20年）	70,000,000	75,091,100	
第139回利付国債（20年）	380,000,000	410,787,600	
第140回利付国債（20年）	890,000,000	970,242,400	
第141回利付国債（20年）	370,000,000	403,618,200	
第142回利付国債（20年）	710,000,000	780,403,600	
第143回利付国債（20年）	1,080,000,000	1,170,061,200	
第144回利付国債（20年）	530,000,000	569,442,600	

第145回利付国債（20年）	924,000,000	1,008,961,800	
第146回利付国債（20年）	20,000,000	21,837,600	
第147回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,136,656,500	
第148回利付国債（20年）	660,000,000	707,942,400	
第149回利付国債（20年）	900,000,000	965,079,000	
第150回利付国債（20年）	360,000,000	382,194,000	
第151回利付国債（20年）	840,000,000	873,650,400	
第152回利付国債（20年）	640,000,000	664,838,400	
第153回利付国債（20年）	690,000,000	723,327,000	
第154回利付国債（20年）	730,000,000	756,338,400	
第155回利付国債（20年）	560,000,000	566,843,200	
第156回利付国債（20年）	982,000,000	924,886,880	
第157回利付国債（20年）	310,000,000	283,736,800	
第158回利付国債（20年）	690,000,000	653,147,100	
第159回利付国債（20年）	400,000,000	382,136,000	
第160回利付国債（20年）	500,000,000	481,930,000	
第161回利付国債（20年）	750,000,000	711,187,500	
第162回利付国債（20年）	790,000,000	746,234,000	
第163回利付国債（20年）	640,000,000	602,169,600	
第164回利付国債（20年）	984,000,000	909,688,320	
第165回利付国債（20年）	680,000,000	625,926,400	
第166回利付国債（20年）	890,000,000	839,741,700	
第167回利付国債（20年）	720,000,000	657,295,200	
第168回利付国債（20年）	390,000,000	349,264,500	
第169回利付国債（20年）	540,000,000	473,736,600	
第170回利付国債（20年）	720,000,000	628,387,200	
第171回利付国債（20年）	550,000,000	477,521,000	
第172回利付国債（20年）	810,000,000	711,641,700	
第173回利付国債（20年）	810,000,000	707,996,700	
第174回利付国債（20年）	750,000,000	652,147,500	
第175回利付国債（20年）	710,000,000	625,048,500	
第176回利付国債（20年）	570,000,000	499,610,700	
第177回利付国債（20年）	710,000,000	608,455,800	
第178回利付国債（20年）	800,000,000	694,456,000	
第179回利付国債（20年）	730,000,000	631,260,200	
第180回利付国債（20年）	640,000,000	581,900,800	

	第181回利付国債（20年）	600,000,000	553,200,000	
	第182回利付国債（20年）	850,000,000	808,979,000	
	第183回利付国債（20年）	580,000,000	578,706,600	
	第184回利付国債（20年）	790,000,000	747,166,200	
	第185回利付国債（20年）	1,120,000,000	1,055,476,800	
	第186回利付国債（20年）	410,000,000	412,484,600	
	第187回利付国債（20年）	390,000,000	378,120,600	
	第1回大韓民国	100,000,000	100,184,000	
国債証券 合計		167,332,000,000	164,436,849,880	
地方債証券	第8回東京都公募公債（30年）	80,000,000	90,491,200	
	第9回東京都公募公債（20年）	100,000,000	104,749,000	
	第26回東京都公募公債（20年）	100,000,000	108,296,000	
	第750回東京都公募公債	100,000,000	100,309,000	
	第753回東京都公募公債	150,000,000	149,334,000	
	第792回東京都公募公債	100,000,000	97,836,000	
	第1回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	116,794,000	
	第12回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	109,081,000	
	第26回神奈川県公募公債（20年）	20,000,000	21,171,400	
	第40回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	85,042,000	
	第11回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	108,025,000	
	第13回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	102,353,000	
	第171回大阪府公募公債（5年）	200,000,000	199,606,000	
	第176回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	99,627,000	
	第187回大阪府公募公債（5年）	200,000,000	198,482,000	
	第412回大阪府公募公債	600,000,000	596,328,000	
	第449回大阪府公募公債	400,000,000	388,904,000	
	第451回大阪府公募公債	152,000,000	148,201,520	
	第466回大阪府公募公債	137,000,000	133,142,080	
	平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	91,619,000	
	第2回兵庫県公募公債（30年）	100,000,000	114,483,000	
	第3回兵庫県公募公債（15年）	400,000,000	413,220,000	
	第5回兵庫県公募公債（15年）	400,000,000	414,500,000	
	第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	103,865,000	
	第15回兵庫県公募公債（20年）	200,000,000	215,030,000	
	平成27年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	100,364,000	
平成20年度第2回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	108,493,000		

平成25年度第5回愛知県公募公債（15年）	200,000,000	207,560,000	
平成26年度第4回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	106,510,000	
第3回埼玉県公募公債	100,000,000	100,618,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	107,644,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	500,000,000	515,670,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	216,064,000	
令和5年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	100,575,000	
第13回群馬県公募公債	300,000,000	301,176,000	
平成27年度第1回大分県公募公債	200,000,000	200,768,000	
第153回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,356,000	
第164回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,648,000	
第165回共同発行市場公募地方債	500,000,000	497,740,000	
第166回共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,842,000	
第214回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,008,000	
第222回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,169,000	
第227回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,755,000	
平成27年度第1回長崎県公募公債	200,000,000	200,892,000	
平成28年度第2回島根県公募公債（20年）	100,000,000	93,514,000	
平成27年度第2回熊本県公募公債	200,000,000	200,768,000	
令和3年度第1回熊本市公募公債	100,000,000	96,116,000	
平成27年度第1回新潟市公募公債	10,000,000	10,034,600	
令和3年度第1回静岡市公募公債	200,000,000	192,672,000	
令和3年度第1回大阪市公募公債（5年）	300,000,000	298,131,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	116,526,000	
平成20年度第24回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	107,513,000	
第22回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	216,942,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	100,452,000	
平成23年度第3回札幌市公募公債	100,000,000	109,429,000	
平成26年度第5回札幌市公募公債	100,000,000	102,430,000	
令和3年度第9回札幌市公募公債（5年）	500,000,000	496,420,000	
第6回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	108,666,000	
第9回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	109,766,000	
平成23年度第4回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	109,070,000	
2021年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	96,248,000	
平成30年度第5回広島市公募公債	300,000,000	296,166,000	
平成30年度第3回千葉市公募公債	10,000,000	9,908,200	

	第148回福岡北九州高速道路債券（20年）	100,000,000	93,782,000	
地方債証券 合計		10,759,000,000	10,926,895,000	
特殊債券	第4回政府保証新関西国際空港債券	378,000,000	379,606,500	
	第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	116,385,000	
	第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	108,235,000	
	第50回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	87,773,000	
	第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	50,000,000	54,613,500	
	第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	101,220,000	
	第156回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	102,342,000	
	第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,761,000	
	第221回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,062,000	
	第259回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,706,000	
	第303回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	106,000,000	105,661,860	
	第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,972,000	
	第358回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	92,527,000	
	第372回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	196,720,000	
	第4回公営企業債券（30年）（財投機関債）	100,000,000	119,233,000	
	第8回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	108,869,000	
	第11回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	108,037,000	
	第16回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	108,436,000	
	第22回公営企業債券（20年）（財投機関債）	400,000,000	424,776,000	
	第24回公営企業債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	107,379,000	
	第24回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	107,608,000	
	第48回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	100,527,000	
	第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	500,000,000	501,865,000	
	第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	13,000,000	13,037,570	
F89回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	104,020,000		
第101回政府保証地方公共団体金融機構債券	118,000,000	117,355,720		

第102回政府保証地方公共団体金融機構債券	122,000,000	121,231,400	
F149回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	101,451,000	
第17回政府保証民間都市開発債券	200,000,000	199,634,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	31,201,000	30,948,895	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,120,000	30,284,217	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,064,000	17,681,375	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,633,000	50,397,891	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,444,000	53,076,832	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,038,000	31,525,606	
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,211,000	100,649,579	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	80,000,000	87,800,800	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,481,000	87,754,000	
第82回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	101,505,000	102,434,785	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	107,523,000	108,489,631	
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,614,000	87,873,696	
第94回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	300,000,000	326,241,000	
第102回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	300,000,000	309,435,000	
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,957,000	54,364,013	
第107回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	118,920,000	114,489,040	
第110回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	320,640,000	304,681,747	
第120回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,614,000	64,552,438	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,520,000	132,102,368	
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,926,000	134,806,991	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,760,000	68,956,107	
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,795,000	70,151,002	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,656,000	71,963,886	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	315,864,000	292,114,185	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	326,880,000	306,142,732	
第156回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,396,000	153,897,671	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,747,000	82,146,986	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,673,000	85,489,224	
第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,940,000	85,480,871	
第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,206,000	94,550,030	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,434,000	189,152,106	

	第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,577,000	95,439,322	
	第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,077,000	95,767,431	
	第321回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	300,000,000	297,414,000	
	い第853号商工債券	100,000,000	99,139,000	
	い第854号商工債券	100,000,000	99,084,000	
	い第863号商工債券	200,000,000	198,156,000	
	第268号商工債券（3年）	100,000,000	99,779,000	
	第84回中日本高速道路	100,000,000	99,761,000	
	第26回西日本高速道路	100,000,000	100,427,000	
	第30回西日本高速道路	130,000,000	129,441,000	
特殊債券 合計		9,111,416,000	9,145,087,007	
社債券	第19回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	100,516,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	99,881,000	
	第35回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	98,758,000	
	第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	100,000,000	98,301,000	
	第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	100,000,000	99,588,000	
	第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	100,000,000	99,055,000	
	第4回フランス預金供託公庫	100,000,000	100,151,000	
	第1回サンタンデール銀行（2019）	100,000,000	99,770,000	
	第21回新関西国際空港	100,000,000	82,886,000	
	第24回成田国際空港	100,000,000	99,120,000	
	第27回成田国際空港	200,000,000	182,752,000	
	第13回キリンホールディングス	100,000,000	97,199,000	
	第9回サントリーホールディングス	100,000,000	99,484,000	
	第3回 キューピー	100,000,000	99,652,000	
	第13回日本たばこ産業	100,000,000	98,637,000	
	第15回日本たばこ産業	200,000,000	199,514,000	
	第14回セブン&アイ・ホールディングス	100,000,000	99,604,000	
	第9回クラレ	100,000,000	99,379,000	
	第37回昭和電工	200,000,000	198,346,000	
	第46回三井化学	200,000,000	198,512,000	
	第13回ヤフー	100,000,000	95,652,000	
	第18回Zホールディングス	300,000,000	291,198,000	
	第20回Zホールディングス（グリーン）	100,000,000	96,869,000	
	第22回Zホールディングス	100,000,000	99,019,000	

第11回ブリヂストン	200,000,000	198,554,000	
第4回新日本製鐵	100,000,000	99,385,000	
第9回新日本製鐵	100,000,000	98,583,000	
第1回住友生命2023基金	100,000,000	98,954,000	
第14回LIXIL	100,000,000	99,255,000	
第4回日本郵政	200,000,000	199,818,000	
第30回ダイキン工業	100,000,000	98,451,000	
第7回ジェイテクト	100,000,000	98,726,000	
第36回三菱重工業(グリーン)	300,000,000	298,515,000	
第31回トヨタ自動車(サステナビリティ)	100,000,000	98,063,000	
第18回アイシン精機	100,000,000	99,093,000	
第1回明治安田生命2019基金	100,000,000	99,909,000	
第7回アシックス	100,000,000	100,088,000	
第114回丸紅	200,000,000	200,252,000	
第63回三井物産	100,000,000	105,516,000	
第55回住友商事	200,000,000	197,664,000	
第61回住友商事	100,000,000	100,165,000	
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	100,000,000	99,929,000	
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	100,000,000	97,643,000	
第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	100,000,000	101,717,000	
第33回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	200,000,000	205,490,000	
第38回芙蓉総合リース(サステナビリティ)	100,000,000	100,332,000	
第7回みずほリース	200,000,000	197,492,000	
第22回みずほリース(サステナビリティ)	200,000,000	199,542,000	
第18回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	200,000,000	195,314,000	
第26回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン)	100,000,000	98,648,000	
第28回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン)	200,000,000	199,740,000	
第29回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン)	200,000,000	201,374,000	
第56回日産フィナンシャルサービス	100,000,000	99,123,000	
第24回ポケットカード	100,000,000	99,821,000	
第34回三井住友ファイナンス&リース	100,000,000	99,871,000	
第3回野村ホールディングス	100,000,000	98,800,000	
第83回三井不動産(グリーン)	100,000,000	97,719,000	
第111回住友不動産(グリーン)	100,000,000	99,540,000	

第78回東京急行電鉄	100,000,000	103,795,000	
第57回東日本旅客鉄道	100,000,000	108,122,000	
第73回東日本旅客鉄道	200,000,000	217,712,000	
第184回東日本旅客鉄道	100,000,000	99,790,000	
第68回東海旅客鉄道	100,000,000	104,919,000	
第73回東海旅客鉄道	100,000,000	98,837,000	
第13回東京地下鉄	100,000,000	106,498,000	
第58回阪急阪神ホールディングス	100,000,000	99,369,000	
第31回KDDI（サステナビリティ）	100,000,000	99,360,000	
第7回ソフトバンク	100,000,000	95,425,000	
第9回ソフトバンク	400,000,000	392,220,000	
第13回ソフトバンク	100,000,000	93,685,000	
第15回ソフトバンク	100,000,000	96,640,000	
第503回中部電力	10,000,000	10,030,700	
第554回関西電力	200,000,000	199,842,000	
第448回中国電力	100,000,000	98,426,000	
第513回東北電力	100,000,000	97,222,000	
第525回東北電力	100,000,000	98,562,000	
第552回東北電力	100,000,000	100,500,000	
第484回九州電力	100,000,000	97,354,000	
第325回北海道電力	100,000,000	102,423,000	
第357回北海道電力	100,000,000	98,266,000	
第84回電源開発	300,000,000	300,945,000	
第86回電源開発	100,000,000	98,482,000	
第45回東京電力パワーグリッド	100,000,000	97,309,000	
第49回東京電力パワーグリッド	200,000,000	198,952,000	
第50回東京電力パワーグリッド	100,000,000	97,347,000	
第16回JERA	100,000,000	99,622,000	
第17回JERA	100,000,000	99,889,000	
第13回広島ガス	100,000,000	98,385,000	
社債券 合計	11,310,000,000	11,226,857,700	
合計	198,512,416,000	195,735,689,587	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年3月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	593,310,285
コール・ローン	2,035,194,374
国債証券	346,299,038,280
派生商品評価勘定	27,221,493
未収入金	266,052
未収利息	2,608,537,817
前払費用	258,884,800
流動資産合計	351,822,453,101
資産合計	351,822,453,101
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,427,197,630
未払金	17,315,978,066
未払解約金	477,617,055
流動負債合計	20,220,792,751
負債合計	20,220,792,751
純資産の部	
元本等	
元本	296,996,179,772
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	34,605,480,578
元本等合計	331,601,660,350
純資産合計	331,601,660,350
負債純資産合計	351,822,453,101

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年 3月 25日現在]
1. 期首	2023年 3月 28日
期首元本額	194,810,700,487円
期中追加設定元本額	136,284,026,450円
期中一部解約元本額	34,098,547,165円
元本の内訳※	
eMAXIS 先進国債券インデックス (為替ヘッジあり)	993,171,052円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	14,732,583,251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)	4,701,087,675円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	356,096,794円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	55,611,128円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	74,764,288円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	3,891,227,596円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	4,563,118,388円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	274,188,920円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	5,168,475,015円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	1,924,330,927円
eMAXIS 債券バランス (2資産均等型)	88,455,804円
MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド (適格機関投資家転売制限付)	116,161,105,545円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	9,607,361,760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)	11,572,106,844円
MUKAM バランス・イノベーション (リスク抑制型) (適格機関投資家転売制限付)	3,748,005,755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)	372,777,842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)	11,632,099,513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)	1,060,837,345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)	18,849,190,476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)	6,249,776,598円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	246,162,165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)	62,859,974,157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)	112,178,753円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	793,180円
MUKAM バランスファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	2,435,092,729円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	325,643,502円
MUKAM バランスファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	2,412,645,299円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	322,196,277円
MUKAM バランスファンド2020-10 (適格機関投資家限定)	2,406,347,053円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	322,720,012円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	321,351,725円

MUKAM バランスファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	2,129,580,674 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	315,633,120 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	316,748,113 円
MUKAM バランスファンド2021-06 (適格機関投資家限定)	2,165,036,522 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)	312,894,225 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	315,490,691 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	315,059,067 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	329,350,862 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	336,722,167 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	352,830,037 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	359,565,752 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	371,026,379 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	388,518,761 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	376,017,480 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)	388,520,282 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定)	381,708,272 円
合計	296,996,179,772 円
2. 受益権の総数	296,996,179,772 円

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023 年 3 月 28 日 至 2024 年 3 月 25 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等</p>

のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年 3月 25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024年 3月 25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	273,618,712
合計	273,618,712

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[2024年 3月 25日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	8,577,530,760	—	8,577,389,110	△141,650
	カナダドル	535,940,620	—	535,934,354	△6,266
	オーストラリアドル	283,030,790	—	283,024,476	△6,314
	イギリスポンド	1,060,047,360	—	1,060,031,792	△15,568
	シンガポールドル	42,626,880	—	42,626,196	△684
	マレーシアリング	124,924,500	—	124,878,753	△45,747
	スウェーデンクローネ	40,258,870	—	40,258,308	△562
	デンマーククローネ	41,897,760	—	41,895,468	△2,292

メキシコペソ	196,859,576	196,850,860	△8,716
ポーランドズロチ	179,726,700	179,711,500	△15,200
中国元	1,545,369,560	1,539,545,192	△5,824,368
ユーロ	6,485,352,250	6,485,257,090	△95,160
売建			
アメリカドル	163,146,930,173	164,561,716,620	△1,414,786,447
カナダドル	6,961,327,826	7,003,814,675	△42,486,849
オーストラリアドル	4,808,794,846	4,858,356,508	△49,561,662
イギリスポンド	18,079,565,505	18,142,695,670	△63,130,165
シンガポールドル	1,493,494,754	1,500,803,421	△7,308,667
マレーシアリンギット	1,783,022,216	1,803,237,050	△20,214,834
ニュージーランドドル	795,870,912	790,226,456	5,644,456
スウェーデンクローネ	695,576,136	686,428,225	9,147,911
ノルウェークローネ	590,971,250	586,696,050	4,275,200
デンマーククローネ	952,245,442	956,449,152	△4,203,710
メキシコペソ	3,210,818,752	3,310,464,640	△99,645,888
イスラエルシェケル	1,118,054,394	1,115,792,625	2,261,769
ポーランドズロチ	1,969,654,994	1,980,658,248	△11,003,254
中国元	30,577,807,242	30,738,450,864	△160,643,622
ユーロ	111,437,905,840	111,980,063,688	△542,157,848
合計	366,735,605,908	369,123,256,991	△2,399,976,137

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[2024年3月25日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1165円 (11,165円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
アメリカ ドル	国債証券	0.25 T-NOTE 250531	5,200,000.00	4,925,375.00	
		0.25 T-NOTE 250630	4,000,000.00	3,776,562.48	
		0.25 T-NOTE 250731	5,000,000.00	4,704,589.85	
		0.25 T-NOTE 250831	4,290,000.00	4,023,383.19	
		0.25 T-NOTE 250930	5,050,000.00	4,720,369.12	
		0.25 T-NOTE 251031	4,000,000.00	3,727,265.64	
		0.375 T-NOTE 250430	4,000,000.00	3,806,562.48	
		0.375 T-NOTE 251130	4,000,000.00	3,722,890.64	
		0.375 T-NOTE 251231	6,000,000.00	5,567,929.68	
		0.375 T-NOTE 260131	6,600,000.00	6,105,515.59	
		0.375 T-NOTE 270731	4,000,000.00	3,511,796.88	
		0.375 T-NOTE 270930	4,200,000.00	3,665,074.22	
		0.5 T-NOTE 250331	2,200,000.00	2,103,402.99	
		0.5 T-NOTE 260228	4,700,000.00	4,347,132.83	
		0.5 T-NOTE 270430	4,200,000.00	3,734,144.52	
		0.5 T-NOTE 270531	4,000,000.00	3,545,156.23	
		0.5 T-NOTE 270630	3,500,000.00	3,094,628.91	
		0.5 T-NOTE 270831	3,850,000.00	3,384,766.61	
		0.5 T-NOTE 271031	5,200,000.00	4,545,328.11	
		0.625 T-NOTE 260731	4,680,000.00	4,280,280.45	
		0.625 T-NOTE 270331	1,500,000.00	1,343,466.79	
		0.625 T-NOTE 271130	4,500,000.00	3,942,685.53	
0.625 T-NOTE 271231	5,480,000.00	4,788,364.04			
0.625 T-NOTE 300515	8,200,000.00	6,621,179.70			
0.625 T-NOTE 300815	11,200,000.00	8,967,874.94			

0.75 T-NOTE 260331	4,300,000.00	3,987,074.20	
0.75 T-NOTE 260430	4,300,000.00	3,975,652.33	
0.75 T-NOTE 260531	6,000,000.00	5,532,421.86	
0.75 T-NOTE 260831	6,000,000.00	5,489,882.82	
0.75 T-NOTE 280131	8,000,000.00	7,004,218.71	
0.875 T-NOTE 260630	5,000,000.00	4,614,355.45	
0.875 T-NOTE 260930	4,000,000.00	3,664,609.36	
0.875 T-NOTE 301115	10,300,000.00	8,334,751.96	
1 T-NOTE 280731	7,780,000.00	6,784,403.11	
1.125 T-BOND 400515	4,520,000.00	2,810,257.02	
1.125 T-BOND 400815	3,950,000.00	2,433,570.31	
1.125 T-NOTE 261031	5,100,000.00	4,688,712.89	
1.125 T-NOTE 270228	1,900,000.00	1,731,597.66	
1.125 T-NOTE 280229	6,400,000.00	5,675,000.00	
1.125 T-NOTE 280831	5,850,000.00	5,118,978.50	
1.125 T-NOTE 310215	10,300,000.00	8,444,591.78	
1.25 T-BOND 500515	5,750,000.00	2,915,541.98	
1.25 T-NOTE 261130	5,700,000.00	5,246,894.51	
1.25 T-NOTE 261231	6,150,000.00	5,652,474.59	
1.25 T-NOTE 280331	5,590,000.00	4,970,732.81	
1.25 T-NOTE 280430	6,000,000.00	5,323,710.96	
1.25 T-NOTE 280531	7,950,000.00	7,039,166.03	
1.25 T-NOTE 280630	6,900,000.00	6,098,009.75	
1.25 T-NOTE 280930	7,300,000.00	6,409,599.58	
1.25 T-NOTE 310815	11,260,000.00	9,167,443.40	
1.375 T-BOND 401115	5,200,000.00	3,327,796.88	
1.375 T-BOND 500815	6,440,000.00	3,372,698.45	
1.375 T-NOTE 260831	2,200,000.00	2,044,796.86	
1.375 T-NOTE 281031	4,840,000.00	4,266,195.30	
1.375 T-NOTE 281231	6,000,000.00	5,267,226.54	
1.375 T-NOTE 311115	10,390,000.00	8,482,663.85	
1.5 T-NOTE 260815	5,000,000.00	4,664,160.15	
1.5 T-NOTE 270131	7,200,000.00	6,645,937.53	
1.5 T-NOTE 281130	4,900,000.00	4,336,595.69	
1.5 T-NOTE 300215	5,880,000.00	5,055,077.33	
1.625 T-BOND 501115	5,850,000.00	3,278,285.12	

