

投資信託説明書 (請求目論見書)

使用開始日 2024.10.26

eMAXIS 最適化バランス

(マイゴールキーパー)
(マイディフェンダー)
(マイミッドフィルダー)
(マイフォワード)
(マイストライカー)

追加型投信／内外／資産複合／インデックス型

ファンドは、NISAの成長投資枠およびつみたて投資枠の対象です。
※販売会社により取扱いが異なる場合があります。くわしくは、販売会社にご確認ください。

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.am.mufg.jp/>

この目論見書により行う「eMAXIS 最適化バランス」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4月25日に関東財務局長に提出しており、2024年4月26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】	2
（6）【申込単位】	2
（7）【申込期間】	2
（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】	79
第3【ファンドの経理状況】	87
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	444
第三部【委託会社等の情報】	445
第1【委託会社等の概況】	445
約款	476

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

- eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)
- eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)
- eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)
- eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)
- eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)

(以上を総称して、あるいは個別に「ファンド」といいます。)

なお、ファンドの名称について、正式名称ではなく略称または総称で記載する場合があります。

正式名称	略称	総称
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	マイゴールキーパー	eMAXIS 最適化バランス
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	マイディフェンダー	
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	マイミッドフィルダー	
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	マイフォワード	
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	マイストライカー	

(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/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.am.mufg.jp/>

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

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

販売会社が定める単位

申込単位は販売会社にご確認ください。

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては、1円以上1円単位とします。

(7) 【申込期間】

2024年4月26日から2025年4月25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。

販売会社によっては、確定拠出年金制度を利用する場合の申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認ください。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

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

(9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

(11) 【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

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】

ファンドは、最適化バランス指数に連動する投資成果をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、各ファンドについて、5,000億円です。

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

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (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		
追加型	内外	不動産投信	MR F	特殊型 ()
		その他資産 ()	E T F	
		資産複合		

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり ()	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	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
債券	(隔月)	欧州				
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 ()	アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング			その他 (最適化バ ランス指数)	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型 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、不 動産投信)))						
資産複合						

()					
-----	--	--	--	--	--

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

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

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

商品分類の定義

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

ファンドの目的

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

ファンドの特色



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

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

なお、各指数の資産クラス別比率の決定は、原則として年1回行います。

*最適化バランス指数を算出するために参照したファンドは以下のとおりです。

<最適化バランス(6%)指数>

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

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

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

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

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

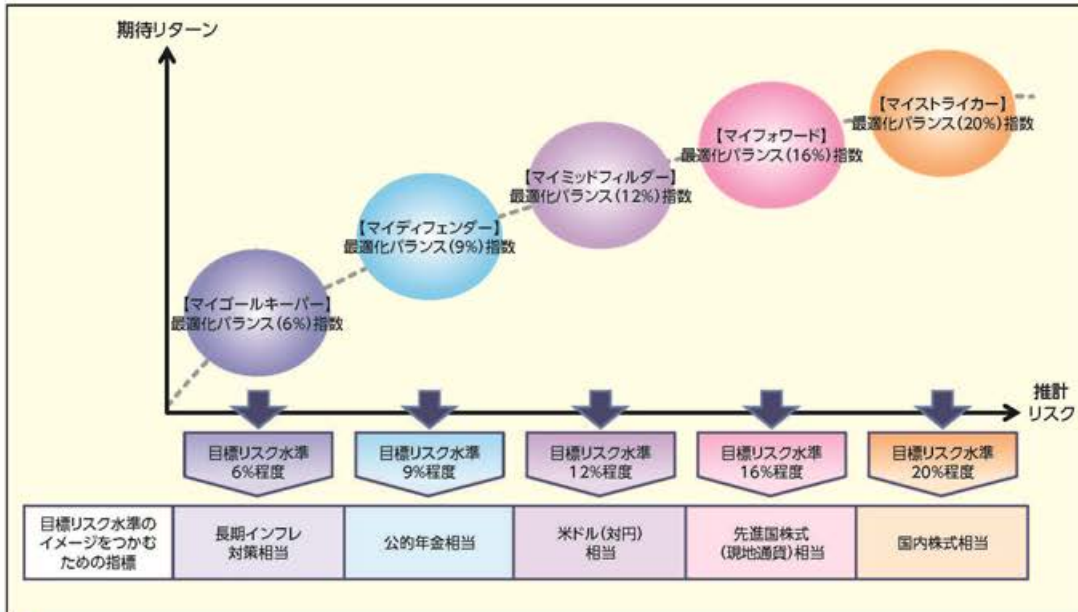
ファンド名	ファンドが連動することをめざす指数	目標リスク水準 (年率標準偏差)
マイゴールキーパー	最適化バランス(6%)指数	6%程度
マイディフェンダー	最適化バランス(9%)指数	9%程度
マイミッドフィルダー	最適化バランス(12%)指数	12%程度
マイフォワード	最適化バランス(16%)指数	16%程度
マイストライカー	最適化バランス(20%)指数	20%程度