1. 625 T-NOTE 260215	4,920,000.00	4,656,607.01	
1. 625 T-NOTE 260515	5,600,000.00	5,269,250.00	
1. 625 T-NOTE 260930	1,950,000.00	1,821,345.70	
1. 625 T-NOTE 261031	1,600,000.00	1,490,875.00	
1. 625 T-NOTE 261130	2,200,000.00	2,046,300.78	
1. 625 T-NOTE 290815	4,900,000.00	4,304,726.53	
1. 625 T-NOTE 310515	10,280,000.00	8,660,096.92	
1. 75 T-BOND 410815	7,840,000.00	5,264,284.33	
1. 75 T-NOTE 250315	6,200,000.00	6,010,609.15	
1. 75 T-NOTE 261231	1,510,000.00	1,407,072.26	
1. 75 T-NOTE 290131	5,100,000.00	4,551,052.72	
1. 75 T-NOTE 291115	4,000,000.00	3,522,656.24	
1. 875 T-BOND 410215	6,650,000.00	4,616,294.93	
1. 875 T-BOND 510215	7,300,000.00	4,361,892.56	
1. 875 T-BOND 511115	6,540,000.00	3,886,573.80	
1. 875 T-NOTE 260630	2,700,000.00	2,550,287.10	
1. 875 T-NOTE 260731	2,700,000.00	2,543,853.51	
1. 875 T-NOTE 270228	5,300,000.00	4,937,177.74	
1. 875 T-NOTE 290228	5,500,000.00	4,930,234.37	
1. 875 T-NOTE 320215	11,060,000.00	9,337,923.48	
2 T-BOND 411115	5,970,000.00	4,168,505.87	
2 T-BOND 500215	5,300,000.00	3,296,351.53	
2 T-BOND 510815	9,000,000.00	5,530,781.24	
2 T-NOTE 250815	5,150,000.00	4,959,188.48	
2 T-NOTE 261115	5,000,000.00	4,700,000.00	
2. 125 T-NOTE 250515	5,100,000.00	4,945,306.64	
2. 125 T-NOTE 260531	1,400,000.00	1,330,710.93	
2. 25 T-BOND 410515	5,990,000.00	4,405,457.81	
2. 25 T-BOND 460815	4,330,000.00	2,947,275.37	
2. 25 T-BOND 490815	4,120,000.00	2,727,568.75	
2. 25 T-BOND 520215	6,290,000.00	4,102,505.06	
2. 25 T-NOTE 251115	6,400,000.00	6,153,374.97	
2. 25 T-NOTE 260331	3,250,000.00	3,106,479.48	
2. 25 T-NOTE 270215	4,200,000.00	3,958,171.89	
2. 25 T-NOTE 270815	4,800,000.00	4,488,187.48	
2. 25 T-NOTE 271115	4,200,000.00	3,912,070.30	

2. 375 T-BOND 420215	5,000,000.00	3,702,929.70	
2. 375 T-BOND 491115	5,070,000.00	3,446,510.75	
2. 375 T-BOND 510515	6,950,000.00	4,682,562.50	
2. 375 T-NOTE 260430	2,100,000.00	2,009,355.47	
2. 375 T-NOTE 270515	5,800,000.00	5,464,574.22	
2. 375 T-NOTE 290331	4,650,000.00	4,264,376.94	
2. 375 T-NOTE 290515	3,940,000.00	3,607,485.55	
2. 5 T-BOND 450215	3,380,000.00	2,460,996.48	
2. 5 T-BOND 460215	2,760,000.00	1,985,582.80	
2. 5 T-BOND 460515	2,570,000.00	1,844,025.19	
2. 5 T-NOTE 260228	3,000,000.00	2,884,687.50	
2. 5 T-NOTE 270331	4,500,000.00	4,266,035.14	
2. 625 T-NOTE 250331	3,900,000.00	3,809,695.46	
2. 625 T-NOTE 250415	3,100,000.00	3,025,601.58	
2. 625 T-NOTE 251231	2,700,000.00	2,607,820.32	
2. 625 T-NOTE 260131	1,600,000.00	1,543,812.49	
2. 625 T-NOTE 270531	4,900,000.00	4,650,119.15	
2. 625 T-NOTE 290215	5,030,000.00	4,677,408.77	
2. 625 T-NOTE 290731	2,800,000.00	2,588,742.18	
2. 75 T-BOND 420815	1,430,000.00	1,118,583.98	
2. 75 T-BOND 421115	2,200,000.00	1,716,085.93	
2. 75 T-BOND 470815	3,040,000.00	2,262,068.74	
2. 75 T-BOND 471115	3,400,000.00	2,525,562.50	
2. 75 T-NOTE 250515	4,000,000.00	3,905,078.12	
2. 75 T-NOTE 250831	3,000,000.00	2,916,152.34	
2. 75 T-NOTE 270430	3,200,000.00	3,051,812.51	
2. 75 T-NOTE 270731	4,510,000.00	4,288,023.43	
2. 75 T-NOTE 280215	6,650,000.00	6,285,418.93	
2. 75 T-NOTE 290531	5,000,000.00	4,660,351.55	
2. 75 T-NOTE 320815	9,910,000.00	8,886,482.81	
2. 875 T-BOND 430515	2,950,000.00	2,335,282.21	
2. 875 T-BOND 450815	2,000,000.00	1,550,234.38	
2. 875 T-BOND 461115	1,370,000.00	1,050,244.13	
2. 875 T-BOND 490515	4,600,000.00	3,476,144.51	
2. 875 T-BOND 520515	5,800,000.00	4,355,210.95	
2. 875 T-NOTE 250430	4,800,000.00	4,694,906.25	

2. 875 T-NOTE 250615	4, 100, 000. 00	4, 003, 185. 55	
2. 875 T-NOTE 250731	3, 500, 000. 00	3, 412, 636. 71	
2. 875 T-NOTE 251130	4, 500, 000. 00	4, 368, 427. 74	
2. 875 T-NOTE 280515	6, 600, 000. 00	6, 254, 015. 59	
2. 875 T-NOTE 280815	6, 160, 000. 00	5, 821, 681. 21	
2. 875 T-NOTE 290430	4, 500, 000. 00	4, 223, 847. 64	
2. 875 T-NOTE 320515	9, 900, 000. 00	8, 986, 957. 05	
3 T-BOND 420515	1, 310, 000. 00	1, 068, 647. 85	
3 T-BOND 441115	2, 100, 000. 00	1, 674, 708. 98	
3 T-BOND 450515	1, 800, 000. 00	1, 429, 101. 55	
3 T-BOND 451115	760, 000. 00	600, 875. 00	
3 T-BOND 470215	2, 880, 000. 00	2, 254, 218. 73	
3 T-BOND 470515	2, 050, 000. 00	1, 601, 682. 60	
3 T-BOND 480215	2, 980, 000. 00	2, 316, 950. 00	
3 T-BOND 480815	4, 480, 000. 00	3, 475, 762. 48	
3 T-BOND 490215	4, 700, 000. 00	3, 640, 939. 45	
3 T-BOND 520815	5, 750, 000. 00	4, 431, 767. 59	
3 T-NOTE 250715	4, 100, 000. 00	4, 006, 228. 53	
3 T-NOTE 250930	3, 500, 000. 00	3, 410, 791. 02	
3 T-NOTE 251031	3, 000, 000. 00	2, 919, 960. 93	
3. 125 T-BOND 411115	1, 550, 000. 00	1, 298, 791. 01	
3. 125 T-BOND 420215	1, 340, 000. 00	1, 118, 271. 87	
3. 125 T-BOND 430215	1, 850, 000. 00	1, 527, 297. 85	
3. 125 T-BOND 440815	3, 090, 000. 00	2, 521, 729. 68	
3. 125 T-BOND 480515	3, 810, 000. 00	3, 029, 098. 81	
3. 125 T-NOTE 250815	7, 300, 000. 00	7, 138, 173. 81	
3. 125 T-NOTE 270831	5, 000, 000. 00	4, 808, 984. 40	
3. 125 T-NOTE 281115	5, 270, 000. 00	5, 025, 336. 13	
3. 125 T-NOTE 290831	3, 250, 000. 00	3, 079, 057. 60	
3. 25 T-BOND 420515	4, 200, 000. 00	3, 556, 218. 75	
3. 25 T-NOTE 270630	4, 500, 000. 00	4, 352, 080. 09	
3. 25 T-NOTE 290630	4, 100, 000. 00	3, 913, 097. 64	
3. 375 T-BOND 420815	4, 810, 000. 00	4, 137, 633. 37	
3. 375 T-BOND 440515	1, 850, 000. 00	1, 572, 969. 73	
3. 375 T-BOND 481115	4, 150, 000. 00	3, 447, 174. 79	
3. 375 T-NOTE 330515	9, 730, 000. 00	9, 109, 902. 52	

3. 5 T-BOND 390215	700,000.00	640,841.79	
3. 5 T-NOTE 250915	3,450,000.00	3,388,142.56	
3. 5 T-NOTE 280131	5,400,000.00	5,248,968.75	
3. 5 T-NOTE 280430	5,100,000.00	4,953,076.19	
3. 5 T-NOTE 300131	3,500,000.00	3,369,570.33	
3. 5 T-NOTE 300430	2,500,000.00	2,403,271.47	
3. 5 T-NOTE 330215	9,650,000.00	9,135,081.98	
3. 625 T-BOND 430815	2,230,000.00	1,976,206.84	
3. 625 T-BOND 440215	2,400,000.00	2,121,843.74	
3. 625 T-BOND 530215	5,610,000.00	4,888,917.75	
3. 625 T-BOND 530515	5,350,000.00	4,666,307.61	
3. 625 T-NOTE 260515	4,300,000.00	4,220,046.87	
3. 625 T-NOTE 280331	3,380,000.00	3,299,196.87	
3. 625 T-NOTE 280531	2,300,000.00	2,244,027.33	
3. 625 T-NOTE 300331	3,590,000.00	3,476,059.57	
3. 75 T-BOND 410815	1,200,000.00	1,101,492.19	
3. 75 T-BOND 431115	2,210,000.00	1,991,978.32	
3. 75 T-NOTE 260415	3,900,000.00	3,837,615.24	
3. 75 T-NOTE 281231	4,910,000.00	4,810,265.62	
3. 75 T-NOTE 300531	2,900,000.00	2,825,177.73	
3. 75 T-NOTE 300630	4,950,000.00	4,820,739.26	
3. 75 T-NOTE 301231	3,920,000.00	3,812,200.00	
3. 875 T-BOND 400815	1,610,000.00	1,514,532.02	
3. 875 T-BOND 430215	3,330,000.00	3,067,372.25	
3. 875 T-BOND 430515	3,760,000.00	3,456,923.43	
3. 875 T-NOTE 250331	4,000,000.00	3,956,444.28	
3. 875 T-NOTE 250430	4,000,000.00	3,954,375.00	
3. 875 T-NOTE 260115	5,100,000.00	5,032,464.83	
3. 875 T-NOTE 271130	4,480,000.00	4,413,674.98	
3. 875 T-NOTE 271231	3,500,000.00	3,448,525.39	
3. 875 T-NOTE 290930	3,650,000.00	3,587,835.93	
3. 875 T-NOTE 291130	3,060,000.00	3,005,912.11	
3. 875 T-NOTE 291231	3,350,000.00	3,289,608.41	
3. 875 T-NOTE 330815	9,800,000.00	9,535,859.41	
4 T-BOND 421115	3,640,000.00	3,417,192.16	
4 T-BOND 521115	5,690,000.00	5,311,481.62	

4 T-NOTE 251215	1,800,000.00	1,779,820.30	
4 T-NOTE 260215	3,900,000.00	3,856,962.87	
4 T-NOTE 270115	5,380,000.00	5,323,467.97	
4 T-NOTE 280229	3,400,000.00	3,364,738.29	
4 T-NOTE 280630	4,000,000.00	3,959,765.64	
4 T-NOTE 290131	7,900,000.00	7,827,171.86	
4 T-NOTE 291031	2,840,000.00	2,808,105.46	
4 T-NOTE 300228	3,490,000.00	3,449,033.40	
4 T-NOTE 300731	3,500,000.00	3,456,113.29	
4 T-NOTE 310131	4,690,000.00	4,629,176.56	
4 T-NOTE 340215	5,990,000.00	5,887,514.79	
4.125 T-BOND 530815	6,200,000.00	5,916,156.25	
4.125 T-NOTE 260615	5,000,000.00	4,958,496.10	
4.125 T-NOTE 270215	7,080,000.00	7,030,495.28	
4.125 T-NOTE 270930	4,200,000.00	4,173,175.77	
4.125 T-NOTE 271031	2,950,000.00	2,930,986.33	
4.125 T-NOTE 280731	2,970,000.00	2,955,091.99	
4.125 T-NOTE 300831	2,060,000.00	2,048,050.39	
4.125 T-NOTE 321115	10,070,000.00	9,998,801.97	
4.25 T-BOND 390515	1,300,000.00	1,292,941.40	
4.25 T-BOND 401115	1,410,000.00	1,386,178.71	
4.25 T-BOND 540215	3,890,000.00	3,800,347.62	
4.25 T-NOTE 250531	4,100,000.00	4,069,169.92	
4.25 T-NOTE 251015	3,000,000.00	2,978,261.73	
4.25 T-NOTE 251231	5,470,000.00	5,431,111.69	
4.25 T-NOTE 260131	3,570,000.00	3,545,665.41	
4.375 T-BOND 380215	790,000.00	803,254.09	
4.375 T-BOND 391115	1,280,000.00	1,286,749.99	
4.375 T-BOND 400515	1,050,000.00	1,051,866.20	
4.375 T-BOND 410515	780,000.00	776,145.70	
4.375 T-BOND 430815	4,410,000.00	4,341,782.81	
4.375 T-NOTE 260815	7,060,000.00	7,042,487.87	
4.375 T-NOTE 261215	5,500,000.00	5,494,521.50	
4.375 T-NOTE 280831	3,740,000.00	3,759,503.50	
4.375 T-NOTE 281130	5,900,000.00	5,937,451.19	
4.375 T-NOTE 301130	4,200,000.00	4,236,175.77	

		4. 5 T-BOND 360215	900,000.00	935,296.82	
		4. 5 T-BOND 380515	700,000.00	719,660.15	
		4. 5 T-BOND 390815	1,400,000.00	1,429,367.18	
		4. 5 T-BOND 440215	1,550,000.00	1,554,480.45	
		4. 5 T-NOTE 251115	3,000,000.00	2,989,921.86	
		4. 5 T-NOTE 260715	3,600,000.00	3,599,929.69	
		4. 5 T-NOTE 331115	10,180,000.00	10,400,301.49	
		4. 625 T-BOND 400215	1,330,000.00	1,373,458.78	
		4. 625 T-NOTE 250228	2,300,000.00	2,291,298.52	
		4. 625 T-NOTE 250630	4,700,000.00	4,686,781.25	
		4. 625 T-NOTE 260315	5,300,000.00	5,303,105.48	
		4. 625 T-NOTE 260915	5,100,000.00	5,119,025.39	
		4. 625 T-NOTE 261015	5,240,000.00	5,262,515.65	
		4. 625 T-NOTE 261115	5,000,000.00	5,024,121.10	
		4. 625 T-NOTE 280930	4,200,000.00	4,265,214.82	
		4. 625 T-NOTE 300930	4,650,000.00	4,754,625.00	
		4. 75 T-BOND 410215	1,260,000.00	1,314,239.06	
		4. 75 T-BOND 431115	4,060,000.00	4,196,707.81	
		4. 75 T-BOND 531115	5,420,000.00	5,745,623.38	
		4. 75 T-NOTE 250731	4,500,000.00	4,496,308.60	
		4. 875 T-NOTE 251130	6,000,000.00	6,016,523.46	
		4. 875 T-NOTE 281031	5,500,000.00	5,644,375.00	
		4. 875 T-NOTE 301031	3,350,000.00	3,473,858.40	
		5 T-BOND 370515	580,000.00	628,446.57	
		5 T-NOTE 250831	1,800,000.00	1,805,132.80	
		5 T-NOTE 250930	4,030,000.00	4,044,089.24	
		5 T-NOTE 251031	5,000,000.00	5,020,214.85	
		5. 25 T-BOND 281115	1,000,000.00	1,042,099.20	
		5. 375 T-BOND 310215	520,000.00	558,339.63	
		6 T-BOND 260215	1,100,000.00	1,128,445.02	
		6. 125 T-BOND 271115	800,000.00	848,833.00	
		6. 25 T-BOND 300515	660,000.00	731,241.91	
			1,202,200,000.00	1,080,063,582.33	
		アメリカドル合計		(163,554,028,272)	
カナダドル	国債証券	0. 25 CAN GOVT 260301	1,200,000.00	1,117,108.04	
		0. 5 CAN GOVT 250901	2,500,000.00	2,371,762.07	

0.5 CAN GOVT 301201	2,700,000.00	2,234,849.50	
1 CAN GOVT 260901	1,300,000.00	1,214,799.71	
1 CAN GOVT 270601	600,000.00	553,863.84	
1.25 CAN GOVT 250301	850,000.00	825,065.15	
1.25 CAN GOVT 270301	1,500,000.00	1,398,268.84	
1.25 CAN GOVT 300601	3,270,000.00	2,878,839.42	
1.5 CAN GOVT 250401	1,000,000.00	970,263.92	
1.5 CAN GOVT 260601	1,150,000.00	1,092,043.57	
1.5 CAN GOVT 310601	3,700,000.00	3,250,006.74	
1.5 CAN GOVT 311201	3,070,000.00	2,671,042.71	
1.75 CAN GOVT 531201	2,970,000.00	2,072,912.48	
2 CAN GOVT 280601	1,000,000.00	943,177.02	
2 CAN GOVT 320601	2,250,000.00	2,020,540.90	
2 CAN GOVT 511201	4,160,000.00	3,126,749.26	
2.25 CAN GOVT 250601	1,600,000.00	1,561,039.02	
2.25 CAN GOVT 290601	700,000.00	662,817.54	
2.25 CAN GOVT 291201	400,000.00	377,345.60	
2.5 CAN GOVT 321201	2,000,000.00	1,859,739.74	
2.75 CAN GOVT 270901	2,300,000.00	2,236,920.91	
2.75 CAN GOVT 330601	1,700,000.00	1,608,256.52	
2.75 CAN GOVT 481201	970,000.00	865,738.58	
2.75 CAN GOVT 551201	1,470,000.00	1,296,460.88	
2.75 CANADA GOVER 641201	590,000.00	516,570.93	
3 CAN GOVT 251001	3,900,000.00	3,828,332.11	
3 CAN GOVT 260401	1,500,000.00	1,470,987.87	
3 CAN GOVT 340601	800,000.00	769,911.55	
3.25 CAN GOVT 280901	1,700,000.00	1,681,822.49	
3.25 CAN GOVT 331201	2,270,000.00	2,235,055.95	
3.5 CAN GOVT 280301	1,390,000.00	1,387,525.42	
3.5 CAN GOVT 451201	1,030,000.00	1,042,065.33	
4 CAN GOVT 290301	2,370,000.00	2,425,371.39	
4 CAN GOVT 410601	960,000.00	1,028,228.40	
4.5 CAN GOVT 251101	2,280,000.00	2,289,374.56	
4.5 CAN GOVT 260201	2,070,000.00	2,084,389.00	
5 CAN GOVT 370601	700,000.00	813,773.78	
5.75 CAN GOVT 290601	600,000.00	666,507.73	

		5. 75 CAN GOVT 330601	910,000.00	1,073,747.50	
カナダドル合計			67,430,000.00	62,523,275.97 (6,953,838,753)	
オーストラリアドル	国債証券	0. 25 AUST GOVT 251121	1,450,000.00	1,368,028.58	
		0. 5 AUST GOVT 260921	2,020,000.00	1,868,582.53	
		1 AUST GOVT 301221	2,340,000.00	1,947,272.55	
		1 AUST GOVT 311121	3,000,000.00	2,423,336.22	
		1. 25 AUST GOVT 320521	2,860,000.00	2,322,377.93	
		1. 5 AUST GOVT 310621	2,550,000.00	2,167,615.77	
		1. 75 AUST GOVT 321121	2,770,000.00	2,317,509.85	
		1. 75 AUST GOVT 510621	1,960,000.00	1,134,199.17	
		2. 25 AUST GOVT 280521	1,400,000.00	1,324,036.02	
		2. 5 AUST GOVT 300521	2,300,000.00	2,137,084.46	
		2. 75 AUST GOVT 271121	1,500,000.00	1,453,546.00	
		2. 75 AUST GOVT 281121	1,150,000.00	1,104,249.25	
		2. 75 AUST GOVT 291121	1,280,000.00	1,215,044.59	
		2. 75 AUST GOVT 350621	1,600,000.00	1,408,431.13	
		2. 75 AUST GOVT 410521	1,490,000.00	1,206,612.02	
		3 AUST GOVT 331121	2,450,000.00	2,249,101.78	
		3 AUST GOVT 470321	1,380,000.00	1,096,859.74	
		3. 25 AUST GOVT 250421	2,200,000.00	2,183,381.72	
		3. 25 AUST GOVT 290421	2,870,000.00	2,808,519.40	
		3. 25 AUST GOVT 390621	1,350,000.00	1,199,091.90	
3. 5 AUST GOVT 341221	1,190,000.00	1,131,915.11			
3. 75 AUST GOVT 340521	2,400,000.00	2,341,425.02			
3. 75 AUST GOVT 370421	1,480,000.00	1,418,867.79			
4. 25 AUST GOVT 260421	2,950,000.00	2,980,290.30			
4. 5 AUST GOVT 330421	2,240,000.00	2,323,270.65			
4. 75 AUST GOVT 270421	2,800,000.00	2,887,755.36			
4. 75 AUST GOVT 540621	790,000.00	834,842.28			
オーストラリアドル合計			53,770,000.00	48,853,247.12 (4,818,884,295)	
イギリスポンド	国債証券	0. 125 GILT 260130	1,900,000.00	1,766,411.00	
		0. 125 GILT 280131	1,210,000.00	1,050,316.30	
		0. 25 GILT 310731	2,610,000.00	2,022,723.90	
		0. 375 GILT 261022	3,270,000.00	2,980,063.48	

0.375 GILT 301022	1,670,000.00	1,344,044.72	
0.5 GILT 290131	2,650,000.00	2,263,630.00	
0.5 GILT 611022	2,420,000.00	749,319.12	
0.625 GILT 250607	2,050,000.00	1,959,833.21	
0.625 GILT 350731	2,230,000.00	1,547,397.00	
0.625 GILT 501022	1,730,000.00	716,912.00	
0.875 GILT 291022	1,630,000.00	1,395,508.20	
0.875 GILT 330731	2,700,000.00	2,066,229.00	
0.875 GILT 460131	1,490,000.00	758,410.00	
1 GILT 320131	3,330,000.00	2,696,467.50	
1.125 GILT 390131	2,460,000.00	1,620,036.93	
1.125 GILT 731022	1,080,000.00	410,038.84	
1.25 GILT 270722	1,700,000.00	1,560,889.00	
1.25 GILT 411022	2,380,000.00	1,487,024.00	
1.25 GILT 510731	2,620,000.00	1,315,764.00	
1.5 GILT 260722	1,470,000.00	1,388,613.74	
1.5 GILT 470722	1,860,000.00	1,075,080.00	
1.5 GILT 530731	2,840,000.00	1,490,148.00	
1.625 GILT 281022	1,500,000.00	1,366,524.00	
1.625 GILT 541022	1,340,000.00	721,091.52	
1.625 GILT 711022	1,630,000.00	778,162.00	
1.75 GILT 370907	2,100,000.00	1,585,290.00	
1.75 GILT 490122	1,120,000.00	673,232.00	
1.75 GILT 570722	1,970,000.00	1,077,787.00	
2 GILT 250907	1,200,000.00	1,159,848.00	
2.5 GILT 650722	1,430,000.00	935,123.70	
3.25 GILT 330131	3,090,000.00	2,946,797.04	
3.25 GILT 440122	2,200,000.00	1,864,060.00	
3.5 GILT 251022	1,660,000.00	1,636,726.80	
3.5 GILT 450122	1,980,000.00	1,732,893.62	
3.5 GILT 680722	1,530,000.00	1,291,014.00	
3.75 GILT 270307	940,000.00	931,226.90	
3.75 GILT 380129	2,080,000.00	1,984,736.00	
3.75 GILT 520722	1,250,000.00	1,115,500.00	
3.75 GILT 531022	2,590,000.00	2,299,374.02	
4 GILT 311022	730,000.00	737,982.91	

		4 GILT 600122	1,240,000.00	1,157,438.56	
		4 GILT 631022	1,290,000.00	1,201,258.32	
		4.125 GILT 270129	3,480,000.00	3,483,306.00	
		4.25 GILT 271207	1,860,000.00	1,882,989.60	
		4.25 GILT 320607	2,210,000.00	2,280,202.86	
		4.25 GILT 360307	2,070,000.00	2,111,607.00	
		4.25 GILT 390907	1,320,000.00	1,318,442.40	
		4.25 GILT 401207	1,790,000.00	1,777,649.00	
		4.25 GILT 461207	1,610,000.00	1,568,945.00	
		4.25 GILT 491207	1,290,000.00	1,253,880.00	
		4.25 GILT 551207	1,790,000.00	1,738,985.00	
		4.375 GILT 540731	590,000.00	582,920.00	
		4.5 GILT 280607	3,560,000.00	3,639,302.91	
		4.5 GILT 340907	1,390,000.00	1,453,378.44	
		4.5 GILT 421207	1,930,000.00	1,964,933.00	
		4.625 GILT 340131	2,070,000.00	2,186,644.50	
		4.75 GILT 301207	2,070,000.00	2,190,120.03	
		4.75 GILT 381207	1,430,000.00	1,514,799.00	
		4.75 GILT 431022	830,000.00	868,346.00	
		5 GILT 250307	1,830,000.00	1,835,624.32	
		6 GILT 281207	900,000.00	985,320.90	
		イギリスポンド合計	114,190,000.00	95,498,322.29 (18,212,485,043)	
シンガポ ールドル	国債証券	0.5 SINGAPORGOVT 251101	1,820,000.00	1,738,191.00	
		1.25 SINGAPORGOVT 261101	550,000.00	523,600.00	
		1.625 SINGAPORGOV 310701	500,000.00	453,150.00	
		1.875 SINGAPORGOV 500301	840,000.00	672,840.00	
		1.875 SINGAPORGOV 511001	460,000.00	365,755.20	
		2.125 SINGAPORGOV 260601	1,000,000.00	975,800.00	
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	750,000.00	688,875.00	
		2.375 SINGAPORGOV 250601	800,000.00	789,600.00	
		2.375 SINGAPORGOV 390701	250,000.00	229,590.00	
		2.625 SINGAPORGOV 280501	250,000.00	246,125.00	
		2.625 SINGAPORGOV 320801	900,000.00	870,300.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	700,000.00	672,703.50	
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	660,000.00	630,432.00	

		2. 875 SINGAPORGOV 270901	1, 100, 000. 00	1, 093, 180. 00	
		2. 875 SINGAPORGOV 290701	550, 000. 00	546, 150. 00	
		2. 875SINGAPORGOVT 300901	800, 000. 00	791, 280. 00	
		3 SINGAPORGOVT 720801	460, 000. 00	460, 230. 00	
		3. 375 SINGAPORGOV 330901	600, 000. 00	614, 637. 00	
		3. 5 SINGAPORGOVT 270301	570, 000. 00	576, 156. 00	
シンガポールドル合計			13, 560, 000. 00	12, 938, 594. 70 (1, 451, 710, 325)	
マレーシア リング ット	国債証券	2. 632 MALAYSIAGOV 310415	1, 500, 000. 00	1, 395, 944. 64	
		3. 502MALAYSIAGOVT 270531	1, 000, 000. 00	1, 000, 618. 70	
		3. 582 MALAYSIAGOV 320715	2, 300, 000. 00	2, 257, 658. 65	
		3. 733 MALAYSIAGO 280615	2, 300, 000. 00	2, 312, 754. 88	
		3. 757 MALAYSIAGOV 400522	2, 500, 000. 00	2, 426, 598. 07	
		3. 828 MALAYSIAGOV 340705	1, 000, 000. 00	997, 168. 23	
		3. 844 MALAYSIAGOV 330415	1, 950, 000. 00	1, 950, 348. 66	
		3. 882 MALAYSIAGOV 250314	3, 000, 000. 00	3, 015, 882. 00	
		3. 885 MALAYSIAGOV 290815	2, 500, 000. 00	2, 529, 655. 00	
		3. 899 MALAYSIAGOV 271116	4, 500, 000. 00	4, 565, 598. 30	
		3. 9 MALAYSIAGOVT 261130	1, 500, 000. 00	1, 519, 529. 55	
		3. 906 MALAYSIAGOV 260715	1, 500, 000. 00	1, 518, 208. 20	
		3. 955 MALAYSIAGOV 250915	3, 000, 000. 00	3, 027, 448. 20	
		4. 065 MALAYSIAGOV 500615	3, 100, 000. 00	3, 047, 059. 78	
		4. 254 MALAYSIAGOV 350531	1, 200, 000. 00	1, 237, 913. 88	
		4. 457 MALAYSIAGOV 530331	590, 000. 00	615, 290. 99	
		4. 498 MALAYSIAGOV 300415	1, 700, 000. 00	1, 769, 423. 92	
		4. 504 MALAYSIAGOV 290430	1, 600, 000. 00	1, 663, 664. 32	
		4. 642 MALAYSIAGOV 331107	2, 300, 000. 00	2, 444, 224. 03	
		4. 696 MALAYSIAGOV 421015	2, 000, 000. 00	2, 161, 918. 00	
4. 736 MALAYSIAGOV 460315	1, 200, 000. 00	1, 304, 633. 88			
4. 762 MALAYSIAGOV 370407	4, 100, 000. 00	4, 434, 815. 84			
4. 893 MALAYSIAGOV 380608	1, 700, 000. 00	1, 867, 077. 36			
4. 921 MALAYSIAGOV 480706	1, 640, 000. 00	1, 851, 007. 15			
4. 935 MALAYSIAGOV 430930	700, 000. 00	787, 459. 89			
マレーシアリングット合計			50, 380, 000. 00	51, 701, 902. 12 (1, 651, 601, 752)	
ニュージー	国債証券	0. 25 NZ GOVT 280515	1, 400, 000. 00	1, 185, 591. 61	

ーランド ドル		1. 5 NZ GOVT 310515	1,000,000.00	822,132.74	
		1. 75 NZ GOVT 410515	600,000.00	385,173.87	
		2 NZ GOVT 320515	1,200,000.00	998,013.66	
		2. 75 NZ GOVT 250415	900,000.00	877,283.49	
		2. 75 NZ GOVT 370415	1,100,000.00	888,965.24	
		2. 75 NZ GOVT 510515	700,000.00	480,083.75	
		3 NZ GOVT 290420	800,000.00	751,635.67	
		3. 5 NZ GOVT 330414	700,000.00	646,822.61	
		4. 5 NZ GOVT 270415	800,000.00	802,170.64	
		4. 5 NZ GOVT 300515	600,000.00	603,867.00	
		5 NZ GOVT 540515	320,000.00	326,336.73	
ニュージーランドドル合計			10,120,000.00	8,768,077.01	(795,702,988)
スウェー デンク ローネ	国債証券	0. 125 SWD GOVT 310512	8,560,000.00	7,353,399.52	
		0. 75 SWD GOVT 280512	4,000,000.00	3,746,073.60	
		0. 75 SWD GOVT 291112	12,700,000.00	11,692,660.13	
		1 SWD GOVT 261112	6,150,000.00	5,901,487.84	
		1. 75 SWD GOVT 331111	2,000,000.00	1,903,063.84	
		2. 25 SWD GOVT 320601	5,500,000.00	5,466,246.39	
		2. 5 SWD GOVT 250512	7,200,000.00	7,147,689.98	
		3. 5 SWD GOVT 390330	4,050,000.00	4,555,723.50	
スウェーデンクローネ合計			50,160,000.00	47,766,344.80	(684,491,720)
ノルウェ ーク ローネ	国債証券	1. 25 NORWE GOVT 310917	3,800,000.00	3,236,802.00	
		1. 375 NORWE GOVT 300819	5,400,000.00	4,751,671.68	
		1. 5 NORWE GOVT 260219	2,850,000.00	2,730,442.50	
		1. 75 NORWE GOVT 250313	6,300,000.00	6,154,407.00	
		1. 75 NORWE GOVT 270217	4,250,000.00	4,032,204.50	
		1. 75 NORWE GOVT 290906	3,500,000.00	3,200,466.50	
		2 NORWE GOVT 280426	2,650,000.00	2,495,032.24	
		2. 125 NORWE GOVT 320518	6,800,000.00	6,117,851.20	
		3 NORWE GOVT 330815	4,000,000.00	3,819,784.80	
		3. 5 NORWE GOVT 421006	2,130,000.00	2,191,770.00	
		3. 625 NORWE GOVT 340413	3,020,000.00	3,038,826.68	
ノルウェークローネ合計			44,700,000.00	41,769,259.10	(587,693,475)

デンマーク クローネ	国債証券	0 DMK GOVT 311115	8,400,000.00	7,081,597.23	
		0.25 DMK GOVT 521115	6,400,000.00	3,533,350.40	
		0.5 DMK GOVT 271115	6,900,000.00	6,454,216.53	
		0.5 DMK GOVT 291115	7,300,000.00	6,623,960.14	
		1.75 DMK GOVT 251115	5,500,000.00	5,407,105.00	
		2.25 DMK GOVT 331115	1,760,000.00	1,743,782.46	
		4.5 DMK GOVT 391115	10,260,000.00	12,879,861.23	
デンマーククローネ合計			46,520,000.00	43,723,872.99	(959,301,773)
メキシコ ペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 361120	8,000,000.00	8,451,240.00	
		5 MEXICAN BONOS 250306	23,000,000.00	21,900,485.00	
		5.5 MEXICAN BONOS 270304	30,380,000.00	27,317,240.30	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	61,350,000.00	56,923,209.15	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	39,750,000.00	37,665,112.50	
		7.5 MEXICAN BONOS 330526	17,000,000.00	15,222,225.00	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	52,000,000.00	48,204,780.00	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	10,800,000.00	9,741,870.00	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	32,670,000.00	27,963,069.75	
		8 MEXICAN BONOS 350524	4,000,000.00	3,646,720.00	
		8 MEXICAN BONOS 471107	26,780,000.00	23,221,607.50	
		8 MEXICAN BONOS 530731	21,880,000.00	18,819,644.40	
		8.5 MEXICAN BONOS 290301	6,710,000.00	6,526,313.75	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	34,900,000.00	33,961,539.00	
8.5 MEXICAN BONOS 381118	19,960,000.00	18,641,741.80			
メキシコペソ合計			389,180,000.00	358,206,798.15	(3,238,332,737)
イスラエ ルシェケ ル	国債証券	0.5 ISRAEL FIXED 250430	4,000,000.00	3,869,400.00	
		0.5 ISRAEL FIXED 260227	1,800,000.00	1,694,520.00	
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	3,800,000.00	3,180,030.00	
		1.3 ISRAEL FIXED 320430	1,500,000.00	1,219,800.00	
		1.5 ISRAEL FIXED 370531	1,800,000.00	1,288,350.00	
		1.75 ISRAEL FIXED 250831	1,800,000.00	1,763,010.00	
		2 ISRAEL FIXED BO 270331	2,500,000.00	2,360,375.00	
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	2,000,000.00	1,886,400.00	
		2.8 ISRAEL FIXED 521129	800,000.00	559,720.00	
		3.75 ISRAEL FIXED 290228	3,000,000.00	2,981,700.00	

		3.75 ISRAEL FIXED 470331	2,570,000.00	2,216,882.00	
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	2,410,000.00	2,689,680.50	
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	700,000.00	756,245.00	
イスラエルシェケル合計			28,680,000.00	26,466,112.50 (1,102,048,924)	
ポーランド ズロチ	国債証券	0.25 POLAND 261025	4,000,000.00	3,534,032.00	
		0.75 POLAND 250425	1,000,000.00	955,550.00	
		1.25 POLAND 301025	4,400,000.00	3,410,968.00	
		1.75 POLAND 320425	4,000,000.00	3,043,008.00	
		2.5 POLAND 260725	9,800,000.00	9,239,459.60	
		2.5 POLAND 270725	2,300,000.00	2,112,384.40	
		2.75 POLAND 280425	3,700,000.00	3,361,886.60	
		2.75 POLAND 291025	4,300,000.00	3,771,895.50	
		3.25 POLAND 250725	3,550,000.00	3,463,096.00	
		3.75 POLAND 270525	4,000,000.00	3,829,840.00	
		5.75 POLAND 290425	4,960,000.00	5,030,967.68	
		6 POLAND 331025	4,200,000.00	4,339,953.23	
		7.5 POLAND 280725	4,200,000.00	4,537,428.00	
ポーランドズロチ合計			54,410,000.00	50,630,469.01 (1,916,272,117)	
中国元	国債証券	1.99 CHINA GOVT 250409	20,000,000.00	20,025,640.00	
		2 CHINA GOVT 250615	20,000,000.00	20,014,502.00	
		2.18 CHINA GOVT 250825	16,000,000.00	16,049,424.00	
		2.18 CHINA GOVT 260815	37,000,000.00	37,088,097.00	
		2.22 CHINA GOVT 250925	28,000,000.00	28,101,864.00	
		2.24 CHINA GOVT 250525	27,000,000.00	27,101,952.00	
		2.28 CHINA GOVT 251125	26,000,000.00	26,117,858.00	
		2.3 CHINA GOVT 260515	22,000,000.00	22,104,720.00	
		2.33 CHINA GOVT 251215	6,000,000.00	6,034,698.00	
		2.35 CHINA GOVT 250315	23,000,000.00	23,123,211.00	
		2.37 CHINA GOVT 270120	21,000,000.00	21,131,386.50	
		2.37 CHINA GOVT 290115	13,000,000.00	13,105,443.00	
		2.39 CHINA GOVT 261115	20,000,000.00	20,167,640.00	
		2.4 CHINA GOVT 280715	25,000,000.00	25,181,875.00	
		2.44 CHINA GOVT 271015	13,000,000.00	13,104,013.00	
2.46 CHINA GOVT 260215	17,000,000.00	17,128,503.00			

2. 48 CHINA GOVT 270415	8,000,000.00	8,084,560.00	
2. 48 CHINA GOVT 280925	10,000,000.00	10,097,640.00	
2. 5 CHINA GOVT 270725	18,000,000.00	18,182,754.00	
2. 52 CHINA GOVT 330825	23,000,000.00	23,283,408.30	
2. 54 CHINA GOVT 301225	21,000,000.00	21,278,439.00	
2. 55 CHINA GOVT 281015	31,000,000.00	31,457,901.00	
2. 6 CHINA GOVT 300915	26,000,000.00	26,411,112.00	
2. 6 CHINA GOVT 320901	18,000,000.00	18,282,076.20	
2. 62 CHINA GOVT 280415	21,000,000.00	21,326,256.00	
2. 62 CHINA GOVT 290925	15,000,000.00	15,248,730.00	
2. 62 CHINA GOVT 300625	20,000,000.00	20,335,820.00	
2. 64 CHINA GOVT 280115	18,000,000.00	18,279,774.00	
2. 67 CHINA GOVT 330525	19,000,000.00	19,409,921.20	
2. 67 CHINA GOVT 331125	21,000,000.00	21,647,843.70	
2. 68 CHINA GOVT 300521	26,000,000.00	26,515,632.00	
2. 69 CHINA GOVT 260812	21,000,000.00	21,299,607.00	
2. 69 CHINA GOVT 320815	18,000,000.00	18,408,027.60	
2. 74 CHINA GOVT 260804	12,000,000.00	12,182,232.00	
2. 75 CHINA GOVT 290615	18,000,000.00	18,420,948.00	
2. 75 CHINA GOVT 320217	19,000,000.00	19,496,726.50	
2. 76 CHINA GOVT 320515	16,000,000.00	16,435,854.40	
2. 79 CHINA GOVT 291215	20,000,000.00	20,492,740.00	
2. 8 CHINA GOVT 290324	16,000,000.00	16,408,576.00	
2. 8 CHINA GOVT 300325	17,000,000.00	17,448,120.00	
2. 8 CHINA GOVT 321115	16,000,000.00	16,510,563.20	
2. 85 CHINA GOVT 270604	25,000,000.00	25,554,650.00	
2. 88 CHINA GOVT 330225	18,000,000.00	18,712,332.00	
2. 89 CHINA GOVT 311118	14,000,000.00	14,506,829.40	
2. 9 CHINA GOVT 260505	11,000,000.00	11,194,587.80	
2. 91 CHINA GOVT 281014	20,000,000.00	20,602,020.00	
2. 99 CHINA GOVT 251015	3,000,000.00	3,052,466.10	
3 CHINA GOVT 531015	6,000,000.00	6,677,490.00	
3. 01 CHINA GOVT 280513	21,000,000.00	21,674,394.00	
3. 02 CHINA GOVT 251022	22,000,000.00	22,373,296.00	
3. 02 CHINA GOVT 310527	23,000,000.00	24,035,802.70	
3. 03 CHINA GOVT 260311	19,000,000.00	19,408,804.00	

		3. 12 CHINA GOVT 261205	18,000,000.00	18,508,302.00	
		3. 12 CHINA GOVT 521025	9,000,000.00	9,935,449.20	
		3. 13 CHINA GOVT 291121	19,000,000.00	19,864,196.00	
		3. 19 CHINA GOVT 530415	10,000,000.00	11,382,883.00	
		3. 22 CHINA GOVT 251206	13,000,000.00	13,284,037.00	
		3. 25 CHINA GOVT 260606	21,000,000.00	21,589,680.00	
		3. 25 CHINA GOVT 281122	12,000,000.00	12,577,932.00	
		3. 27 CHINA GOVT 301119	25,000,000.00	26,513,175.00	
		3. 28 CHINA GOVT 271203	26,000,000.00	27,103,674.00	
		3. 29 CHINA GOVT 290523	23,000,000.00	24,224,796.00	
		3. 32 CHINA GOVT 520415	12,000,000.00	13,702,495.20	
		3. 39 CHINA GOVT 500316	21,000,000.00	24,019,159.50	
		3. 52 CHINA GOVT 270504	8,000,000.00	8,385,784.00	
		3. 53 CHINA GOVT 511018	11,000,000.00	12,987,459.10	
		3. 54 CHINA GOVT 280816	7,000,000.00	7,438,921.00	
		3. 59 CHINA GOVT 270803	7,000,000.00	7,377,965.00	
		3. 6 CHINA GOVT 250906	9,000,000.00	9,257,886.00	
		3. 61 CHINA GOVT 250607	7,000,000.00	7,169,295.00	
		3. 69 CHINA GOVT 280517	12,000,000.00	12,862,068.00	
		3. 72 CHINA GOVT 510412	12,000,000.00	14,553,436.80	
		3. 77 CHINA GOVT 250308	2,000,000.00	2,043,120.00	
		3. 81 CHINA GOVT 500914	22,000,000.00	26,986,141.60	
		3. 86 CHINA GOVT 490722	18,000,000.00	22,107,375.00	
		4. 08 CHINA GOVT 481022	15,000,000.00	18,944,814.00	
			1,323,000,000.00	1,373,138,805.00	
				(28,750,093,729)	
中国元合計					
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 250420	1,000,000.00	966,252.00	
		0 AUSTRIA GOVT 281020	1,230,000.00	1,091,452.80	
		0 AUSTRIA GOVT 300220	1,250,000.00	1,071,458.75	
		0 AUSTRIA GOVT 310220	1,300,000.00	1,081,480.40	
		0 AUSTRIA GOVT 401020	780,000.00	478,239.84	
		0 BEL GOVT 271022	800,000.00	728,825.12	
		0 BEL GOVT 311022	1,350,000.00	1,103,509.17	
		0 BUND 260815	3,700,000.00	3,478,059.20	
		0 BUND 271115	2,150,000.00	1,971,171.60	
		0 BUND 281115	2,880,000.00	2,590,695.36	

0 BUND 290815	2,700,000.00	2,392,232.40	
0 BUND 300215	2,620,000.00	2,297,019.50	
0 BUND 300815	3,850,000.00	3,340,625.75	
0 BUND 300815	1,200,000.00	1,042,495.29	
0 BUND 310215	2,460,000.00	2,111,049.00	
0 BUND 310815	3,420,000.00	2,902,875.48	
0 BUND 310815	850,000.00	721,679.50	
0 BUND 320215	2,850,000.00	2,389,995.75	
0 BUND 350515	2,760,000.00	2,125,683.00	
0 BUND 360515	2,560,000.00	1,916,800.00	
0 BUND 500815	3,750,000.00	1,978,762.50	
0 BUND 500815	850,000.00	450,080.10	
0 BUND 520815	2,900,000.00	1,460,677.80	
0 FINNISH GOVT 260915	420,000.00	392,296.80	
0 FINNISH GOVT 300915	400,000.00	337,789.00	
0 IRISH GOVT 311018	750,000.00	619,699.35	
0 ITALY GOVT 260401	3,200,000.00	3,002,320.00	
0 ITALY GOVT 260801	1,800,000.00	1,672,830.00	
0 NETH GOVT 260115	1,010,000.00	959,635.74	
0 NETH GOVT 270115	1,450,000.00	1,348,392.33	
0 NETH GOVT 290115	1,880,000.00	1,668,797.04	
0 NETH GOVT 300715	1,500,000.00	1,283,716.50	
0 NETH GOVT 310715	1,550,000.00	1,293,802.87	
0 NETH GOVT 380115	1,200,000.00	827,006.40	
0 NETH GOVT 520115	1,850,000.00	905,258.65	
0 O. A. T 260225	4,200,000.00	3,975,988.80	
0 O. A. T 270225	4,300,000.00	3,976,576.57	
0 O. A. T 291125	5,640,000.00	4,876,850.18	
0 O. A. T 301125	5,170,000.00	4,352,292.12	
0 O. A. T 311125	6,260,000.00	5,119,972.62	
0 O. A. T 320525	3,320,000.00	2,674,140.48	
0 OBL 250411	1,000,000.00	966,771.00	
0 OBL 251010	3,200,000.00	3,060,435.20	
0 OBL 251010	900,000.00	861,325.65	
0 OBL 260410	3,200,000.00	3,028,486.40	
0 OBL 261009	1,750,000.00	1,639,741.25	

0 OBL 270416	2,000,000.00	1,854,978.80	
0 SPAIN GOVT 250531	600,000.00	577,352.40	
0 SPAIN GOVT 260131	1,500,000.00	1,420,237.50	
0 SPAIN GOVT 270131	1,900,000.00	1,752,318.70	
0 SPAIN GOVT 280131	3,350,000.00	3,010,976.65	
0.1 BEL GOVT 300622	1,370,000.00	1,172,793.98	
0.1 SPAIN GOVT 310430	2,750,000.00	2,264,564.50	
0.125 FINNISH GOV 310915	500,000.00	414,200.00	
0.125 FINNISH GOV 360415	500,000.00	359,325.80	
0.125 FINNISH GOV 520415	580,000.00	274,881.48	
0.2 IRISH GOVT 270515	830,000.00	770,826.81	
0.2 IRISH GOVT 301018	700,000.00	603,707.57	
0.25 AUSTRIA GOVT 361020	950,000.00	684,906.42	
0.25 BUND 270215	3,800,000.00	3,562,823.00	
0.25 BUND 280815	3,020,000.00	2,761,554.44	
0.25 BUND 290215	2,800,000.00	2,538,440.80	
0.25 FINNISH GOVT 400915	390,000.00	251,741.33	
0.25 ITALY GOVT 280315	1,900,000.00	1,700,045.90	
0.25 NETH GOVT 250715	1,920,000.00	1,850,819.51	
0.25 NETH GOVT 290715	960,000.00	854,415.84	
0.25 O. A. T 261125	4,250,000.00	3,980,949.50	
0.35 BEL GOVT 320622	1,900,000.00	1,568,155.50	
0.35 IRISH GOVT 321018	700,000.00	580,848.80	
0.4 BEL GOVT 400622	810,000.00	529,608.78	
0.4 IRISH GOVT 350515	550,000.00	428,411.50	
0.45 ITALY GOVT 290215	1,500,000.00	1,319,280.00	
0.5 AUSTRIA GOVT 270420	1,440,000.00	1,347,194.88	
0.5 AUSTRIA GOVT 290220	1,700,000.00	1,535,389.00	
0.5 BUND 260215	3,450,000.00	3,305,879.70	
0.5 BUND 270815	3,260,000.00	3,057,430.12	
0.5 BUND 280215	2,500,000.00	2,328,295.82	
0.5 FINNISH GOVT 260415	1,050,000.00	1,001,333.55	
0.5 FINNISH GOVT 270915	550,000.00	510,612.98	
0.5 FINNISH GOVT 280915	660,000.00	601,226.17	
0.5 FINNISH GOVT 290915	480,000.00	428,667.84	
0.5 FINNISH GOVT 430415	610,000.00	389,741.44	

0. 5 ITALY GOVT 260201	2, 000, 000. 00	1, 903, 070. 00	
0. 5 ITALY GOVT 280715	1, 400, 000. 00	1, 255, 104. 20	
0. 5 NETH GOVT 260715	2, 390, 000. 00	2, 272, 440. 68	
0. 5 NETH GOVT 320715	1, 320, 000. 00	1, 120, 384. 05	
0. 5 NETH GOVT 400115	1, 610, 000. 00	1, 156, 265. 77	
0. 5 O. A. T 250525	5, 100, 000. 00	4, 939, 742. 70	
0. 5 O. A. T 260525	5, 100, 000. 00	4, 853, 951. 36	
0. 5 O. A. T 290525	5, 580, 000. 00	5, 019, 053. 76	
0. 5 O. A. T 400525	3, 210, 000. 00	2, 167, 960. 17	
0. 5 O. A. T 440625	2, 200, 000. 00	1, 341, 216. 09	
0. 5 O. A. T 720525	1, 270, 000. 00	507, 226. 75	
0. 5 SPAIN GOVT 300430	2, 050, 000. 00	1, 785, 848. 48	
0. 5 SPAIN GOVT 311031	2, 170, 000. 00	1, 815, 710. 61	
0. 55 IRISH GOVT 410422	430, 000. 00	294, 084. 52	
0. 6 ITALY GOVT 310801	2, 290, 000. 00	1, 885, 338. 68	
0. 6 SPAIN GOVT 291031	2, 350, 000. 00	2, 083, 923. 60	
0. 65 BEL GOVT 710622	720, 000. 00	312, 307. 20	
0. 7 AUSTRIA GOVT 710420	420, 000. 00	195, 027. 00	
0. 7 SPAIN GOVT 320430	2, 470, 000. 00	2, 071, 752. 02	
0. 75 AUSTRIA GOVT 261020	1, 500, 000. 00	1, 427, 175. 00	
0. 75 AUSTRIA GOVT 280220	1, 150, 000. 00	1, 070, 548. 80	
0. 75 AUSTRIA GOVT 510320	1, 240, 000. 00	732, 083. 60	
0. 75 FINNISH GOVT 310415	600, 000. 00	526, 868. 40	
0. 75 NETH GOVT 270715	1, 750, 000. 00	1, 650, 714. 45	
0. 75 NETH GOVT 280715	1, 700, 000. 00	1, 579, 143. 94	
0. 75 O. A. T 280225	4, 760, 000. 00	4, 428, 680. 20	
0. 75 O. A. T 280525	6, 070, 000. 00	5, 626, 337. 63	
0. 75 O. A. T 281125	6, 200, 000. 00	5, 699, 728. 20	
0. 75 O. A. T 520525	3, 370, 000. 00	1, 856, 533. 00	
0. 75 O. A. T 530525	2, 990, 000. 00	1, 611, 179. 44	
0. 8 BEL GOVT 250622	1, 130, 000. 00	1, 096, 678. 56	
0. 8 BEL GOVT 270622	2, 640, 000. 00	2, 488, 295. 04	
0. 8 BEL GOVT 280622	1, 500, 000. 00	1, 393, 072. 50	
0. 8 SPAIN GOVT 270730	2, 600, 000. 00	2, 433, 033. 20	
0. 8 SPAIN GOVT 290730	2, 700, 000. 00	2, 433, 429. 00	
0. 85 AUSTRIA GOVT 200630	450, 000. 00	210, 221. 10	

0. 85 ITALY GOVT 270115	2, 830, 000. 00	2, 660, 483. 00	
0. 85 SPAIN GOVT 370730	1, 320, 000. 00	965, 712. 00	
0. 875 FINNISH GOV 250915	500, 000. 00	484, 800. 00	
0. 9 AUSTRIA GOVT 320220	1, 300, 000. 00	1, 131, 741. 00	
0. 9 BEL GOVT 290622	1, 800, 000. 00	1, 651, 620. 60	
0. 9 IRISH GOVT 280515	950, 000. 00	890, 644. 00	
0. 9 ITALY GOVT 310401	2, 570, 000. 00	2, 184, 726. 16	
0. 95 ITALY GOVT 270915	2, 250, 000. 00	2, 094, 493. 50	
0. 95 ITALY GOVT 300801	1, 980, 000. 00	1, 718, 758. 80	
0. 95 ITALY GOVT 311201	2, 100, 000. 00	1, 759, 396. 80	
0. 95 ITALY GOVT 320601	1, 870, 000. 00	1, 545, 411. 01	
0. 95 ITALY GOVT 370301	1, 550, 000. 00	1, 105, 770. 00	
1 BEL GOVT 260622	1, 900, 000. 00	1, 826, 223. 00	
1 BEL GOVT 310622	1, 900, 000. 00	1, 692, 411. 70	
1 BUND 250815	500, 000. 00	486, 108. 50	
1 BUND 380515	2, 200, 000. 00	1, 816, 302. 40	
1 IRISH GOVT 260515	700, 000. 00	674, 617. 02	
1 O. A. T 251125	4, 200, 000. 00	4, 064, 292. 91	
1 O. A. T 270525	4, 480, 000. 00	4, 252, 640. 00	
1 SPAIN GOVT 420730	1, 310, 000. 00	867, 534. 40	
1 SPAIN GOVT 501031	2, 630, 000. 00	1, 457, 546. 00	
1. 1 IRISH GOVT 290515	820, 000. 00	764, 390. 88	
1. 1 ITALY GOVT 270401	2, 300, 000. 00	2, 168, 877. 00	
1. 125 FINNISH GOV 340415	440, 000. 00	375, 865. 60	
1. 2 AUSTRIA GOVT 251020	400, 000. 00	388, 988. 80	
1. 2 ITALY GOVT 250815	900, 000. 00	874, 074. 37	
1. 2 SPAIN GOVT 401031	1, 850, 000. 00	1, 315, 257. 50	
1. 25 BEL GOVT 330422	970, 000. 00	855, 200. 50	
1. 25 BUND 480815	4, 580, 000. 00	3, 551, 936. 56	
1. 25 ITALY GOVT 261201	2, 200, 000. 00	2, 097, 026. 80	
1. 25 O. A. T 340525	4, 710, 000. 00	4, 065, 700. 26	
1. 25 O. A. T 360525	4, 780, 000. 00	3, 971, 463. 00	
1. 25 O. A. T 380525	1, 810, 000. 00	1, 443, 078. 61	
1. 25 SPAIN GOVT 301031	2, 630, 000. 00	2, 376, 938. 77	
1. 3 IRISH GOVT 330515	630, 000. 00	562, 596. 30	
1. 3 OBL 271015	2, 970, 000. 00	2, 858, 405. 22	

1. 3 OBL 271015	500,000.00	481,817.50	
1. 3 SPAIN GOVT 261031	3,830,000.00	3,679,691.65	
1. 35 IRISH GOVT 310318	460,000.00	425,914.00	
1. 35 ITALY GOVT 300401	2,200,000.00	1,975,820.00	
1. 375 FINNISH GOV 270415	600,000.00	576,525.00	
1. 375 FINNISH GOV 470415	450,000.00	330,775.92	
1. 4 BEL GOVT 530622	930,000.00	603,123.60	
1. 4 SPAIN GOVT 280430	2,750,000.00	2,602,577.45	
1. 4 SPAIN GOVT 280730	2,250,000.00	2,124,479.25	
1. 45 BEL GOVT 370622	610,000.00	506,763.60	
1. 45 ITALY GOVT 250515	1,300,000.00	1,272,278.57	
1. 45 ITALY GOVT 360301	1,350,000.00	1,054,672.65	
1. 45 SPAIN GOVT 271031	2,050,000.00	1,955,495.00	
1. 45 SPAIN GOVT 290430	2,020,000.00	1,893,125.82	
1. 45 SPAIN GOVT 711031	900,000.00	452,421.90	
1. 5 AUSTRIA GOVT 470220	1,060,000.00	796,227.48	
1. 5 AUSTRIA GOVT 861102	310,000.00	190,345.27	
1. 5 FINNISH GOVT 320915	700,000.00	635,370.61	
1. 5 IRISH GOVT 500515	990,000.00	726,554.56	
1. 5 ITALY GOVT 250601	4,240,000.00	4,148,352.40	
1. 5 ITALY GOVT 450430	1,150,000.00	747,136.60	
1. 5 O. A. T 310525	5,870,000.00	5,441,501.74	
1. 5 O. A. T 500525	3,360,000.00	2,356,559.52	
1. 5 SPAIN GOVT 270430	2,550,000.00	2,449,300.50	
1. 6 BEL GOVT 470622	1,260,000.00	922,947.48	
1. 6 ITALY GOVT 260601	2,550,000.00	2,467,178.55	
1. 65 ITALY GOVT 301201	2,130,000.00	1,920,186.48	
1. 65 ITALY GOVT 320301	2,600,000.00	2,289,121.64	
1. 7 BEL GOVT 500622	1,110,000.00	803,640.00	
1. 7 BUND 320815	2,700,000.00	2,584,045.80	
1. 7 IRISH GOVT 370515	700,000.00	614,326.58	
1. 7 ITALY GOVT 510901	1,900,000.00	1,185,641.80	
1. 75 O. A. T 390625	3,250,000.00	2,755,018.50	
1. 75 O. A. T 660525	1,660,000.00	1,142,544.80	
1. 8 BUND 530815	2,560,000.00	2,196,554.24	
1. 8 BUND 530815	550,000.00	472,615.00	

1. 8 ITALY GOVT 410301	1, 830, 000. 00	1, 344, 965. 82	
1. 85 AUSTRIA GOVT 490523	550, 000. 00	435, 682. 50	
1. 85 ITALY GOVT 250701	1, 600, 000. 00	1, 570, 499. 13	
1. 85 SPAIN GOVT 350730	2, 140, 000. 00	1, 864, 368. 00	
1. 9 BEL GOVT 380622	870, 000. 00	753, 396. 51	
1. 9 SPAIN GOVT 521031	1, 910, 000. 00	1, 305, 740. 94	
1. 95 SPAIN GOVT 260430	2, 500, 000. 00	2, 448, 125. 00	
1. 95 SPAIN GOVT 300730	2, 500, 000. 00	2, 371, 662. 50	
2 AUSTRIA GOVT 260715	500, 000. 00	491, 201. 50	
2 IRISH GOVT 450218	1, 010, 000. 00	861, 287. 60	
2 ITALY GOVT 251201	1, 400, 000. 00	1, 371, 809. 60	
2 ITALY GOVT 280201	1, 750, 000. 00	1, 682, 350. 25	
2 NETH GOVT 540115	850, 000. 00	731, 569. 50	
2 O. A. T 321125	4, 650, 000. 00	4, 393, 784. 07	
2 O. A. T 480525	3, 060, 000. 00	2, 449, 474. 92	
2. 05 ITALY GOVT 270801	1, 820, 000. 00	1, 760, 886. 40	
2. 1 AUSTRIA GOVT 170920	500, 000. 00	384, 251. 00	
2. 1 BUND 291115	2, 950, 000. 00	2, 918, 203. 72	
2. 1 ITALY GOVT 260715	1, 400, 000. 00	1, 367, 842. 00	
2. 1 OBL 290412	550, 000. 00	543, 966. 50	
2. 15 BEL GOVT 660622	830, 000. 00	637, 772. 00	
2. 15 ITALY GOVT 520901	850, 000. 00	580, 057. 00	
2. 15 ITALY GOVT 720301	620, 000. 00	389, 471. 60	
2. 15 SPAIN GOVT 251031	2, 700, 000. 00	2, 661, 714. 00	
2. 2 BUND 340215	1, 470, 000. 00	1, 453, 985. 52	
2. 2 ITALY GOVT 270601	2, 150, 000. 00	2, 093, 022. 85	
2. 2 OBL 280413	2, 610, 000. 00	2, 591, 568. 95	
2. 25 BEL GOVT 570622	740, 000. 00	584, 352. 10	
2. 25 ITALY GOVT 360901	1, 620, 000. 00	1, 378, 668. 60	
2. 3 BUND 330215	3, 850, 000. 00	3, 854, 388. 23	
2. 3 BUND 330215	700, 000. 00	701, 245. 30	
2. 35 SPAIN GOVT 330730	2, 410, 000. 00	2, 271, 364. 75	
2. 4 AUSTRIA GOVT 340523	950, 000. 00	915, 657. 50	
2. 4 BUND 301115	1, 170, 000. 00	1, 177, 803. 43	
2. 4 IRISH GOVT 300515	1, 130, 000. 00	1, 121, 508. 05	
2. 4 OBL 281019	2, 710, 000. 00	2, 714, 130. 04	

2.45 ITALY GOVT 330901	1,900,000.00	1,738,990.20	
2.45 ITALY GOVT 500901	2,100,000.00	1,561,595.70	
2.5 BUND 440704	2,980,000.00	2,970,243.48	
2.5 BUND 460815	3,080,000.00	3,075,115.12	
2.5 BUND 540815	670,000.00	670,751.74	
2.5 ITALY GOVT 251115	2,500,000.00	2,471,380.00	
2.5 ITALY GOVT 321201	2,050,000.00	1,904,933.80	
2.5 NETH GOVT 300115	1,050,000.00	1,048,733.17	
2.5 NETH GOVT 330115	1,750,000.00	1,743,502.25	
2.5 NETH GOVT 330715	750,000.00	744,941.25	
2.5 NETH GOVT 340715	690,000.00	682,209.06	
2.5 O. A. T 260924	4,900,000.00	4,865,739.20	
2.5 O. A. T 270924	1,220,000.00	1,212,503.10	
2.5 O. A. T 300525	6,020,000.00	5,982,980.79	
2.5 O. A. T 430525	1,250,000.00	1,131,768.75	
2.5 SCHATS 250313	1,700,000.00	1,686,616.41	
2.5 SCHATS 260319	1,000,000.00	993,835.00	
2.5 SPAIN GOVT 270531	660,000.00	652,760.46	
2.55 SPAIN GOVT 321031	2,500,000.00	2,413,670.00	
2.6 BUND 330815	2,850,000.00	2,919,904.80	
2.6 IRISH GOVT 341018	340,000.00	335,749.94	
2.625 FINNISH GOV 420704	480,000.00	454,100.25	
2.65 ITALY GOVT 271201	2,090,000.00	2,059,590.50	
2.7 ITALY GOVT 470301	1,950,000.00	1,567,456.80	
2.7 SPAIN GOVT 481031	1,800,000.00	1,526,637.60	
2.75 BEL GOVT 390422	500,000.00	479,933.50	
2.75 FINNISH GOVT 280704	590,000.00	592,504.55	
2.75 FINNISH GOVT 380415	430,000.00	417,837.10	
2.75 NETH GOVT 470115	1,960,000.00	1,978,956.33	
2.75 O. A. T 271025	5,380,000.00	5,394,326.94	
2.75 O. A. T 290225	4,540,000.00	4,565,508.44	
2.8 ITALY GOVT 281201	2,940,000.00	2,902,047.54	
2.8 ITALY GOVT 290615	1,230,000.00	1,208,290.50	
2.8 ITALY GOVT 670301	950,000.00	720,249.15	
2.8 SCHATS 250612	2,630,000.00	2,617,379.94	
2.8 SPAIN GOVT 260531	3,000,000.00	2,988,465.00	

2. 85 BEL GOVT 341022	500,000.00	498,675.85	
2. 875 FINNISH GOV 290415	800,000.00	808,721.60	
2. 9 AUSTRIA GOVT 290523	500,000.00	506,940.00	
2. 9 AUSTRIA GOVT 330220	1,630,000.00	1,644,353.78	
2. 9 AUSTRIA GOVT 340220	300,000.00	302,015.28	
2. 9 SPAIN GOVT 461031	1,830,000.00	1,629,410.04	
2. 95 FINNISH GOVT 550415	300,000.00	296,980.89	
2. 95 ITALY GOVT 380901	1,490,000.00	1,338,237.54	
3 BEL GOVT 330622	1,680,000.00	1,707,231.12	
3 BEL GOVT 340622	1,040,000.00	1,054,260.48	
3 FINNISH GOVT 330915	520,000.00	529,045.40	
3 IRISH GOVT 431018	260,000.00	263,320.98	
3 ITALY GOVT 290801	2,250,000.00	2,232,447.75	
3 O. A. T 330525	3,650,000.00	3,720,919.50	
3 O. A. T 490625	870,000.00	842,580.21	
3 O. A. T 540525	2,730,000.00	2,591,530.02	
3. 1 ITALY GOVT 400301	1,530,000.00	1,377,091.80	
3. 1 SCHATS 250918	1,750,000.00	1,751,159.02	
3. 1 SCHATS 251212	1,720,000.00	1,724,425.56	
3. 15 AUSTRIA GOVT 440620	880,000.00	895,689.52	
3. 15 AUSTRIA GOVT 531020	230,000.00	233,811.10	
3. 15 SPAIN GOVT 330430	2,420,000.00	2,436,997.58	
3. 25 BUND 420704	2,060,000.00	2,278,592.78	
3. 25 ITALY GOVT 380301	1,250,000.00	1,165,621.25	
3. 25 ITALY GOVT 460901	1,670,000.00	1,478,187.14	
3. 25 NETH GOVT 440115	490,000.00	528,422.37	
3. 25 O. A. T 450525	3,010,000.00	3,046,962.80	
3. 25 SPAIN GOVT 340430	1,910,000.00	1,925,438.90	
3. 3 BEL GOVT 540622	1,160,000.00	1,151,093.52	
3. 35 ITALY GOVT 350301	1,720,000.00	1,669,956.60	
3. 4 ITALY GOVT 250328	1,200,000.00	1,198,827.73	
3. 4 ITALY GOVT 280401	2,320,000.00	2,346,030.16	
3. 45 AUSTRIA GOVT 301020	680,000.00	710,514.32	
3. 45 BEL GOVT 430622	510,000.00	526,422.00	
3. 45 ITALY GOVT 480301	1,930,000.00	1,755,562.74	
3. 45 SPAIN GOVT 430730	1,150,000.00	1,123,529.30	

3. 45 SPAIN GOVT 660730	1, 470, 000. 00	1, 367, 047. 08	
3. 5 BEL GOVT 550622	400, 000. 00	410, 134. 40	
3. 5 ITALY GOVT 260115	1, 400, 000. 00	1, 405, 782. 00	
3. 5 ITALY GOVT 300301	2, 930, 000. 00	2, 976, 332. 09	
3. 5 ITALY GOVT 310215	1, 400, 000. 00	1, 413, 860. 00	
3. 5 O. A. T 260425	4, 550, 000. 00	4, 608, 895. 20	
3. 5 O. A. T 331125	2, 930, 000. 00	3, 102, 826. 05	
3. 5 SPAIN GOVT 290531	1, 950, 000. 00	2, 013, 747. 45	
3. 55 SPAIN GOVT 331031	2, 470, 000. 00	2, 559, 045. 97	
3. 7 ITALY GOVT 300615	1, 850, 000. 00	1, 893, 382. 50	
3. 75 BEL GOVT 450622	940, 000. 00	1, 012, 766. 34	
3. 75 NETH GOVT 420115	1, 820, 000. 00	2, 079, 189. 84	
3. 8 AUSTRIA GOVT 620126	470, 000. 00	547, 586. 19	
3. 8 ITALY GOVT 260415	950, 000. 00	961, 238. 50	
3. 8 ITALY GOVT 280801	1, 820, 000. 00	1, 869, 496. 72	
3. 85 ITALY GOVT 260915	1, 880, 000. 00	1, 910, 982. 40	
3. 85 ITALY GOVT 291215	1, 670, 000. 00	1, 724, 545. 54	
3. 85 ITALY GOVT 490901	1, 220, 000. 00	1, 175, 767. 68	
3. 9 SPAIN GOVT 390730	1, 270, 000. 00	1, 330, 505. 34	
4 BEL GOVT 320328	880, 000. 00	960, 405. 60	
4 BUND 370104	2, 710, 000. 00	3, 170, 496. 75	
4 FINNISH GOVT 250704	450, 000. 00	454, 833. 45	
4 ITALY GOVT 301115	1, 200, 000. 00	1, 248, 475. 20	
4 ITALY GOVT 311030	800, 000. 00	834, 560. 00	
4 ITALY GOVT 350430	1, 050, 000. 00	1, 082, 056. 50	
4 ITALY GOVT 370201	3, 260, 000. 00	3, 338, 784. 42	
4 NETH GOVT 370115	1, 730, 000. 00	1, 972, 157. 78	
4 O. A. T 381025	2, 640, 000. 00	2, 949, 085. 92	
4 O. A. T 550425	1, 960, 000. 00	2, 238, 559. 12	
4 O. A. T 600425	1, 910, 000. 00	2, 213, 663. 26	
4 SPAIN GOVT 541031	500, 000. 00	517, 871. 50	
4. 1 ITALY GOVT 290201	1, 300, 000. 00	1, 355, 031. 86	
4. 15 AUSTRIA GOVT 370315	1, 350, 000. 00	1, 526, 077. 80	
4. 15 ITALY GOVT 391001	1, 070, 000. 00	1, 089, 959. 78	
4. 2 ITALY GOVT 340301	2, 530, 000. 00	2, 655, 680. 28	
4. 2 SPAIN GOVT 370131	2, 190, 000. 00	2, 392, 137. 00	

4. 25 BEL GOVT 410328	1, 720, 000. 00	1, 966, 245. 52	
4. 25 BUND 390704	1, 780, 000. 00	2, 173, 801. 86	
4. 35 ITALY GOVT 331101	2, 000, 000. 00	2, 126, 274. 00	
4. 4 ITALY GOVT 330501	2, 150, 000. 00	2, 298, 122. 10	
4. 45 ITALY GOVT 430901	1, 130, 000. 00	1, 187, 601. 75	
4. 5 BEL GOVT 260328	1, 200, 000. 00	1, 237, 772. 64	
4. 5 ITALY GOVT 260301	2, 800, 000. 00	2, 866, 710. 00	
4. 5 ITALY GOVT 531001	1, 260, 000. 00	1, 330, 919. 10	
4. 5 O. A. T 410425	3, 750, 000. 00	4, 451, 445. 00	
4. 65 SPAIN GOVT 250730	3, 000, 000. 00	3, 056, 585. 70	
4. 7 SPAIN GOVT 410730	2, 180, 000. 00	2, 510, 379. 00	
4. 75 BUND 280704	1, 300, 000. 00	1, 423, 994. 00	
4. 75 BUND 340704	2, 220, 000. 00	2, 702, 428. 20	
4. 75 BUND 400704	2, 110, 000. 00	2, 739, 507. 95	
4. 75 ITALY GOVT 280901	2, 530, 000. 00	2, 699, 522. 65	
4. 75 ITALY GOVT 440901	2, 000, 000. 00	2, 189, 328. 00	
4. 75 O. A. T 350425	2, 710, 000. 00	3, 192, 716. 04	
4. 85 AUSTRIA GOVT 260315	1, 600, 000. 00	1, 660, 329. 60	
4. 9 SPAIN GOVT 400730	1, 970, 000. 00	2, 306, 397. 20	
5 BEL GOVT 350328	2, 220, 000. 00	2, 656, 132. 32	
5 ITALY GOVT 250301	2, 150, 000. 00	2, 178, 555. 01	
5 ITALY GOVT 340801	2, 600, 000. 00	2, 905, 806. 80	
5 ITALY GOVT 390801	2, 500, 000. 00	2, 796, 560. 00	
5 ITALY GOVT 400901	2, 170, 000. 00	2, 430, 404. 34	
5. 15 SPAIN GOVT 281031	2, 000, 000. 00	2, 201, 882. 00	
5. 15 SPAIN GOVT 441031	1, 560, 000. 00	1, 910, 132. 64	
5. 25 ITALY GOVT 291101	2, 980, 000. 00	3, 296, 765. 06	
5. 4 IRISH GOVT 250313	1, 200, 000. 00	1, 223, 284. 80	
5. 5 BEL GOVT 280328	2, 310, 000. 00	2, 560, 868. 31	
5. 5 BUND 310104	2, 290, 000. 00	2, 744, 654. 31	
5. 5 NETH GOVT 280115	810, 000. 00	894, 873. 42	
5. 5 O. A. T 290425	3, 940, 000. 00	4, 467, 071. 53	
5. 625 BUND 280104	1, 850, 000. 00	2, 060, 910. 36	
5. 75 ITALY GOVT 330201	3, 240, 000. 00	3, 785, 897. 88	
5. 75 O. A. T 321025	3, 420, 000. 00	4, 195, 163. 52	
5. 75 SPAIN GOVT 320730	2, 030, 000. 00	2, 444, 875. 16	

	5.9 SPAIN GOVT 260730	2,450,000.00	2,610,058.50	
	6 ITALY GOVT 310501	3,060,000.00	3,583,899.54	
	6 O. A. T 251025	2,600,000.00	2,716,334.40	
	6 SPAIN GOVT 290131	2,600,000.00	2,977,663.00	
	6.25 AUSTRIA GOVT 270715	900,000.00	999,516.60	
	6.25 BUND 300104	1,300,000.00	1,572,993.50	
	6.5 BUND 270704	1,850,000.00	2,077,846.00	
	6.5 ITALY GOVT 271101	1,930,000.00	2,154,244.77	
	7.25 ITALY GOVT 261101	1,320,000.00	1,455,009.60	
ユーロ合計		728,380,000.00	682,289,439.96 (111,622,552,377)	
合計			346,299,038,280 (346,299,038,280)	

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 273 銘柄	100.00%	47.23%
カナダドル	国債証券 39 銘柄	100.00%	2.01%
オーストラリアドル	国債証券 27 銘柄	100.00%	1.39%
イギリスポンド	国債証券 61 銘柄	100.00%	5.26%
シンガポールドル	国債証券 19 銘柄	100.00%	0.42%
マレーシアリングgit	国債証券 25 銘柄	100.00%	0.48%
ニュージーランドドル	国債証券 12 銘柄	100.00%	0.23%
スウェーデンクローネ	国債証券 8 銘柄	100.00%	0.20%
ノルウェークローネ	国債証券 11 銘柄	100.00%	0.17%
デンマーククローネ	国債証券 7 銘柄	100.00%	0.28%
メキシコペソ	国債証券 15 銘柄	100.00%	0.94%
イスラエルシェケル	国債証券 13 銘柄	100.00%	0.32%
ポーランドズロチ	国債証券 13 銘柄	100.00%	0.55%
中国元	国債証券 76 銘柄	100.00%	8.30%
ユーロ	国債証券 379 銘柄	100.00%	32.23%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年3月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	60,616,560
コール・ローン	36,869,308
国債証券	9,650,437,677
派生商品評価勘定	46,232
未収入金	208,454
未収利息	111,861,436
前払費用	12,596,555
流動資産合計	9,872,636,222
資産合計	9,872,636,222
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	109,644,943
未払金	503,280
未払解約金	40
流動負債合計	110,148,263
負債合計	110,148,263
純資産の部	
元本等	
元本	10,662,765,639
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	△900,277,680
元本等合計	9,762,487,959
純資産合計	9,762,487,959
負債純資産合計	9,872,636,222

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年 3月 25日現在]
1. 期首	2023年 3月 28日
期首元本額	10,761,426,460円
期中追加設定元本額	5,352,082,378円
期中一部解約元本額	5,450,743,199円
元本の内訳※	
e MAXIS 新興国債券インデックス (為替ヘッジあり)	1,780,319,263円
ラップ向けインデックス f 米ドル建て新興国債券 (為替ヘッジあり)	853,236円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	337,984,552円
MUKAM バランスファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	282,190,217円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	378,279,281円
MUKAM バランスファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	278,037,305円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	372,750,265円
MUKAM バランスファンド2020-10 (適格機関投資家限定)	278,843,170円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	372,500,390円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	370,234,599円
MUKAM バランスファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	246,760,844円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	382,245,543円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	383,605,620円
MUKAM バランスファンド2021-06 (適格機関投資家限定)	242,754,177円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)	376,301,180円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	366,441,416円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	381,631,658円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	398,551,706円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	395,577,061円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	418,262,983円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	438,387,288円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	436,051,392円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	438,799,977円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	426,594,147円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)	438,700,639円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定)	440,107,730円
合計	10,662,765,639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。	900,277,680 円
3. 受益権の総数	10,662,765,639 円

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023 年 3 月 28 日 至 2024 年 3 月 25 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和 26 年法律第 198 号)第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024 年 3 月 25 日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024 年 3 月 25 日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	
国債証券		486,658,985
合計		486,658,985

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[2024年3月25日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカドル	9,695,665,034	—	9,805,263,745	△109,598,711
合計		9,695,665,034	—	9,805,263,745	△109,598,711

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[2024年3月25日現在]
1口当たり純資産額	0.9156円
(1万口当たり純資産額)	(9,156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	0.55 CHINA GOVT I 251021	600,000.00	561,227.65	
		1 ARGENTINA 290709	91,576.00	49,157.99	
		1.2 CHINA GOVT IN 301021	400,000.00	332,579.14	
		1.25 CHINA GOVT I 261026	600,000.00	552,111.99	
		1.625 ABU DHABI G 280602	400,000.00	354,314.00	

1. 7 ABU DHABI GOV 310302	200,000.00	166,138.40	
1. 875 ABU DHABI G 310915	200,000.00	166,099.20	
10. 875 EGYPT TASK 260228	200,000.00	209,799.00	
2. 125 CHINA GOVT 291203	600,000.00	537,434.48	
2. 125 HUNGARY 310922	600,000.00	476,697.00	
2. 25 KSA SUKUK LT 310517	200,000.00	169,248.60	
2. 25 SAUDI INTERN 330202	400,000.00	322,684.00	
2. 252 PANAMA 320929	600,000.00	436,566.39	
2. 5 ABU DHABI GOV 250416	600,000.00	583,732.80	
2. 5 ABU DHABI GOV 290930	600,000.00	539,019.60	
2. 55 CHILE 320127	400,000.00	338,999.06	
2. 55 CHILE 330727	400,000.00	325,813.10	
2. 65 PHILIPPINE 451210	400,000.00	263,958.77	
2. 659 MEXICO 310524	400,000.00	333,587.16	
2. 7 ABU DHABI GOV 700902	200,000.00	117,763.60	
2. 75 CHILE 270131	400,000.00	375,628.69	
2. 78 PERU 601201	500,000.00	290,170.00	
2. 783 PERU 310123	800,000.00	687,354.44	
2. 875 BRAZIL 250606	200,000.00	193,717.94	
2. 9 SAUDI INTERNA 251022	200,000.00	193,390.00	
2. 969 KSA SUKUK L 291029	400,000.00	363,562.80	
3 COLOMBIA 300130	200,000.00	166,201.25	
3 PERU 340115	450,000.00	369,619.66	
3. 05 INDONESIA 510312	400,000.00	281,391.24	
3. 1 CHILE 410507	600,000.00	444,074.49	
3. 1 CHILE 610122	400,000.00	252,524.17	
3. 125 ABU DHABI G 300416	600,000.00	552,479.40	
3. 125 ABU DHABI G 490930	800,000.00	563,442.40	
3. 125 COLOMBIA 310415	600,000.00	481,823.79	
3. 125 HUNGARY 510921	400,000.00	254,528.00	
3. 16 PANAMA 300123	400,000.00	337,489.92	
3. 2 PHILIPPINE 460706	600,000.00	432,004.72	
3. 25 COLOMBIA 320422	400,000.00	313,539.80	
3. 25 MEXICO 300416	200,000.00	177,995.04	
3. 25 SAUDI INTERN 301022	400,000.00	363,786.40	
3. 25 UAE INT'L GO 611019	400,000.00	276,613.20	

3. 4 QATAR 250416	600,000.00	589,891.20	
3. 45 SAUDI INTERN 610202	200,000.00	133,238.80	
3. 5 CHILE 340131	400,000.00	350,233.88	
3. 5 CHILE 500125	600,000.00	438,738.64	
3. 5 CHILE 530415	200,000.00	145,281.53	
3. 5 MEXICO 340212	400,000.00	332,560.60	
3. 55 PERU 510310	460,000.00	333,845.00	
3. 75 BRAZIL 310912	400,000.00	350,898.50	
3. 75 MEXICO 710419	400,000.00	253,647.72	
3. 75 QATAR 300416	600,000.00	576,218.40	
3. 75 SAUDI INTERN 550121	400,000.00	288,793.20	
3. 771 MEXICO 610524	600,000.00	389,059.50	
3. 85 INDONESIA 301015	400,000.00	373,836.06	
3. 87 PANAMA 600723	600,000.00	358,652.01	
3. 875 ABU DHABI G 500416	600,000.00	480,724.80	
3. 875 BRAZIL 300612	800,000.00	726,429.65	
4 QATAR 290314	800,000.00	782,432.00	
4 ROMANIA 510214	510,000.00	361,263.60	
4. 05 UAE INT'L GO 320707	400,000.00	385,792.00	
4. 125 COLOMBIA 510515	400,000.00	251,093.34	
4. 2 INDONESIA 501015	400,000.00	337,503.58	
4. 25 TURKEY 250313	400,000.00	394,300.80	
4. 274 KSA SUKUK L 290522	400,000.00	390,739.60	
4. 28 MEXICO 410814	400,000.00	320,935.86	
4. 34 CHILE 420307	400,000.00	348,730.54	
4. 4 MEXICO 520212	400,000.00	304,458.00	
4. 4 PERUSAHAAN PE 270606	400,000.00	393,177.11	
4. 4 QATAR 500416	1,200,000.00	1,063,704.00	
4. 5 BRAZIL 290530	600,000.00	574,708.31	
4. 5 DOMINICAN 300130	450,000.00	411,477.15	
4. 5 MEXICO 500131	400,000.00	313,925.71	
4. 5 PANAMA 560401	600,000.00	402,136.86	
4. 5 PANAMA 630119	400,000.00	263,804.44	
4. 5 SAUDI INTERNA 600422	400,000.00	329,146.00	
4. 511 KSA SUKUK L 330522	400,000.00	391,324.00	
4. 7 PERUSAHAAN PE 320606	400,000.00	392,902.00	

4.75 BRAZIL 500114	800,000.00	602,728.69	
4.75 MEXICO 320427	400,000.00	378,874.86	
4.75 SAUDI INTERN 280118	400,000.00	399,849.20	
4.75 SAUDI INTERN 300116	200,000.00	199,000.00	
4.75 TURKEY 260126	200,000.00	195,585.00	
4.817 QATAR 490314	1,200,000.00	1,126,560.00	
4.85 CHILE 290122	200,000.00	198,951.98	
4.85 SOUTH AFRICA 290930	400,000.00	360,423.20	
4.875 DOMINICAN 320923	750,000.00	674,016.62	
4.875 MEXICO 330519	400,000.00	378,597.53	
4.875 OMAN SOVERE 300615	400,000.00	393,761.20	
4.875 SAUDI INTER 330718	600,000.00	596,982.00	
4.917 UAE INT'L G 330925	200,000.00	205,382.20	
4.95 CHILE 360105	400,000.00	388,040.11	
5 MEXICO 510427	200,000.00	167,578.44	
5 SAUDI INTERNATI 340116	400,000.00	398,668.00	
5 SAUDI INTERNATI 530118	400,000.00	357,912.40	
5.125 HAZINE MUST 260622	600,000.00	582,750.00	
5.25 HUNGARY 290616	400,000.00	396,271.20	
5.25 TURKEY 300313	400,000.00	361,828.00	
5.268 KSA SUKUK L 281025	400,000.00	408,348.00	
5.3 DOMINICAN 410121	300,000.00	255,616.19	
5.5 DOMINICAN 290222	450,000.00	438,187.50	
5.5 HUNGARY 360326	600,000.00	583,200.00	
5.5 SAUDI INTERNA 321025	400,000.00	414,550.00	
5.6 TURKEY 241114	400,000.00	400,940.00	
5.75 SAUDI INTERN 540116	600,000.00	593,817.60	
5.75 SOUTH AFRICA 490930	800,000.00	585,000.00	
5.75 URUGUAY 341028	500,000.00	529,000.00	
5.875 ARAB REPUB 310216	400,000.00	323,090.00	
5.875 DOMINICAN 600130	750,000.00	640,253.93	
5.875 ROMANIA 290130	500,000.00	501,300.00	
5.875 TURKEY 310626	400,000.00	367,106.00	
5.95 TURKEY 310115	200,000.00	184,955.00	
6 BRAZIL 331020	400,000.00	397,731.60	
6 DOMINICAN 330222	450,000.00	439,194.66	

6 MEXICO 360507	600,000.00	600,664.59	
6 OMAN GOV INTERN 290801	600,000.00	613,851.00	
6.125 BRAZIL 340315	400,000.00	397,095.37	
6.125 HUNGARY 280522	600,000.00	616,474.80	
6.25 BRAZIL 310318	400,000.00	409,584.57	
6.25 HUNGARY 320922	400,000.00	417,427.20	
6.25 OMAN GOV INT 310125	400,000.00	414,136.80	
6.338 MEXICO 530504	400,000.00	393,184.22	
6.35 MEXICO 350209	400,000.00	411,846.24	
6.375 ROMANIA 340130	400,000.00	406,168.80	
6.375 TURKEY 251014	200,000.00	200,925.00	
6.4 DOMINICAN 490605	450,000.00	424,194.94	
6.4 MEXICO 540507	400,000.00	397,054.02	
6.4 PANAMA 350214	600,000.00	578,314.74	
6.5 TURKEY 330920	200,000.00	187,491.80	
6.625 ROMANIA 280217	400,000.00	413,068.00	
6.876 UKRAINE 310521	200,000.00	61,147.00	
7.125 BRAZIL 540513	400,000.00	403,812.64	
7.125 ROMANIA 330117	450,000.00	482,071.95	
7.25 HAZINE MUSTE 270224	400,000.00	407,500.00	
7.253 UKRAINE 350315	600,000.00	180,688.80	
7.3 SOUTH AFRICA 520420	400,000.00	348,500.00	
7.375 NIGERIA REP 330928	400,000.00	341,414.40	
7.5 ARAB REPUBLIC 610216	400,000.00	292,833.60	
7.5 COLOMBIA 340202	600,000.00	615,493.59	
7.625 ARAB REPUBL 320529	400,000.00	343,501.20	
7.625 TURKEY 340515	400,000.00	401,418.00	
8 COLOMBIA 330420	400,000.00	423,877.26	
8.5091 HAZINE MUS 290114	400,000.00	423,082.00	
8.6 TURKEY 270924	400,000.00	425,436.00	
8.875 ARAB REPUBL 500529	400,000.00	331,913.60	
9.125 TURKEY 300713	200,000.00	216,627.20	
9.375 TURKEY 290314	400,000.00	435,572.00	
9.375 TURKEY 330119	400,000.00	445,704.00	
9.75 UKRAINE 301101	200,000.00	71,434.00	
9.758 HAZINE MUST 251113	200,000.00	211,186.00	

	9.875 TURKEY 280115	400,000.00	441,352.40	
	FRN ARGENTINA 300709	2,150,000.00	1,125,095.00	
	FRN ARGENTINA 350709	2,550,000.00	1,075,545.06	
	FRN ARGENTINA 380109	1,500,000.00	702,166.68	
	FRN ARGENTINA 410709	1,250,000.00	509,346.35	
	FRN ARGENTINA 460709	155,500.00	70,614.47	
	FRN ECUADOR 300731	850,000.00	576,897.70	
	FRN ECUADOR 350731	1,750,000.00	925,768.93	
	FRN ECUADOR 400731	790,000.00	387,297.50	
アメリカドル合計		77,257,076.00	63,728,704.20 (9,650,437,677)	
合計			9,650,437,677 (9,650,437,677)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 158 銘柄	100.00%	100.00%

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。

【中間財務諸表】

1 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3および第57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、中間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、当中間計算期間(2024年3月26日から2024年9月25日まで)の中間財務諸表について、PwC Japan 有限責任監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月27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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）の2024年3月26日から2024年9月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）の2024年9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中間計算期間（2024年3月26日から2024年9月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク

評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRL データは中間監査の対象には含まれていません。

【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第 11 期 [2024 年 3 月 25 日現在]	第 12 期中間計算期間末 [2024 年 9 月 25 日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	453,658,673	321,188,037
親投資信託受益証券	17,198,333,625	15,564,625,618
未収入金	-	118,000,000
未収利息	875	1,867
流動資産合計	17,651,993,173	16,003,815,522
資産合計	17,651,993,173	16,003,815,522
負債の部		
流動負債		
未払解約金	58,202,233	16,107,473
未払受託者報酬	4,763,102	3,917,012
未払委託者報酬	119,077,547	95,198,084
その他未払費用	342,887	331,060
流動負債合計	182,385,769	115,553,629
負債合計	182,385,769	115,553,629
純資産の部		
元本等		
元本	15,002,180,986	13,905,929,307
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	2,467,426,418	1,982,332,586
（分配準備積立金）	982,389,090	909,385,947
元本等合計	17,469,607,404	15,888,261,893
純資産合計	17,469,607,404	15,888,261,893
負債純資産合計	17,651,993,173	16,003,815,522

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 11 期中間計算期間 自 2023 年 3 月 28 日 至 2023 年 9 月 27 日	第 12 期中間計算期間 自 2024 年 3 月 26 日 至 2024 年 9 月 25 日
営業収益		
受取利息	1,604	252,396
有価証券売買等損益	251,578,565	△208,888,689
営業収益合計	251,580,169	△208,636,293
営業費用		
支払利息	153,423	-
受託者報酬	5,199,161	3,917,012
委託者報酬	129,978,953	95,198,084
その他費用	374,274	331,060

営業費用合計	135,705,811	99,446,156
営業利益又は営業損失(△)	115,874,358	△308,082,449
経常利益又は経常損失(△)	115,874,358	△308,082,449
中間純利益又は中間純損失(△)	115,874,358	△308,082,449
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	15,718,943	△3,363,940
期首剰余金又は期首欠損金(△)	1,452,439,034	2,467,426,418
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,259,448	3,055,000
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,259,448	3,055,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	90,240,923	183,430,323
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	90,240,923	183,430,323
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	1,463,612,974	1,982,332,586

(3)【中間注記表】

(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。
--------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

	第11期 [2024年3月25日現在]	第12期中間計算期間末 [2024年9月25日現在]
1. 期首元本額	17,743,252,194円	15,002,180,986円
期中追加設定元本額	28,533,597円	19,034,416円
期中一部解約元本額	2,769,604,805円	1,115,286,095円
2. 受益権の総数	15,002,180,986口	13,905,929,307口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期中間計算期間 自2023年3月28日 至2023年9月27日	第12期中間計算期間 自2024年3月26日 至2024年9月25日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	第11期 [2024年3月25日現在]	第12期中間計算期間末 [2024年9月25日現在]
1. 中間貸借対照表計上額、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ぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	--	----

(有価証券に関する注記)
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)
取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第 11 期 [2024 年 3 月 25 日現在]	第 12 期中間計算期間末 [2024 年 9 月 25 日現在]
1 口当たり純資産額	1,164 円	1,142 円
(1 万口当たり純資産額)	(11,645 円)	(11,426 円)

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月27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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）の2024年3月26日から2024年9月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）の2024年9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中間計算期間（2024年3月26日から2024年9月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク

評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRL データは中間監査の対象には含まれていません。

【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 [2024年3月25日現在]	第12期中間計算期間末 [2024年9月25日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	484,289,523	573,285,486
親投資信託受益証券	20,208,866,603	18,662,380,087
未収利息	934	3,332
流動資産合計	20,693,157,060	19,235,668,905
資産合計	20,693,157,060	19,235,668,905
負債の部		
流動負債		
未払解約金	16,096,023	3,937,910
未払受託者報酬	5,314,224	5,557,991
未払委託者報酬	132,855,539	138,949,819
その他未払費用	382,568	400,112
流動負債合計	154,648,354	148,845,832
負債合計	154,648,354	148,845,832
純資産の部		
元本等		
元本	13,700,578,456	13,042,009,514
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	6,837,930,250	6,044,813,559
（分配準備積立金）	3,963,559,155	3,757,972,828
元本等合計	20,538,508,706	19,086,823,073
純資産合計	20,538,508,706	19,086,823,073
負債純資産合計	20,693,157,060	19,235,668,905

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期中間計算期間 自 2023年3月28日 至 2023年9月27日	第12期中間計算期間 自 2024年3月26日 至 2024年9月25日
営業収益		
受取利息	1,608	260,103
有価証券売買等損益	1,275,667,101	△313,100,101
営業収益合計	1,275,668,709	△312,839,998
営業費用		
支払利息	155,455	-
受託者報酬	5,555,039	5,557,991
委託者報酬	138,875,903	138,949,819
その他費用	399,902	400,112
営業費用合計	144,986,299	144,907,922

営業利益又は営業損失 (△)	1, 130, 682, 410	△457, 747, 920
経常利益又は経常損失 (△)	1, 130, 682, 410	△457, 747, 920
中間純利益又は中間純損失 (△)	1, 130, 682, 410	△457, 747, 920
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 (△)	56, 642, 351	7, 406, 646
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	3, 981, 399, 794	6, 837, 930, 250
剰余金増加額又は欠損金減少額	20, 683, 786	27, 326, 690
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	20, 683, 786	27, 326, 690
剰余金減少額又は欠損金増加額	277, 918, 916	355, 288, 815
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	277, 918, 916	355, 288, 815
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	4, 798, 204, 723	6, 044, 813, 559

(3) 【中間注記表】

(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。
--------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

	第 11 期 [2024 年 3 月 25 日現在]	第 12 期中間計算期間末 [2024 年 9 月 25 日現在]
1. 期首元本額	16, 004, 523, 401 円	13, 700, 578, 456 円
期中追加設定元本額	139, 732, 101 円	53, 243, 343 円
期中一部解約元本額	2, 443, 677, 046 円	711, 812, 285 円
2. 受益権の総数	13, 700, 578, 456 口	13, 042, 009, 514 口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 11 期中間計算期間 自 2023 年 3 月 28 日 至 2023 年 9 月 27 日	第 12 期中間計算期間 自 2024 年 3 月 26 日 至 2024 年 9 月 25 日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	第 11 期 [2024 年 3 月 25 日現在]	第 12 期中間計算期間末 [2024 年 9 月 25 日現在]
1. 中間貸借対照表計上額、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ぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記) に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品 (コールローン等) は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左

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

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第 11 期 [2024年 3月 25日現在]	第 12 期中間計算期間末 [2024年 9月 25日現在]
1口当たり純資産額	1,4991 円	1,4635 円
(1万口当たり純資産額)	(14,991 円)	(14,635 円)

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月27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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）の2024年3月26日から2024年9月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）の2024年9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中間計算期間（2024年3月26日から2024年9月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク

評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRL データは中間監査の対象には含まれていません。

【三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 [2024年3月25日現在]	第12期中間計算期間末 [2024年9月25日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	122,138,538	102,959,232
親投資信託受益証券	4,407,477,129	3,941,946,523
未収入金	24,000,000	26,000,000
未収利息	235	598
流動資産合計	4,553,615,902	4,070,906,353
資産合計	4,553,615,902	4,070,906,353
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,709,946	9,431,705
未払受託者報酬	1,177,331	1,193,768
未払委託者報酬	29,433,176	29,844,187
その他未払費用	84,706	85,889
流動負債合計	39,405,159	40,555,549
負債合計	39,405,159	40,555,549
純資産の部		
元本等		
元本	3,441,336,362	3,097,434,791
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	1,072,874,381	932,916,013
(分配準備積立金)	259,318,272	233,031,855
元本等合計	4,514,210,743	4,030,350,804
純資産合計	4,514,210,743	4,030,350,804
負債純資産合計	4,553,615,902	4,070,906,353

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期中間計算期間 自 2023年3月28日 至 2023年9月27日	第12期中間計算期間 自 2024年3月26日 至 2024年9月25日
営業収益		
受取利息	355	57,700
有価証券売買等損益	253,917,919	10,079,358
営業収益合計	253,918,274	10,137,058
営業費用		
支払利息	30,904	-
受託者報酬	1,221,595	1,193,768
委託者報酬	30,539,973	29,844,187
その他費用	87,894	85,889

営業費用合計	31,880,366	31,123,844
営業利益又は営業損失(△)	222,037,908	△20,986,786
経常利益又は経常損失(△)	222,037,908	△20,986,786
中間純利益又は中間純損失(△)	222,037,908	△20,986,786
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	7,068,972	11,889,137
期首剰余金又は期首欠損金(△)	441,967,206	1,072,874,381
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,372,011	1,745,848
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,372,011	1,745,848
剰余金減少額又は欠損金増加額	19,912,879	108,828,293
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	19,912,879	108,828,293
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	638,395,274	932,916,013

(3)【中間注記表】

(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。
--------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

	第11期 [2024年3月25日現在]	第12期中間計算期間末 [2024年9月25日現在]
1. 期首元本額	3,908,166,997円	3,441,336,362円
期中追加設定元本額	30,738,192円	5,150,826円
期中一部解約元本額	497,568,827円	349,052,397円
2. 受益権の総数	3,441,336,362口	3,097,434,791口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期中間計算期間 自2023年3月28日 至2023年9月27日	第12期中間計算期間 自2024年3月26日 至2024年9月25日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	第11期 [2024年3月25日現在]	第12期中間計算期間末 [2024年9月25日現在]
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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>	同左
----------------------------	---	----

(有価証券に関する注記)
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)
取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第 11 期 [2024年 3月 25日現在]	第 12 期中間計算期間末 [2024年 9月 25日現在]
1口当たり純資産額	1. 3118 円	1. 3012 円
(1万口当たり純資産額)	(13, 118 円)	(13, 012 円)

(参考)

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

TOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年 9月 25日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	25, 436, 996, 926
株式	1, 472, 132, 217, 360
派生商品評価勘定	685, 251, 500
未収入金	68, 625, 727
未収配当金	609, 935, 169
未収利息	147, 869
その他未収収益	9, 859, 557
差入委託証拠金	1, 159, 112, 302
流動資産合計	1, 500, 102, 146, 410
資産合計	1, 500, 102, 146, 410
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2, 164, 950
前受金	734, 015, 000
未払金	52, 684, 830

未払解約金	992,713,665
未払利息	4,109,176
受入担保金	10,938,074,095
流動負債合計	12,723,761,716
負債合計	12,723,761,716
純資産の部	
元本等	
元本	456,727,705,427
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	1,030,650,679,267
元本等合計	1,487,378,384,694
純資産合計	1,487,378,384,694
負債純資産合計	1,500,102,146,410

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。

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年9月25日現在]
1. 期首	2024年3月26日
期首元本額	417,799,026,755円
期中追加設定元本額	122,818,354,007円
期中一部解約元本額	83,889,675,335円
元本の内訳※	
三菱UFJ トピックスインデックスオープン	6,686,113,682円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	769,382,300円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	3,737,910,660円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	3,914,562,594円
三菱UFJ トピックスオープン(確定拠出年金)	3,805,089,396円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	5,649,178,477円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	33,084,695,494円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	42,047,198,245円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	81,821,364円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	236,454,799円
ファンド・マネジャー(国内株式)	308,625,493円
eMAXIS TOPIXインデックス	8,486,602,907円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,063,348,715円
eMAXIS バランス(波乗り型)	176,794,829円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	2,842,587,947円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	831,406,822円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	1,127,702,702円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	1,158,114,083円
eMAXIS Slim 国内株式(TOPIX)	67,748,790,546円
国内株式セレクション(ラップ向け)	6,483,008,725円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	11,419,373,383円

つみたて日本株式 (TOPIX)	12,563,437,483 円
つみたて8資産均等バランス	5,799,210,854 円
つみたて4資産均等バランス	2,237,125,360 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	3,432,706 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	5,686,166 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	10,490,357 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	695,163,994 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	999,002,735 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	708,656,257 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	540,514,197 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	1,822,864,976 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	4,591,979,574 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	1,773,600,409 円
三菱UFJ DC年金インデックス (国内株式)	5,582,325,992 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	707,738,373 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	156,834,522 円
国内株式インデックス・オープン (ラップ向け)	22,994,133,319 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	355,416,344 円
ラップ向けインデックスf 国内株式	4,173,981,587 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	176,188,307 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	4,645,828,089 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	2,959,845,493 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	66,787,772 円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	19,708,199 円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	26,070,265 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	7,776,241 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス (為替リスク軽減型) コンサバティブコース	3,171,994 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	62,550,874 円
eMAXIS/PayPay証券 全世界バランス	324,726 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	244,363,918 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	995,160,771 円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	382,172,436 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	47,202,974 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	16,763,380 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	127,411,532 円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	911,827,507 円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	161,725,181 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	204,942,564 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	868,067,126 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	708,131,725 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	1,311,132,105 円
三菱UFJ トピックスオープン	916,276,675 円
三菱UFJ DCトピックスオープン	8,078,752,480 円
三菱UFJ トピックスオープンVA (適格機関投資家限定)	39,205,638 円
三菱UFJ トピックスインデックスファンドVA (適格機関投資家限定)	3,428,851,252 円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	6,937,826 円

三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,437,691,957円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	56,360,008円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,148,184,982円
MUAM 日本株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)	57,112,369,263円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	180,958,812円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	207,809円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	123,328円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	183,855,340円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	308,627,140円
MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)	4,690,755,246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)	813,774,092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)	244,420,180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)	362,565,119円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	97,031,469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)	153,956,107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)	26,546,310円
MUKAM 日本株式インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	3,840,842,177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)	310,020,998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)	33,606,170円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	275,859円
日米コアバランス (FOFs用) (適格機関投資家限定)	96,695,100円
日本株式インデックスファンドS	4,590,723,084円
グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定)	9,757,553円
MUAM グローバルバランス (退職給付信託向け) (適格機関投資家限定)	9,798,010,251円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	35,419,113円
MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	79,523,277円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	34,940,101円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	34,951,319円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	34,935,203円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	35,058,940円
MUKAM 日米コアバランス 2021-07 (適格機関投資家限定)	259,774,347円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	34,874,281円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	35,762,664円
MUKAM 日米コアバランス (除く米国株) 2022-03 (適格機関投資家限定)	511,142,581円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	37,565,083円

格機関投資家限定)	
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	38,774,804 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	39,792,135 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	39,241,585 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	39,102,095 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	39,096,327 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)	39,100,255 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定)	39,088,327 円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	5,503,461,776 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	2,615,018 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	6,264,861 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	1,463,182 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	5,601,368 円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	426,164,989 円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	59,949,032 円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	2,899,455 円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	24,763,245 円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	1,382,324 円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	14,414,983 円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,581,245,878 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)	309,028,551 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	1,324,965,606 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)	1,280,507,807 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)	1,257,131,489 円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	61,222,809,654 円
合計	456,727,705,427 円
2. 貸付有価証券 貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っておりません。 株式	10,433,412,120 円
3. 受益権の総数	456,727,705,427 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)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年9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ぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>

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

(有価証券に関する注記)
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)
取引の時価等に関する事項
株式関連

[2024年9月25日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	14,535,610,000	—	15,219,015,000	683,405,000
合計		14,535,610,000	—	15,219,015,000	683,405,000

(注) 時価の算定方法

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

(1口当たり情報)

	[2024年9月25日現在]
1口当たり純資産額	3.2566円
(1万口当たり純資産額)	(32,566円)

外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年9月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	38,357,604,323
コール・ローン	12,027,267,286
株式	5,979,546,035,856
投資証券	123,304,126,255
派生商品評価勘定	1,872,582,838
未収入金	43,554,437
未収配当金	6,431,425,766
未収利息	69,916
差入委託証拠金	88,227,850,854
流動資産合計	6,249,810,517,531

資産合計	6,249,810,517,531
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	72,497,544
未払解約金	715,341,341
流動負債合計	787,838,885
負債合計	787,838,885
純資産の部	
元本等	
元本	881,396,238,010
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	5,367,626,440,636
元本等合計	6,249,022,678,646
純資産合計	6,249,022,678,646
負債純資産合計	6,249,810,517,531

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年9月25日現在]
1. 期首	2024年3月26日
期首元本額	721,351,336,039円
期中追加設定元本額	201,234,406,491円
期中一部解約元本額	41,189,504,520円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	172,055,852円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	915,061,933円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	930,121,431円
MAXIS 海外株式(MSCIコクサイ)上場投信	3,174,875,099円
MAXIS 全世界株式(オール・カントリー)上場投信	6,577,686,813円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,263,317,468円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	8,099,319,129円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	9,990,640,995円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	38,939,335円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	109,545,090円
ファンド・マネジャー(海外株式)	776,167円
eMAXIS 先進国株式インデックス	14,259,082,282円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	957,192,591円
eMAXIS バランス(波乗り型)	35,665,056円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,688,536,156円

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	174,227,995 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	270,964,942 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	267,573,071 円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス 海外株式セレクション (ラップ向け)	109,289,236,784 円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	2,283,073,482 円
つみたて先進国株式	5,309,151,724 円
つみたて8資産均等バランス	38,966,639,193 円
つみたて4資産均等バランス	2,672,714,136 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,036,192,956 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,044,734 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	3,635,389 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	7,829,831 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	160,454,737 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	223,784,546 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	167,687,644 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	64,214,494 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	519,747,065 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本)	1,550,480,357 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	68,093,326,212 円
三菱UFJ DC年金インデックス (先進国株式)	826,976,059 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カントリー)	5,157,088,258 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	489,782,059,564 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	159,879,618 円
つみたて全世界株式	41,922,831 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	4,863,348,605 円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	83,941,924 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	2,566,049,816 円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	69,824,361 円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	1,258,710,355 円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	43,755,238 円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	5,407,108 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	7,259,413 円
eMAXIS/PayPay証券 全世界バランス	1,835,385 円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	425,406 円
eMAXIS 全世界株式インデックス	34,320,568,966 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	7,186,905,653 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	407,490,487 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	896,636,175 円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	173,160 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	642,991,977 円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	126,513,667 円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	423,856,062 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	82,872,820 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	122,203,956 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	557,176,839 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	468,418,796 円

eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	980,248,550 円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA (適格機関投資家限定)	987,191,637 円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	4,125,927 円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	2,657,655,734 円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	26,371,571 円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	533,300,352 円
MUAM 外国株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)	8,287,178,625 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	57,105 円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	426,737,159 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)	3,827,746,266 円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	5,976,634 円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	44,336,907 円
MUKAM バランス・イノベーション (株式抑制型) (適格機関投資家転売制限付)	1,325,350,598 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)	404,001,621 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)	119,725,380 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	57,638,012 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)	809,736,954 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)	71,042,826 円
MUKAM 外国株式インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	2,534,044,716 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)	101,344,160 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)	54,090,688 円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	195,260 円
海外株式インデックスファンドS	11,693,155,991 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)	417,399,416 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)	235,167,380 円
グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定)	3,983,295 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)	95,943,017 円
MUAM グローバルバランス (退職給付信託向け) (適格機関投資家限定)	4,776,531,798 円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	3,010,455,585 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	607,734 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	1,465,664 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	387,700 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	1,629,356 円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	19,654,761 円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	671,977 円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	5,731,256 円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	644,626 円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	6,737,993 円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	7,404,849,874 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)	71,624,927 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)	307,560,823 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)	339,185,178 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)	364,665,789 円
合計	881,396,238,010 円
2. 受益権の総数	881,396,238,010 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)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年9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す。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[2024年9月25日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	147,444,344,514	—	149,255,419,025	1,811,074,511
合計		147,444,344,514	—	149,255,419,025	1,811,074,511

(注) 時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

[2024年9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	為替予約取引				

取引	買建				
	アメリカドル	11,419,268,199	—	11,395,590,543	△23,677,656
	カナダドル	469,495,476	—	471,428,807	1,933,331
	オーストラリアドル	287,498,439	—	289,044,811	1,546,372
	イギリスポンド	607,868,657	—	609,252,906	1,384,249
	スイスフラン	264,400,704	—	265,037,925	637,221
	香港ドル	84,916,056	—	84,695,208	△220,848
	シンガポールドル	54,765,996	—	54,956,252	190,256
	ニュージーランドドル	74,753,436	—	75,634,877	881,441
	スウェーデンクローネ	159,279,204	—	160,416,912	1,137,708
	デンマーククローネ	117,253,916	—	117,863,840	609,924
	ユーロ	1,171,391,271	—	1,175,980,056	4,588,785
	合計	14,710,891,354	—	14,699,902,137	△10,989,217

(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。

(1口当たり情報)

	[2024年9月25日現在]
1口当たり純資産額	7.0899円
(1万口当たり純資産額)	(70,899円)

新興国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年9月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	23,832,315,384
コール・ローン	658,056,360
株式	903,213,561,427
投資証券	889,603,914

派生商品評価勘定	1,750,274,252
未収入金	19,690,650
未収配当金	1,829,465,556
未収利息	3,825
差入委託証拠金	5,681,587,218
流動資産合計	937,874,558,586
資産合計	937,874,558,586
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,681,421
未払金	1,903,837
未払解約金	28,071,064
流動負債合計	52,656,322
負債合計	52,656,322
純資産の部	
元本等	
元本	239,915,651,427
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	697,906,250,837
元本等合計	937,821,902,264
純資産合計	937,821,902,264
負債純資産合計	937,874,558,586

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

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年9月25日現在]
1. 期首	2024年3月26日
期首元本額	194,952,402,151円
期中追加設定元本額	49,251,435,549円
期中一部解約元本額	4,288,186,273円
元本の内訳※	
MAXIS全世界株式(オール・カントリー)上場投信	1,455,667,058円
eMAXIS 新興国株式インデックス	10,244,700,284円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,745,449,515円
eMAXIS バランス(波乗り型)	51,833,473円
三菱UFJプライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	621,493,397円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	9,809,649,667円
eMAXIS Slim 新興国株式インデックス	43,566,360,025円

つみたて新興国株式	9,775,063,733 円
つみたて8資産均等バランス	4,943,599,110 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	632,271 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,545,490 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	7,959,556 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本)	15,084,550,701 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	1,521,822,706 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カントリー)	108,499,655,576 円
新興国株式インデックス・オープン (ラップ向け)	5,291,831,541 円
つみたて全世界株式	1,077,275,965 円
ラップ向けインデックスf 新興国株式	1,019,597,969 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	3,434,496 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	1,303,286,050 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	1,652,320,033 円
eMAXIS/PayPay証券 全世界バランス	88,538 円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	17,515,704,643 円
新興国株式インデックスオープン	414,330,642 円
eMAXIS 全世界株式インデックス	1,592,807,270 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	44,810 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	37,801,668 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	234,960,352 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	253,088,754 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	995,204,242 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)	848,016,741 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	21,214,638 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)	52,096,522 円
グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定)	881,153 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)	21,223,417 円
MUKAM バランスファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	54,031,623 円
MUKAM バランスファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	53,657,010 円
MUKAM バランスファンド2020-10 (適格機関投資家限定)	53,388,985 円
MUKAM バランスファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	47,245,663 円
MUKAM バランスファンド2021-06 (適格機関投資家限定)	42,136,140 円
合計	239,915,651,427 円
2. 受益権の総数	239,915,651,427 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)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年9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	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p>

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
----------------------------	--

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）
取引の時価等に関する事項
株式関連

[2024年9月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	34,397,219,179	—	36,147,439,009	1,750,219,830
合計		34,397,219,179	—	36,147,439,009	1,750,219,830

（注）時価の算定方法

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

通貨関連

[2024年9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	575,077,541	—	573,509,014	△1,568,527
	メキシコペソ	519,127,000	—	519,092,000	△35,000
	ニュー台湾ドル	3,511,560,000	—	3,490,578,000	△20,982,000
	売建				
アメリカドル	1,554,870,100	—	1,554,910,245	△40,145	
オフショア元	269,541	—	270,868	△1,327	
合計		6,160,904,182	—	6,138,360,127	△22,626,999

（注）時価の算定方法

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報)

	[2024年9月25日現在]
1口当たり純資産額	3.9090円
(1万口当たり純資産額)	(39,090円)

(追加情報)

自 2024年3月26日 至 2024年9月25日
<p>当ファンドは、ロシア株式（DR（預託証券）を含みます。以下、「当該株式」）を組み入れております。2022年2月24日に発生したロシアのウクライナ侵攻による当ファンドへの影響は以下の通りです。</p> <p>ロシアが、2022年2月24日に首都キーウを含むウクライナ国内の複数の都市への軍事侵攻に踏み切って以降、期末日時点においてロシア軍とウクライナ軍の戦闘が続いております。</p> <p>2022年2月24日以降、ロシアのウクライナ侵攻を受けた米欧の経済制裁やそれに対抗措置をロシアが設けたことにより、取引の規制、決済機構やSWIFTからの除外による取引後の受渡が行えない状況となり、市場でのロシア関連資産の取引が成立しない状況となりました。このため、組入株式の時価については金融商品取引所等における最終相場で評価していますが、当該株式の取引停止等に伴い、取引停止日以降の最終相場の価格が入手できない状況となりました。当該株式のロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引についても、実現が困難な状況となっております。</p> <p>時価の算定に関する会計基準に基づきますと、組入有価証券に係る時価は秩序ある取引が行われると想定した場合の出口価格である必要があり、上記状況を総合的に勘案した結果、当ファンドが組み入れている当該株式において、2022年3月14日付けで評価額をゼロとすることとし、期末日時点においても当該取り扱いを継続しております。2022年3月11日時点の当ファンドにおける当該株式の保有割合は0.55%です。</p> <p>なお、2022年3月24日にモスクワ証券取引所は一部取引を再開しておりますが、ロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引について、実現が困難な状況に変わりありません。</p> <p>今後、当該株式のロシア国外の投資家による取引の再開、市場の流動性の回復、最終相場価格の提供再開、ならびに当該株式に係る証券決済や為替取引の実現等の変化があれば、状況を総合的に判断の上、その評価額をゼロから回復させる可能性もあります。</p>

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)

[2024年9月25日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,150,149,180
国債証券	250,563,813,580
地方債証券	14,671,086,720
特殊債券	12,195,601,268
社債券	16,808,927,000
派生商品評価勘定	958,130
未収利息	265,694,406
前払費用	46,414,259
差入委託証拠金	3,831,438
流動資産合計	296,706,475,981
資産合計	296,706,475,981
負債の部	
流動負債	

前受金	1,160,000
未払金	400,000,000
未払解約金	643,768,843
流動負債合計	1,044,928,843
負債合計	1,044,928,843
純資産の部	
元本等	
元本	321,643,231,715
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	△25,981,684,577
元本等合計	295,661,547,138
純資産合計	295,661,547,138
負債純資産合計	296,706,475,981

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。

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年9月25日現在]
1. 期首	2024年3月26日
期首元本額	221,057,167,943円
期中追加設定元本額	272,347,877,103円
期中一部解約元本額	171,761,813,331円
元本の内訳※	
ファンド・マネジャー(国内債券)	18,220,783,295円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	32,878,815,093円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	1,132,249,810円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	51,247,466円
アクティブアロケーションファンド(ラップ向け)	66,772,531円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	8,624,911,301円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	4,712,603,109円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	1,426,563,394円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	13,718,258,454円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	4,390,808,174円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	28,702,506,076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)	8,640,000,040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)	29,779,224,823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)	2,475,373,998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)	165,634,575,475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)	1,188,538,676円
合計	321,643,231,715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。	25,981,684,577 円
3. 受益権の総数	321,643,231,715 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)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年9月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

債券関連

[2024年9月25日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	289,060,000	—	290,020,000	960,000
合計		289,060,000	—	290,020,000	960,000

(注) 時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報)

	[2024年9月25日現在]
1口当たり純資産額	0.9192 円
(1万口当たり純資産額)	(9,192 円)

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年9月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	1,053,528,459
コール・ローン	4,877,305,237
国債証券	361,044,984,792
派生商品評価勘定	1,145,995,241
未収入金	45,403,669
未収利息	2,699,527,169
前払費用	342,450,364
流動資産合計	371,209,194,931
資産合計	371,209,194,931
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	729,118,668
未払金	3,024,419,226
未払解約金	35,274,369
流動負債合計	3,788,812,263
負債合計	3,788,812,263
純資産の部	
元本等	
元本	324,414,680,830
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	43,005,701,838
元本等合計	367,420,382,668
純資産合計	367,420,382,668
負債純資産合計	371,209,194,931

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年9月25日現在]
1. 期首	2024年3月26日
期首元本額	296,996,179,772円
期中追加設定元本額	58,407,901,001円
期中一部解約元本額	30,989,399,943円
元本の内訳※	
eMAXIS 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	1,029,868,618円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	17,507,402,182円
ラップ向けインデックスf 先進国債券(為替ヘッジあり)	6,483,952,808円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	599,761,049円

ラップ向けアクティブアロケーションファンド	41,011,804円
アクティブアロケーションファンド(ラップ向け)	54,922,170円
eMAXIS/PayPay証券 全世界バランス	79,555円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	3,489,091,306円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	4,178,574,896円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	1,155,848,245円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	5,427,990,015円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	1,728,849,024円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	92,114,851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)	144,479,885,098円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	9,180,661,130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)	11,451,227,590円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	3,469,324,585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)	295,924,315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)	11,348,307,716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)	984,215,803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)	11,787,587,372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)	6,863,880,285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)	241,840,068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)	65,859,100,330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)	484,154,116円
マルチアセット運用戦略ファンド(適格機関投資家限定)	828,248円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	2,485,373,732円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07(適格機関投資家限定)	275,037,850円
MUKAM バランスファンド2020-07(適格機関投資家限定)	2,468,142,125円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09(適格機関投資家限定)	271,318,100円
MUKAM バランスファンド2020-10(適格機関投資家限定)	2,455,813,499円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11(適格機関投資家限定)	271,402,571円
MUKAM バランスファンド2021-03(適格機関投資家限定)	2,173,229,942円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03(適格機関投資家限定)	271,281,132円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05(適格機関投資家限定)	272,241,941円
MUKAM バランスファンド2021-06(適格機関投資家限定)	2,233,271,601円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11(適格機関投資家限定)	270,807,832円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01(適格機関投資家限定)	277,720,836円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03(適格機関投資家限定)	291,655,171円

MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	301,089,600 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	309,002,920 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	310,226,910 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	310,178,316 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	310,160,990 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)	310,160,883 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定)	310,161,700 円
合計	324,414,680,830 円
2. 受益権の総数	324,414,680,830 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)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年9月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[2024年9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	1,445,652,180	—	1,441,695,582	△3,956,598
	カナダドル	61,599,480	—	61,919,234	319,754
	オーストラリアドル	124,598,430	—	125,460,379	861,949
	イギリスポンド	186,054,730	—	186,610,540	555,810
	ユーロ	831,463,900	—	835,651,177	4,187,277

売建				
アメリカドル	168,150,644,695	—	167,079,102,446	1,071,542,249
カナダドル	7,359,183,031	—	7,342,006,621	17,176,410
オーストラリアドル	4,871,304,682	—	4,904,467,597	△33,162,915
イギリスポンド	19,712,742,122	—	19,956,594,240	△243,852,118
シンガポールドル	1,601,276,750	—	1,613,014,485	△11,737,735
マレーシアリンギット	1,862,216,070	—	1,942,803,720	△80,587,650
ニュージーランドドル	926,007,550	—	931,963,825	△5,956,275
スウェーデンクローネ	568,018,523	—	570,551,753	△2,533,230
ノルウェークローネ	576,315,252	—	577,788,399	△1,473,147
デンマーククローネ	923,848,992	—	925,961,520	△2,112,528
メキシコペソ	2,573,422,764	—	2,635,972,719	△62,549,955
イスラエルシェケル	1,111,688,396	—	1,076,380,760	35,307,636
ポーランドズロチ	1,883,599,200	—	1,904,190,318	△20,591,118
中国元	40,039,675,286	—	40,023,952,566	15,722,720
ユーロ	109,123,927,115	—	109,384,211,078	△260,283,963
合計	363,933,239,148	—	363,520,298,959	416,876,573

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報)

	[2024年9月25日現在]
1口当たり純資産額	1.1326円
(1万口当たり純資産額)	(11,326円)

ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

[2024年9月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	43,154,272
コール・ローン	107,734,292
国債証券	6,871,673,806
派生商品評価勘定	116,740,275
未収入金	15,797,430
未収利息	74,280,746
前払費用	16,287,829
流動資産合計	7,245,668,650
資産合計	7,245,668,650
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,552,547
未払解約金	26,000,000
流動負債合計	27,552,547
負債合計	27,552,547
純資産の部	
元本等	
元本	7,584,764,545
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	△366,648,442
元本等合計	7,218,116,103
純資産合計	7,218,116,103
負債純資産合計	7,245,668,650

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年9月25日現在]
1. 期首	2024年3月26日
期首元本額	10,662,765,639円
期中追加設定元本額	1,991,705,158円
期中一部解約元本額	5,069,706,252円
元本の内訳※	
eMAXIS 新興国債券インデックス(為替ヘッジあり)	1,843,518,462円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	1,387,131,324円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	273,083,307円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07(適格機関投資家限定)	192,653,893円

MUKAM バランスファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	271,189,965 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	190,050,265 円
MUKAM バランスファンド2020-10 (適格機関投資家限定)	269,835,343 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	190,110,517 円
MUKAM バランスファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	238,786,149 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	190,002,827 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	190,675,753 円
MUKAM バランスファンド2021-06 (適格機関投資家限定)	242,196,065 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	189,671,232 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	194,513,176 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	204,288,097 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	210,891,605 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	216,419,132 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	217,892,602 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	217,968,562 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	217,965,620 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)	217,955,990 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定)	217,964,659 円
合計	7,584,764,545 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。	366,648,442 円
3. 受益権の総数	7,584,764,545 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)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年9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	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)
取引の時価等に関する事項
通貨関連

[2024年9月25日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカドル	7,121,795,390	—	7,006,607,662	115,187,728
合計		7,121,795,390	—	7,006,607,662	115,187,728

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報)

	[2024年9月25日現在]
1口当たり純資産額	0.9517円
(1万口当たり純資産額)	(9,517円)

2 【ファンドの現況】

【三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)】

【純資産額計算書】

2024年9月30日現在

(単位:円)

I 資産総額	15,866,776,069
II 負債総額	21,961,537
III 純資産総額 (I - II)	15,844,814,532
IV 発行済口数	13,888,829,866口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.1408

(10,000 口当たり)	(11,408)
---------------	----------

【三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)】

【純資産額計算書】

2024年9月30日現在

(単位：円)

I 資産総額	19,091,943,994
II 負債総額	30,239,458
III 純資産総額 (I - II)	19,061,704,536
IV 発行済口数	13,024,467,771口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.4635
(10,000 口当たり)	(14,635)

【三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)】

【純資産額計算書】

2024年9月30日現在

(単位：円)

I 資産総額	4,023,930,081
II 負債総額	3,243,883
III 純資産総額 (I - II)	4,020,686,198
IV 発行済口数	3,095,680,194口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.2988
(10,000 口当たり)	(12,988)

(参考)

TOPIXマザーファンド

純資産額計算書

2024年9月30日現在

(単位：円)

I 資産総額	1,513,389,157,904
II 負債総額	12,200,936,126
III 純資産総額 (I - II)	1,501,188,221,778
IV 発行済口数	457,441,055,792口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	3.2817
(10,000 口当たり)	(32,817)

外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年9月30日現在

(単位：円)

I 資産総額	6,262,298,821,900
II 負債総額	536,120,585
III 純資産総額 (I - II)	6,261,762,701,315
IV 発行済口数	883,659,088,900口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	7.0862
(10,000口当たり)	(70,862)

新興国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年9月30日現在

(単位：円)

I 資産総額	974,392,481,231
II 負債総額	2,407,719,694
III 純資産総額 (I - II)	971,984,761,537
IV 発行済口数	240,775,163,595口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	4.0369
(10,000口当たり)	(40,369)

国内債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年9月30日現在

(単位：円)

I 資産総額	296,405,220,012
II 負債総額	3,924,425,976
III 純資産総額 (I - II)	292,480,794,036
IV 発行済口数	319,086,728,441口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	0.9166
(10,000口当たり)	(9,166)

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年9月30日現在

(単位：円)

I 資産総額	367,490,868,164
II 負債総額	445,997,796
III 純資産総額 (I - II)	367,044,870,368
IV 発行済口数	324,454,967,307口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.1313
(10,000口当たり)	(11,313)

ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年9月30日現在

(単位：円)

I 資産総額	7,213,267,541
II 負債総額	2,181,461
III 純資産総額 (I - II)	7,211,086,080
IV 発行済口数	7,584,898,269口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	0.9507
(10,000口当たり)	(9,507)

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る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、解約代金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

2024年9月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

(2) 委託会社の機構

・ 会社の意思決定機構

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

・ 投資運用の意思決定機構

①投資環境見通しの策定

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

②運用戦略の決定

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

③運用計画の決定

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

④ポートフォリオの構築

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

⑤運用部門による自律的な運用管理

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

⑥管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署は、(a) 運用に関するパフォーマンス測定・分析のほか、(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ファンドに關係する法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に關係する法人については、その業務に關係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・管理に關する監督

内部監査担当部署は、運用、管理等に關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【事業の内容及び營業の概況】

「投資信託及び投資法人に關する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

2024年9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 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	823	36,526,770
追加型公社債投資信託	16	1,490,103
単位型株式投資信託	87	387,500
単位型公社債投資信託	45	102,963
合計	971	38,507,336

なお、純資産総額の金額については、百万円未満の端数を四捨五入して記載しておりますので、表中の個々の数字の合計と合計欄の数字とは一致しないことがあります。

3【委託会社等の経理状況】

(1) 財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJアセットマネジメント株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和 38 年大蔵省令第 59 号）」（以下「財務諸表等規則」という。）第 2 条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成 19 年内閣府令第 52 号）」に基づき作成しております。

なお、財務諸表に掲載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 39 期事業年度（自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年6月7日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山田 信之

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 田嶋 大士

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJアセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJアセットマネジメント株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)		第 39 期 (2024 年 3 月 31 日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	※2	51,733,041	※2	58,206,340
有価証券		1,579,691		15,283
前払費用		770,747		679,199
未収入金		81,854		138,388
未収委託者報酬		16,753,855		21,064,747
未収収益	※2	688,142	※2	1,485,701
金銭の信託		10,400,000		10,500,500
その他		745,576		371,400
流動資産合計		82,752,908		92,461,561
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	181,551	※1	2,936,036
器具備品	※1	730,357	※1	1,531,857
土地		628,433		628,433
建設仮勘定		1,111,177		45,140
有形固定資産合計		2,651,520		5,141,467
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		4,183,644		5,008,987
ソフトウェア仮勘定		1,907,739		1,587,548
無形固定資産合計		6,107,206		6,612,357
投資その他の資産				
投資有価証券		12,022,365		13,788,071
関係会社株式		159,536		159,536
投資不動産	※1	807,066	※1	1,788,120
長期差入保証金		689,492		689,867
前払年金費用		118,832		47,573
繰延税金資産		1,675,132		1,088,836
その他		45,230		45,230
貸倒引当金		△23,600		△23,600
投資その他の資産合計		15,494,056		17,583,636
固定資産合計		24,252,782		29,337,461
資産合計		107,005,691		121,799,022

(単位：千円)

	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)	第 39 期 (2024 年 3 月 31 日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	507, 559	807, 451
未払金		
未払収益分配金	114, 094	105, 550
未払償還金	7, 418	43, 553
未払手数料	※2 6, 139, 595	※2 7, 523, 485
その他未払金	※2 955, 697	※2 885, 002
未払費用	※2 5, 778, 896	※2 8, 611, 140
未払消費税等	439, 657	623, 219
未払法人税等	2, 375, 281	2, 235, 007
賞与引当金	849, 840	1, 182, 242
役員賞与引当金	154, 872	175, 992
その他	5, 517	12, 303
流動負債合計	17, 328, 431	22, 204, 949
固定負債		
退職給付引当金	1, 333, 882	1, 608, 101
役員退職慰労引当金	75, 667	30, 105
時効後支払損引当金	254, 296	250, 350
資産除去債務	-	1, 428, 586
その他	-	29, 109
固定負債合計	1, 663, 846	3, 346, 253
負債合計	18, 992, 277	25, 551, 202
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2, 000, 131	2, 000, 131
資本剰余金		
資本準備金	3, 572, 096	3, 572, 096
その他資本剰余金	41, 160, 616	41, 160, 616
資本剰余金合計	44, 732, 712	44, 732, 712
利益剰余金		
利益準備金	342, 589	342, 589
その他利益剰余金		
別途積立金	6, 998, 000	6, 998, 000
繰越利益剰余金	33, 267, 700	40, 236, 787
利益剰余金合計	40, 608, 289	47, 577, 377
株主資本合計	87, 341, 133	94, 310, 221

(単位：千円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)		第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)	
営業収益				
委託者報酬		84,121,445		98,635,342
投資顧問料		2,750,601		3,117,320
その他営業収益		10,412		148,442
営業収益合計		86,882,459		101,901,104
営業費用				
支払手数料	※4	31,461,274	※4	34,494,219
広告宣伝費		798,894		593,586
公告費		375		1,017
調査費				
調査費		2,849,042		3,537,103
委託調査費		19,236,505		27,296,058
事務委託費		1,751,807		1,861,577
営業雑経費				
通信費		113,480		137,737
印刷費		367,379		390,143
協会費		58,128		68,869
諸会費		18,447		20,108
事務機器関連費		2,238,382		2,531,009
その他営業雑経費		-		139,012
営業費用合計		58,893,717		71,070,444
一般管理費				
給料				
役員報酬		416,461		400,592
給料・手当		6,565,766		7,202,711
賞与引当金繰入		849,840		1,182,242
役員賞与引当金繰入		154,872		175,992
福利厚生費		1,279,885		1,424,215
交際費		8,942		10,054
旅費交通費		75,274		108,782
租税公課		403,955		397,138
不動産賃借料		719,707		728,550
退職給付費用		388,176		381,449
固定資産減価償却費		2,418,341		2,469,755
諸経費		444,313		490,104
一般管理費合計		13,725,534		14,971,590
営業利益		14,263,207		15,859,070

(単位：千円)

	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)		第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)	
営業外収益				
受取配当金		47,353		54,618
受取利息	※4	10,279	※4	12,836
投資有価証券償還益		609,102		204,527
収益分配金等時効完成分		94,351		17,722
受取賃貸料	※4	65,808	※4	162,111
その他		36,894		44,734
営業外収益合計		863,788		496,550
営業外費用				
投資有価証券償還損		32,995		234,700
時効後支払損引当金繰入		31,951		-
事務過誤費		2,680		10,822
賃貸関連費用		14,262		108,773
その他		32,394		25,903
営業外費用合計		114,284		380,199
経常利益		15,012,711		15,975,421
特別利益				
投資有価証券売却益		387,113		464,927
固定資産売却益		-	※1	16,229
資産除去債務履行差額		-		87,050
特別利益合計		387,113		568,207
特別損失				
投資有価証券売却損		15,828		57,011
投資有価証券評価損		104,554		31,651
固定資産除却損	※3	32,791	※3	20,246
固定資産売却損		-	※2	65,427
減損損失	※5	315,350		-
企業結合関連費用		-	※6	1,187,136
特別損失合計		468,524		1,361,473
税引前当期純利益		14,931,300		15,182,154
法人税、住民税及び事業税	※4	4,860,444	※4	4,542,085
法人税等調整額		△271,471		102,468
法人税等合計		4,588,973		4,644,553
当期純利益		10,342,327		10,537,601

(3) 【株主資本等変動計算書】

第38期（自2022年4月1日至2023年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

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

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	672,279	672,279	88,013,413
当期変動額			
企業結合による増加			1,602,526
剰余金の配当			△5,171,039
当期純利益			10,537,601
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	1,265,319	1,265,319	1,265,319
当期変動額合計	1,265,319	1,265,319	8,234,406
当期末残高	1,937,598	1,937,598	96,247,820

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	5年～50年
器具備品	2年～20年
投資不動産	3年～50年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

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

① 退職給付見込額の期間帰属方法

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

② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5) 役員退職慰労引当金

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

(6) 時効後支払損引当金

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

6. 収益及び費用の計上基準

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

(1) 委託者報酬

投資信託の信託約款に基づき信託財産の運用指図等を行っております。委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受領しております。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2) 投資顧問料

顧客との投資一任及び投資助言契約に基づき運用及び助言を行っております。投資顧問料は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を主に年4回受領しております。当該報酬は契約期間にわたり収益として認識しております。

7. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(貸借対照表関係)

※1. 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

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

※2. 関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

(損益計算書関係)

※1. 固定資産売却益の内訳

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

※2. 固定資産売却損の内訳

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

※3. 固定資産除却損の内訳

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

※4. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

※5. 減損損失

第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)

当社は、以下のとおり減損損失を計上しました。

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

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

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

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

第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)

当事業年度については、該当事項はありません。

※6. 企業結合関連費用

第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)

前事業年度については、該当事項はありません。

第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)

企業結合に伴うものであり、主にシステム統合費用などであります。

(株主資本等変動計算書関係)

第38期(自2022年4月1日至2023年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

2022年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

- ① 配当金の総額 6,075,125千円
- ② 1株当たり配当額 28,713円
- ③ 基準日 2022年3月31日
- ④ 効力発生日 2022年6月29日

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

2023年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

- ① 配当金の総額 5,171,039千円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1株当たり配当額 24,440円
- ④ 基準日 2023年3月31日
- ⑤ 効力発生日 2023年6月29日

第39期(自2023年4月1日至2024年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

2023年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

- ① 配当金の総額 5,171,039千円
- ② 1株当たり配当額 24,440円
- ③ 基準日 2023年3月31日
- ④ 効力発生日 2023年6月29日

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

2024年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

- ① 配当金の総額 45,747,620千円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1株当たり配当額 216,218円
- ④ 基準日 2024年3月31日
- ⑤ 効力発生日 2024年6月27日

(リース取引関係)

(借主側)

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)	第 39 期 (2024 年 3 月 31 日現在)
1 年内	962,809 千円	681,212 千円
1 年超	1,532,728 千円	851,515 千円
合計	2,495,537 千円	1,532,728 千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、金銭の信託（合同運用指定金銭信託）で運用し、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（(注2)参照）。

第 38 期(2023 年 3 月 31 日現在)

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

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

(注 2) 市場価格のない株式等

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

(注 3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

(注 4) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第 38 期(2023 年 3 月 31 日現在)

(単位：千円)

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

第39期(2024年3月31日現在)

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

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

(注2) 市場価格のない株式等

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

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

(注4) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第39期(2024年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	58,206,340	—	—	—
金銭の信託	10,500,500	—	—	—
未収委託者報酬	21,064,747	—	—	—
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	15,283	5,351,373	347,505	11,696
合計	89,786,871	5,351,373	347,505	11,696

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

- レベル1の時価： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価： 観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債
第38期(2023年3月31日現在)

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

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

ETF(上場投資信託)は相場価格を用いて評価しております。ETFは活発な市場で取引されているため、レベル1の時価に分類しております。

ETF(上場投資信託)以外の投資信託は基準価額を用いて評価しております。基準価額は観察可能なインプットを用いて算出しているため、レベル2の時価に分類しております。

金銭の信託

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

第39期(2024年3月31日現在)

区分	時価(千円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券	—	15,283	—	15,283
金銭の信託	—	10,500,500	—	10,500,500
投資有価証券	2,014,968	11,773,103	—	13,788,071
資産計	2,014,968	22,288,887	—	24,303,855

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

ETF(上場投資信託)は相場価格を用いて評価しております。ETFは活発な市場で取引されているため、レベル1の時価に分類しております。

ETF(上場投資信託)以外の投資信託は基準価額を用いて評価しております。基準価額は観察可能なインプットを用いて算出しているため、レベル2の時価に分類しております。

金銭の信託

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

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

2. その他有価証券

第38期(2023年3月31日現在)

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

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」(貸借対照表計上額は10,400,000千円、取得原価は10,400,000千円)を含めております。

第39期(2024年3月31日現在)

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

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」(貸借対照表計上額は10,500,500千円、取得原価は10,500,000千円)を含めております。

3. 売却したその他有価証券

第38期(自2022年4月1日至2023年3月31日)

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	17,240	—	14,120
債券	—	—	—
その他	1,551,405	387,113	1,708
合計	1,568,645	387,113	15,828

第39期(自2023年4月1日至2024年3月31日)

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	—	—	—
債券	—	—	—
その他	3,750,272	464,927	57,011
合計	3,750,272	464,927	57,011

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について 104,554 千円（その他有価証券のその他 104,554 千円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について 31,651 千円（その他有価証券のその他 31,651 千円）減損処理を行っております。

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度（積立型制度）及び退職一時金制度（非積立型制度）を設けております。また確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)	第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)
退職給付債務の期首残高	3,723,521 千円	3,582,778 千円
勤務費用	196,190	182,947
利息費用	25,925	39,626
数理計算上の差異の 発生額	△186,130	△79,379
退職給付の支払額	△176,727	△300,286
過去勤務費用の発生額	—	—
企業結合による影響額	—	226,499
退職給付債務の期末残高	3,582,778	3,652,185

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(注) 「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額及び退職金です。「退職給付制度の統合に係る調整額」は企業結合関連費用の一部として特別損失に計上しております。

(5) 年金資産に関する事項

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

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 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)	第 39 期 (2024 年 3 月 31 日現在)
割引率	0.066～1.13%	1.39～1.41%
長期期待運用収益率	1.5～1.8%	1.5～1.8%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度 152,084 千円、当事業年度 164,524 千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
第 38 期（2023 年 3 月 31 日現在）及び第 39 期（2024 年 3 月 31 日現在）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差が法定実効税率の 100 分の 5 以下であるため注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第 42 号 2021 年 8 月 12 日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（企業結合等関係）

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

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

1. 取引の概要

(1) 被取得企業の名称及びその事業の内容

被取得企業の名称 三菱UFJ不動産投資顧問株式会社

事業の内容 投資顧問業、私募投資信託の設定・運用等

(2) 企業結合日

2023 年 10 月 1 日

(3) 企業結合の法的形式

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

(4) 結合後企業の名称

分割会社：三菱UFJ不動産投資顧問株式会社

承継会社：三菱UFJアセットマネジメント株式会社

(5) 企業結合を行った主な理由

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

2. 会計処理の概要

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

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

建物の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3. 当該資産除去債務の総額の増減

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

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

収益及び契約から生じるキャッシュ・フローの性質、金額、時期及び不確実性に影響を及ぼす主要な要因に基づく区分に当該収益を分解した情報については、重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

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

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注 5)	科目	期末残高(注 5)
親会社	㈱三菱 UFJ フィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513 百万円	銀行持株会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税等	連結納税等に伴う支払(注 1)	3,947,200 千円	その他未払金	77,007 千円
親会社	三菱 UFJ 信託銀行㈱	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注 2)	4,893,312 千円	未払手数料	790,279 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料(注 3)	463,416 千円	未払費用	253,093 千円

第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注 5)	科目	期末残高(注 5)
親会社	㈱三菱 UFJ フィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513 百万円	銀行持株会社業	被所有 間接 100.0%	グループ通算制度	グループ通算制度に伴う通算税効果額(注 4)	132,303 千円	その他未払金	105,407 千円
親会社	三菱 UFJ 信託銀行㈱	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注 2)	5,006,309 千円	未払手数料	886,173 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料(注 3)	463,831 千円	未払費用	260,800 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等
第38期(自2022年4月1日至2023年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注2)	科目	期末残高(注2)
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	4,052,979 千円	未払手数料	868,785 千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	6,661,991 千円	未払手数料	1,218,051 千円

第39期(自2023年4月1日至2024年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注2)	科目	期末残高(注2)
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	4,354,007 千円	未払手数料	1,028,586 千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	7,493,449 千円	未払手数料	1,449,414 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注)1. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。
2. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

2. 親会社に関する注記

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

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
1株当たり純資産額	415,979.76円	454,898.22円
1株当たり当期純利益金額	48,881.17円	49,804.10円

（注）1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
当期純利益金額（千円）	10,342,327	10,537,601
普通株主に帰属しない金額（千円）	—	—
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	10,342,327	10,537,601
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581	211,581

4【利害関係人との取引制限】

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

- 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通常の見積り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。

約款

追加型証券投資信託

三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）

約 款

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）

運用の基本方針

約款第19条の規定に基づき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の成長と収益の確保をめざして運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

- ① TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざします。
- ② 株式の実質組入比率は、株式組入れを比較的抑えつつ、相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。
- ③ 債券の実質組入比率は、原則として、先進国債券を一定の比率とし、残りの部分は国内債券等を組入れます。
- ④ 国内外の債券市場が下落した場合等に債券の実質組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等の組入れを行う場合があります。
- ⑤ マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。
- ⑥ 実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ⑦ 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。

(3) 投資制限

- ① 株式への実質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実質投資割合は、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（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、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実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤ 外貨建資産への実質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 スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑧ 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。
- ⑨ 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。

3. 収益分配方針

毎計算期末に、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、委託者が基準価額水準、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つた利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

追加型証券投資信託
『三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）』約款

(信託の種類、委託者および受託者)

第1条 この信託は、証券投資信託であり、三菱UFJアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とします。

② この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

(信託事務の委託)

第2条 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

② 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

(信託の目的および金額)

第3条 委託者は、金500億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第5条 この信託の期間は、信託契約締結日から2028年3月24日まで、または第47条第8項、第48条第1項、第49条第1項、第50条第1項および第52条第2項の規定による信託期間終了日までとします。

(受益権の取得申込みの勧誘の種類)

第6条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

(当初の受益者)

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第8条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

(受益権の分割および再分割)

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については500億口を上限として、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じて得た額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第28条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除して得た金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受

益権総口数で除して得た金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、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って計算します。

- ③ 第30条に規定する予約為替の評価は、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るものとします。

（信託日時異なる受益権の内容）

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第11条 この信託のすべての受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り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り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、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、委託者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、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

- ③ 委託者は、第8条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

第12条 受託者は、第3条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

（受益権の申込単位および価額）

第13条 委託者の指定する第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第8条第1項の規定により分割される受益権について、その取得申込者に対し、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の定める単位をもって取得申込みに応じることができます。ただし、取得申込者が委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関と別に定める累積投資契約約款に基づく契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結している場合に限り、1口の整数倍をもって取得申込みに応じることができます。

- ② 委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、別に定める日には、前項による受益権の取得申込みに応じないものとします。

- ③ 委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）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、第1項による受益権の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できます。

- ④ 委託者は、前2項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の追加信託金の申込みについては、これを受け付けるものとします。
- ⑤ 第1項の場合の受益権の価額は、取得申込みを受け付けた日の翌営業日の基準価額に、手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、取得日が信託契約締結日である場合の受益権の価額は、1口につき1円に手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑥ 前項の手数料の額は、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関がそれぞれ定めるものとします。
- ⑦ 第5項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、第39条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑧ 第1項の取得申込者は委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該取得申込みの代金（第5項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

第14条 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 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項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 委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者が必要と認める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。

（受益権の譲渡の対抗要件）

第15条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

（投資の対象とする資産の種類等）

第16条 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、約款第22条から第24条までに定めるものに限ります。）

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 デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。）については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相

場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。

- ③ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(投資の対象とする有価証券等)

第17条 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者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とするTOPIXマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンド、国内債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンド（以下これらを総称して「マザーファンド」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券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号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。次号において同じ。）で次号で定めるもの以外のもの
16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下本号において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）

19. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
21. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
22. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
24. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいい、前各号に該当するものを除きます。）
25. 外国の者に対する権利で前2号の有価証券の性質を有するもの

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

- ② 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（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。）により運用することを指図することができます。

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. 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、前各号に該当するものを除きます。）
7. 投資事業有限責任組合契約に基づく権利（金融商品取引法第2条第2項第5号に該当するものをいいます。）
8. 外国の者に対する権利で前3号の権利の性質を有するもの

- ③ 委託者は、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。

- ④ 前項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。

- ⑤ 委託者は、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。以下本項および次項において同じ。）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。

- ⑥ 前項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。

（利害関係人等との取引等）

第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、

信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項、次項および第31条において同じ。）、第31条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条第1項ならびに前条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条、第26条から第28条、第30条、第34条から第36条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

- ② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条第1項ならびに前条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条、第26条から第28条、第30条、第34条から第36条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。
- ④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

（運用の基本方針）

第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

（投資する株式等の範囲）

第20条 委託者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。

- ② 前項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者が投資することを指図することができます。
- ③ この信託およびマザーファンド（モルガン・スタンレー株式について、委託者が議決権行使権限を委託する、または、議決権行使助言（推奨）にしたがって、当該推奨通りに議決権を行使している場合に限り。）において投資するモルガン・スタンレー株式については、委託者及び受託者が合意の上、委託者が適切な能力を有すると判断した独立した議決権行使助言会社に、当該株式にかかる議決権行使権限を委託するか、または、当該議決権行使助言会社による議決権行使助言（推奨）にしたがって、当該推奨通りに議決権を行使します。
- ④ 前項の議決権行使権限の委託または助言（推奨）どおりの議決権行使を停止しようとする場合は、第53条第2項から第6項の規定を準用することとし、必要な技術的読替えは委託者と受託者の協議にて定めます。

（信用取引の指図範囲）

第21条 委託者は、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。

② 前項の信用取引の指図は、次の各号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、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（第25条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（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

（先物取引等の運用指図）

第22条 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。

② 委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

③ 委託者は、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

（スワップ取引の運用指図）

第23条 委託者は、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。

② 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、原則として第5条に規定する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。

③ 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。

④ 委託者は、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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）

第24条 委託者は、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。

② 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、原則として第5条に規定する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。

③ 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。

④ 委託者は、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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

（同一銘柄の転換社債等への投資制限）

第25条 委託者は、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（こ

の信託約款において、新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。)の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。

- ② 前項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。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第26条 委託者は、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各号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。
- ② 前項各号に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。
- ③ 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

(有価証券の空売りの指図範囲)

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または第28条の規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- ② 前項の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

(有価証券の借入れ)

第28条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- ② 前項の指図は、当該借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- ④ 第1項の借入れに係る品借料は、信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第29条 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。

(外国為替予約取引の指図および範囲)

第30条 委託者は、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。

- ② 前項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。

- ③ 前項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。
- ④ 第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、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。

（信託業務の委託等）

第31条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存に係る業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
 4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

（混蔵寄託）

第32条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこれに類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できます。

（信託財産の登記等および記載等の留保等）

第33条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(有価証券売却等の指図)

第34条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約、有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第35条 委託者は、前条の規定による一部解約金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(資金の借入れ)

第36条 委託者は、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。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

(損益の帰属)

第37条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金立替え)

第38条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株主割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第39条 この信託の計算期間は、毎年3月26日から翌年3月25日までとすることを原則とします。

- ② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、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。ただし、第1計算期間は2013年10月25日から2014年3月25日までとし、最終計算期間の終了日は第5条に規定するこの信託の信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告等)

第40条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。
- ③ 受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。
- ④ 受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に

欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

⑤ 受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできないものとします。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

(信託事務の諸費用および監査報酬)

第41条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

② 信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額は、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。

(信託報酬等)

第42条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第39条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の85の率を乗じて得た額とします。

② 前項の信託報酬は、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するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(収益の分配)

第43条 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責)

第44条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除して得た額をいいます。以下同じ。）については第45条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第47条第3項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第45条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責を負わないものとします。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第45条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代

金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関に交付されます。この場合、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該収益分配金をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者毎に当該収益分配金の再投資に係る受益権の取得申込みに応じたものとし、当該取得申込みに応じるにより増加した受益権は第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ④ 一部解約金は、第47条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6営業日目から当該受益者に支払います。
- ⑤ 前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の営業所等において行うものとし、
- ⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、

(収益分配金および償還金の時効)

第46条 受益者が、収益分配金については前条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(信託契約の一部解約)

第47条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関が定める単位をもって、委託者に一部解約の実行を請求することができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ③ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求を受け付けた日の翌営業日の基準価額とします。
- ④ 受益者が第1項の一部解約の実行の請求をするときは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行うものとし、
- ⑤ 委託者は別に定める日には、第1項に規定する一部解約の実行の請求を受け付けないものとし、

- ⑥ 委託者は、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、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことができます。
- ⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、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一部解約の実行の請求を受け付けたものとして第3項の規定に準じて計算された価額とします。
- ⑧ 委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ⑨ 委託者は、前項の規定に基づいてこの信託契約を解約しようとするときは、第48条第2項から第5項の規定にしたがいます。

(信託契約の解約)

第48条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために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は、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができるものとし、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「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信託契約の解約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、この信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）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、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④ 第2項の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ⑤ 第2項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この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には適用しません。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、第2項から前項までの手続を行うことが困難な場合も同じく適用しません。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第49条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第53条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第50条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第53条第2項に規定する書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第51条 委託者は、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。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第52条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第53条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更等)

第53条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- ② 委託者は、前項の変更または併合（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、「重大な約款の変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更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、この信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④ 第2項の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以上に当たる多数をもって行います。
- ⑤ 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑥ 第2項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款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には適用しません。
- ⑦ 前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合に係る一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

(反対者の買取請求権)

第54条 第48条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託者に対し、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。

- ② 前項の規定は、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、委託者が第47条の規定に基づいて信託契約の一部の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。

(信託期間の延長)

第55条 委託者は、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るときは、受託者と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第55条の2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、当該運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

(公告)

第56条 委託者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/>

② 前項の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。

(質権口記載または記録の受益権の取扱い)

第57条 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、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第58条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(附則)

第1条 この約款において「累積投資契約」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関が締結する「累積投資契約」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資契約」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第45条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

第3条 第24条に規定する「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第4条 第24条に規定する「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金

額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

信託契約締結日 2013年10月25日

(附表)

1. 約款第13条第2項および第47条第5項に規定する「別に定める日」とは、次のものをいいます。

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

追加型証券投資信託

三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）

約 款

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）

運用の基本方針

約款第19条の規定に基づき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の成長と収益の確保をめざして運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

- ① TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざします。
- ② 株式の実質組入比率は、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。
- ③ 債券の実質組入比率は、株式の実質組入比率に応じて先進国債券の組入比率を決定し、残りの部分は国内債券等を組入れます。
- ④ 国内外の債券市場が下落した場合等に債券の実質組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等の組入れを行う場合があります。
- ⑤ マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。
- ⑥ 実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ⑦ 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。

(3) 投資制限

- ① 株式への実質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実質投資割合は、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（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、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実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤ 外貨建資産への実質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 スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑧ 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。
- ⑨ 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。

3. 収益分配方針

毎計算期末に、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、委託者が基準価額水準、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、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

追加型証券投資信託
『三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）』約款

(信託の種類、委託者および受託者)

第1条 この信託は、証券投資信託であり、三菱UFJアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とします。

② この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

(信託事務の委託)

第2条 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

② 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

(信託の目的および金額)

第3条 委託者は、金500億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第5条 この信託の期間は、信託契約締結日から2028年3月24日まで、または第47条第8項、第48条第1項、第49条第1項、第50条第1項および第52条第2項の規定による信託期間終了日までとします。

(受益権の取得申込みの勧誘の種類)

第6条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

(当初の受益者)

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第8条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

(受益権の分割および再分割)

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については500億口を上限として、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じて得た額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第28条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除して得た金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受

益権総口数で除して得た金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、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って計算します。

- ③ 第30条に規定する予約為替の評価は、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るものとします。

（信託日時異なる受益権の内容）

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第11条 この信託のすべての受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り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り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、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、委託者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、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

- ③ 委託者は、第8条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

第12条 受託者は、第3条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

（受益権の申込単位および価額）

第13条 委託者の指定する第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第8条第1項の規定により分割される受益権について、その取得申込者に対し、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の定める単位をもって取得申込みに応じることができます。ただし、取得申込者が委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関と別に定める累積投資契約約款に基づく契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結している場合に限り、1口の整数倍をもって取得申込みに応じることができます。

- ② 委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、別に定める日には、前項による受益権の取得申込みに応じないものとします。

- ③ 委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）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、第1項による受益権の取得申込みの受付け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けを取り消すことができます。

- ④ 委託者は、前2項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の追加信託金の申込みについては、これを受け付けるものとします。
- ⑤ 第1項の場合の受益権の価額は、取得申込みを受け付けた日の翌営業日の基準価額に、手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、取得日が信託契約締結日である場合の受益権の価額は、1口につき1円に手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑥ 前項の手数料の額は、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関がそれぞれ定めるものとします。
- ⑦ 第5項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、第39条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑧ 第1項の取得申込者は委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該取得申込みの代金（第5項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

第14条 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 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項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 委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者が必要と認める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。

（受益権の譲渡の対抗要件）

第15条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

（投資の対象とする資産の種類等）

第16条 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、約款第22条から第24条までに定めるものに限ります。）

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 デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。）については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相

場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。

- ③ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(投資の対象とする有価証券等)

第17条 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者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とするTOPIXマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンド、国内債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンド（以下これらを総称して「マザーファンド」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券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号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。次号において同じ。）で次号で定めるもの以外のもの
16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下本号において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）

19. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
21. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
22. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
24. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいい、前各号に該当するものを除きます。）
25. 外国の者に対する権利で前2号の有価証券の性質を有するもの

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

- ② 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（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。）により運用することを指図することができます。

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. 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、前各号に該当するものを除きます。）
7. 投資事業有限責任組合契約に基づく権利（金融商品取引法第2条第2項第5号に該当するものをいいます。）
8. 外国の者に対する権利で前3号の権利の性質を有するもの

- ③ 委託者は、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。

- ④ 前項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。

- ⑤ 委託者は、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。以下本項および次項において同じ。）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。

- ⑥ 前項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。

（利害関係人等との取引等）

第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、

信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項、次項および第31条において同じ。）、第31条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条第1項ならびに前条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条、第26条から第28条、第30条、第34条から第36条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

- ② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条第1項ならびに前条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条、第26条から第28条、第30条、第34条から第36条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。
- ④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

（運用の基本方針）

第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

（投資する株式等の範囲）

第20条 委託者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。

- ② 前項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者が投資することを指図することができます。
- ③ この信託およびマザーファンド（モルガン・スタンレー株式について、委託者が議決権行使権限を委託する、または、議決権行使助言（推奨）にしたがって、当該推奨通りに議決権を行使している場合に限り。）において投資するモルガン・スタンレー株式については、委託者及び受託者が合意の上、委託者が適切な能力を有すると判断した独立した議決権行使助言会社に、当該株式にかかる議決権行使権限を委託するか、または、当該議決権行使助言会社による議決権行使助言（推奨）にしたがって、当該推奨通りに議決権を行使します。
- ④ 前項の議決権行使権限の委託または助言（推奨）どおりの議決権行使を停止しようとする場合は、第53条第2項から第6項の規定を準用することとし、必要な技術的読替えは委託者と受託者の協議にて定めます。

（信用取引の指図範囲）

第21条 委託者は、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。

② 前項の信用取引の指図は、次の各号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、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（第25条に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り。）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債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（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

（先物取引等の運用指図）

第22条 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。

② 委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

③ 委託者は、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

（スワップ取引の運用指図）

第23条 委託者は、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。

② 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、原則として第5条に規定する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。

③ 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。

④ 委託者は、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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）

第24条 委託者は、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。

② 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、原則として第5条に規定する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。

③ 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。

④ 委託者は、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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

（同一銘柄の転換社債等への投資制限）

第25条 委託者は、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（こ

の信託約款において、新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。)の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。

- ② 前項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。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第26条 委託者は、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各号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。
- ② 前項各号に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。
- ③ 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

(有価証券の空売りの指図範囲)

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または第28条の規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- ② 前項の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

(有価証券の借入れ)

第28条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- ② 前項の指図は、当該借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- ④ 第1項の借入れに係る品借料は、信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第29条 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。

(外国為替予約取引の指図および範囲)

第30条 委託者は、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。

- ② 前項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。

- ③ 前項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。
- ④ 第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、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。

（信託業務の委託等）

第31条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存に係る業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
 4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

（混蔵寄託）

第32条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこれに類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できます。

（信託財産の登記等および記載等の留保等）

第33条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(有価証券売却等の指図)

第34条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約、有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第35条 委託者は、前条の規定による一部解約金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(資金の借入れ)

第36条 委託者は、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。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

(損益の帰属)

第37条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金立替え)

第38条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株主割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第39条 この信託の計算期間は、毎年3月26日から翌年3月25日までとすることを原則とします。

- ② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、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。ただし、第1計算期間は2013年10月25日から2014年3月25日までとし、最終計算期間の終了日は第5条に規定するこの信託の信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告等)

第40条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。
- ③ 受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。
- ④ 受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に

欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

⑤ 受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできないものとします。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

(信託事務の諸費用および監査報酬)

第41条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

② 信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額は、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。

(信託報酬等)

第42条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第39条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の130の率を乗じて得た額とします。

② 前項の信託報酬は、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するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(収益の分配)

第43条 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責)

第44条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除して得た額をいいます。以下同じ。）については第45条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第47条第3項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第45条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責を負わないものとします。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第45条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代

金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関に交付されます。この場合、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該収益分配金をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者毎に当該収益分配金の再投資に係る受益権の取得申込みに応じたものとし、当該取得申込みに応じることにより増加した受益権は第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ④ 一部解約金は、第47条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6営業日目から当該受益者に支払います。
- ⑤ 前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の営業所等において行うものとし、
- ⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、

(収益分配金および償還金の時効)

第46条 受益者が、収益分配金については前条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(信託契約の一部解約)

第47条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関が定める単位をもって、委託者に一部解約の実行を請求することができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ③ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求を受け付けた日の翌営業日の基準価額とします。
- ④ 受益者が第1項の一部解約の実行の請求をするときは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行うものとし、
- ⑤ 委託者は別に定める日には、第1項に規定する一部解約の実行の請求を受け付けないものとし、

- ⑥ 委託者は、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、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことができます。
- ⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、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一部解約の実行の請求を受け付けたものとして第3項の規定に準じて計算された価額とします。
- ⑧ 委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ⑨ 委託者は、前項の規定に基づいてこの信託契約を解約しようとするときは、第48条第2項から第5項の規定にしたがいます。

(信託契約の解約)

第48条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために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は、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができるものとし、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「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信託契約の解約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、この信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）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、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④ 第2項の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ⑤ 第2項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この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には適用しません。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、第2項から前項までの手続を行うことが困難な場合も同じく適用しません。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第49条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第53条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第50条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第53条第2項に規定する書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第51条 委託者は、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。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第52条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第53条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更等)

第53条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- ② 委託者は、前項の変更または併合（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、「重大な約款の変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更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、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④ 第2項の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以上に当たる多数をもって行います。
- ⑤ 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑥ 第2項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款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には適用しません。
- ⑦ 前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合に係る一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

(反対者の買取請求権)

第54条 第48条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託者に対し、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。

- ② 前項の規定は、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、委託者が第47条の規定に基づいて信託契約の一部の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。

(信託期間の延長)

第55条 委託者は、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るときは、受託者と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第55条の2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、当該運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

(公告)

第56条 委託者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/>

② 前項の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。

(質権口記載または記録の受益権の取扱い)

第57条 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、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第58条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(附則)

第1条 この約款において「累積投資契約」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関が締結する「累積投資契約」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資契約」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第45条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

第3条 第24条に規定する「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第4条 第24条に規定する「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金

額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

信託契約締結日 2013年10月25日

(附表)

1. 約款第13条第2項および第47条第5項に規定する「別に定める日」とは、次のものをいいます。

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

追加型証券投資信託

三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）

約 款

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）

運用の基本方針

約款第19条の規定に基づき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の成長と収益の確保をめざして運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

- ① TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざします。
- ② 株式の実質組入比率は、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。
- ③ 債券の実質組入比率は、原則として、国内債券、先進国債券および新興国債券を均等とします。
- ④ 国内外の債券市場が下落した場合等に債券への実質組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等の組入れを行う場合があります。
- ⑤ マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。
- ⑥ 実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ⑦ 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。

(3) 投資制限

- ① 株式への実質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実質投資割合は、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（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、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実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤ 外貨建資産への実質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 スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑧ 金利先渡し取引および為替先渡し取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑨ 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。

3. 収益分配方針

毎計算期末に、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、委託者が基準価額水準、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、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

追加型証券投資信託
『三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）』約款

(信託の種類、委託者および受託者)

第1条 この信託は、証券投資信託であり、三菱UFJアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とします。

② この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

(信託事務の委託)

第2条 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

② 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

(信託の目的および金額)

第3条 委託者は、金500億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第5条 この信託の期間は、信託契約締結日から2028年3月24日まで、または第47条第8項、第48条第1項、第49条第1項、第50条第1項および第52条第2項の規定による信託期間終了日までとします。

(受益権の取得申込みの勧誘の種類)

第6条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

(当初の受益者)

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第8条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

(受益権の分割および再分割)

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については500億口を上限として、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じて得た額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第28条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除して得た金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受

益権総口数で除して得た金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、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って計算します。

- ③ 第30条に規定する予約為替の評価は、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るものとします。

（信託日時異なる受益権の内容）

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第11条 この信託のすべての受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り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り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、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、委託者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、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

- ③ 委託者は、第8条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

第12条 受託者は、第3条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

（受益権の申込単位および価額）

第13条 委託者の指定する第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第8条第1項の規定により分割される受益権について、その取得申込者に対し、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の定める単位をもって取得申込みに応じることができます。ただし、取得申込者が委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関と別に定める累積投資契約約款に基づく契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結している場合に限り、1口の整数倍をもって取得申込みに応じることができます。

- ② 委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、別に定める日には、前項による受益権の取得申込みに応じないものとします。

- ③ 委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは

は流動性の極端な減少等)があるときは、第1項による受益権の取得申込みの受け付け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け付けを取り消すことができます。

- ④ 委託者は、前2項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の追加信託金の申込みについては、これを受け付けるものとします。
- ⑤ 第1項の場合の受益権の価額は、取得申込みを受け付けた日の翌営業日の基準価額に、手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額を加算した価額とします。ただし、取得日が信託契約締結日である場合の受益権の価額は、1口につき1円に手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑥ 前項の手数料の額は、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関がそれぞれ定めるものとします。
- ⑦ 第5項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、第39条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑧ 第1項の取得申込者は委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該取得申込みの代金(第5項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。)の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

(受益権の譲渡に係る記載または記録)

第14条 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 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項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 委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者が必要と認める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。

(受益権の譲渡の対抗要件)

第15条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

(投資の対象とする資産の種類等)

第16条 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、約款第22条から第24条までに定めるものに限ります。)
 - 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 デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。）については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。
- ③ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

（投資の対象とする有価証券等）

第17条 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者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とするTOPIXマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンド、新興国株式インデックスマザーファンド、国内債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンド（以下これらを総称して「マザーファンド」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券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号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。次号において同じ。）で次号で定めるもの以外のもの
16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下本号において同じ。）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

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。）

19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

24. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいい、前各号に該当するものを除きます。）

25. 外国の者に対する権利で前2号の有価証券の性質を有するもの

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

② 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（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）により運用することを指図することができます。

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. 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、前各号に該当するものを除きます。）

7. 投資事業有限責任組合契約に基づく権利（金融商品取引法第2条第2項第5号に該当するものをいいます。）

8. 外国の者に対する権利で前3号の権利の性質を有するもの

③ 委託者は、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。

④ 前項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。

⑤ 委託者は、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。以下本項および次項において同じ。）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。

⑥ 前項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。

(利害関係人等との取引等)

第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項、次項および第31条において同じ。）、第31条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条第1項ならびに前条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条、第26条から第28条、第30条、第34条から第36条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

- ② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条第1項ならびに前条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条、第26条から第28条、第30条、第34条から第36条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。
- ④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

(運用の基本方針)

第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

(投資する株式等の範囲)

第20条 委託者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。

- ② 前項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者が投資することを指図することができます。
- ③ この信託およびマザーファンド（モルガン・スタンレー株式会社について、委託者が議決権行使権限を委託する、または、議決権行使助言（推奨）にしたがって、当該推奨通りに議決権を行使している場合に限り。）において投資するモルガン・スタンレー株式会社については、委託者及び受託者が合意の上、委託者が適切な能力を有すると判断した独立した議決権行使助言会社に、当該株式にかかる議決権行使権限を委託するか、または、当該議決権行使助言会社による議決権行使助言（推奨）にしたがって、当該推奨通りに議決権を行使します。
- ④ 前項の議決権行使権限の委託または助言（推奨）どおりの議決権行使を停止しようとする場合は、第53条第2項から第6項の規定を準用することとし、必要な技術的読替えは委託者と受託者の協議にて定めます。

(信用取引の指図範囲)

第21条 委託者は、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。

② 前項の信用取引の指図は、次の各号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、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（第25条に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

（先物取引等の運用指図）

第22条 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。

② 委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

③ 委託者は、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

（スワップ取引の運用指図）

第23条 委託者は、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。

② 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、原則として第5条に規定する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。

③ 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。

④ 委託者は、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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）

第24条 委託者は、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。

② 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、原則として第5条に規定する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。

③ 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。

④ 委託者は、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。

(同一銘柄の転換社債等への投資制限)

第25条 委託者は、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(この信託約款において、新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。)の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。

- ② 前項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。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第26条 委託者は、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各号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。

- ② 前項各号に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。

- ③ 委託者は、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。

(有価証券の空売りの指図範囲)

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または第28条の規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- ② 前項の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

(有価証券の借入れ)

第28条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- ② 前項の指図は、当該借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

- ④ 第1項の借入れに係る品借料は、信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第29条 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。

(外国為替予約取引の指図および範囲)

第30条 委託者は、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。

② 前項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。

③ 前項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。

④ 第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、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。

（信託業務の委託等）

第31条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

1. 信託財産の保存に係る業務
2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

（混蔵寄託）

第32条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこれに類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できます。

（信託財産の登記等および記載等の留保等）

第33条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方

法により分別して管理することがあります。

- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

（有価証券売却等の指図）

第34条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約、有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第35条 委託者は、前条の規定による一部解約金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第36条 委託者は、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。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

（損益の帰属）

第37条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

（受託者による資金立替え）

第38条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株主割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

（信託の計算期間）

第39条 この信託の計算期間は、毎年3月26日から翌年3月25日までとすることを原則とします。

- ② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、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。ただし、第1計算期間は2013年10月25日から2014年3月25日までとし、最終計算期間の終了日は第5条に規定するこの信託の信託期間の終了日とします。

（信託財産に関する報告等）

第40条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ③ 受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。
- ④ 受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。
- ⑤ 受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできないものとします。
 1. 他の受益者の氏名または名称および住所
 2. 他の受益者が有する受益権の内容

(信託事務の諸費用および監査報酬)

第41条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ② 信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額は、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。

(信託報酬等)

第42条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第39条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の130の率を乗じて得た額とします。

- ② 前項の信託報酬は、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するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。
- ③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(収益の分配)

第43条 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

- ② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責)

第44条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除して得た額をいいます。以下同じ。）については第45条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第47条第3項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第45条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責を負わないものとします。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第45条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間

の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関に交付されます。この場合、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該収益分配金をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者毎に当該収益分配金の再投資に係る受益権の取得申込みに応じたものとして、当該取得申込みに応じることにより増加した受益権は第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ④ 一部解約金は、第47条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6営業日目から当該受益者に支払います。
- ⑤ 前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の営業所等において行うものとしてします。
- ⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとしてします。

（収益分配金および償還金の時効）

第46条 受益者が、収益分配金については前条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（信託契約の一部解約）

第47条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関が定める単位をもって、委託者に一部解約の実行を請求することができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ③ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求を受け付けた日の翌営業日の基準価額とします。
- ④ 受益者が第1項の一部解約の実行の請求をするときは、委託者の指定する第一種金融商

品取引業者または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行うものとします。

- ⑤ 委託者は別に定める日には、第1項に規定する一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
- ⑥ 委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことができます。
- ⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、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一部解約の実行の請求を受け付けたものとして第3項の規定に準じて計算された価額とします。
- ⑧ 委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ⑨ 委託者は、前項の規定に基づいてこの信託契約を解約しようとするときは、第48条第2項から第5項の規定にしたがいます。

（信託契約の解約）

第48条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために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は、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができるものとし、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「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信託契約の解約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、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④ 第2項の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以上に当たる多数をもって行います。
- ⑤ 第2項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この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には適用しません。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、第2項から前項までの手続を行うことが困難な場合も同じく適用しません。

（信託契約に関する監督官庁の命令）

第49条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第53条の規定にしたがいます。

（委託者の登録取消等に伴う取扱い）

第50条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止した

ときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第53条第2項に規定する書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第51条 委託者は、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。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第52条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第53条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更等)

第53条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- ② 委託者は、前項の変更または併合（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、「重大な約款の変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更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、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- ④ 第2項の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以上に当たる多数をもって行います。

- ⑤ 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

- ⑥ 第2項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款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には適用しません。

- ⑦ 前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合に係る一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

(反対者の買取請求権)

第54条 第48条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行う場合

には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託者に対し、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。

- ② 前項の規定は、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、委託者が第47条の規定に基づいて信託契約の一部の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。

(信託期間の延長)

第55条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第55条の2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、当該運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

(公告)

第56条 委託者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/>

- ② 前項の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。

(質権口記載または記録の受益権の取扱い)

第57条 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、一部解約の実行の請求の受け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしがって取り扱われます。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第58条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(附則)

第1条 この約款において「累積投資契約」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関が締結する「累積投資契約」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資契約」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第45条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

第3条 第24条に規定する「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第4条 第24条に規定する「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満

期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

信託契約締結日 2013年10月25日

(附表)

1. 約款第13条第2項および第47条第5項に規定する「別に定める日」とは、次のものをいいます。

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

 **MUFG** 三菱UFJアセットマネジメント