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

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

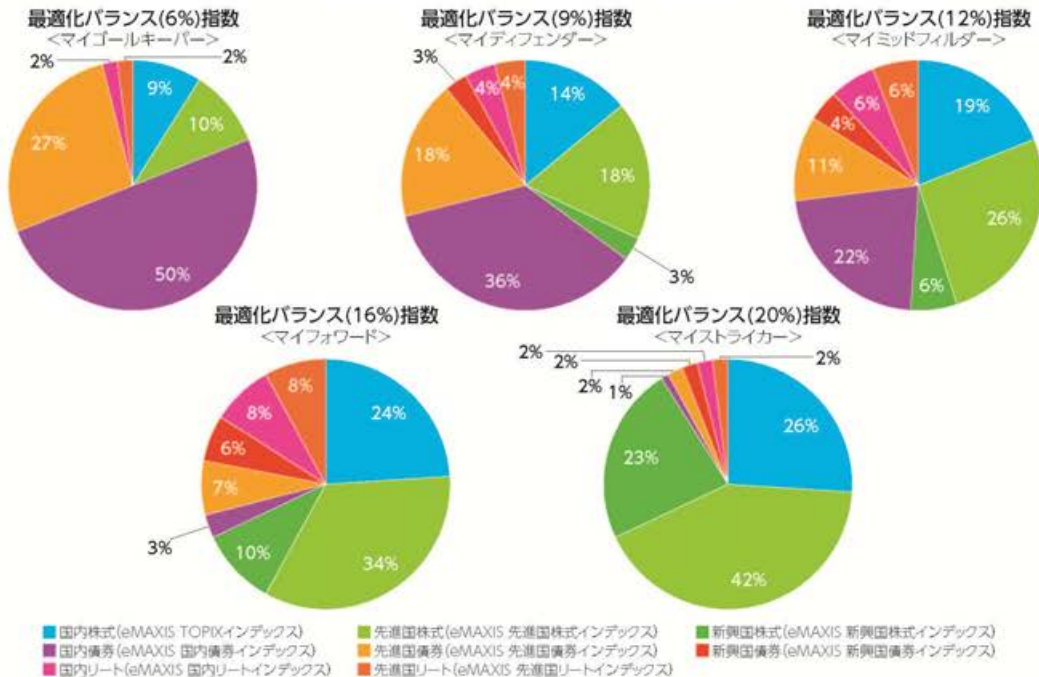
■ 一般に、リスクが大きい(小さい)ファンドほど期待されるリターンが大き(小さ)くなる傾向がありますが、必ずしもこのような関係にならない場合があります。

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



- ❗ 上図は各ファンドのリスク・リターン特性のイメージ図です。あくまでイメージであり、リスク・リターン特性を正確に表すものではありません。また、ファンドの将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。
- ❗ 上図の目標リスク水準は年率標準偏差で記載しています。
- ❗ 上図の目標リスク水準のイメージをつかむための指標は例示であり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。
- ❗ 各指標の内容は下記の通りです(イボットソン社が相当と考える長期間にて測定)。
 長期インフレ対策相当:将来の長期インフレ率を2%と仮定した場合に、当該水準のリターンを確保するのに必要だと考えられるリスク水準
 公的年金相当:年金積立金管理運用独立行政法人(GPIF)の基本ポートフォリオ(2023年12月末)のリスク水準
 米ドル(対円)相当:日本円/米ドルの為替レートのリスク水準
 先進国株式(現地通貨)相当:MSCI ワールド・インデックス(現地通貨ベース)のリスク水準
 国内株式相当:TOPIXのリスク水準

<最適化バランス指数の資産クラス別比率(2024年1月末現在)>



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



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

◆マイゴールキーパー

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

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

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

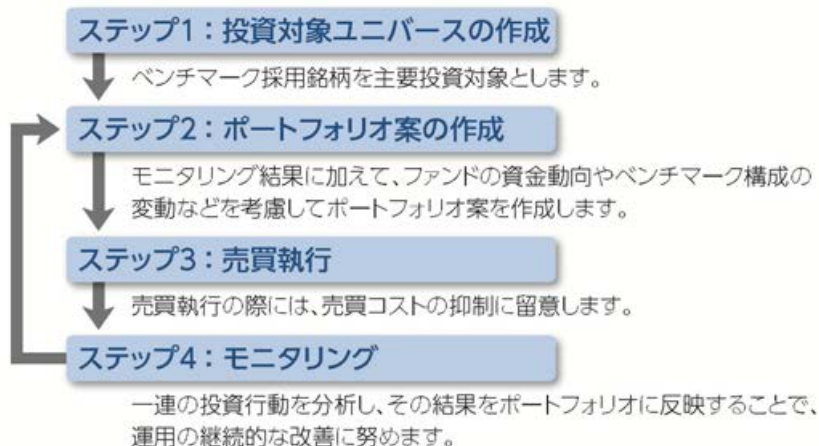
※実際の運用は各マザーファンドを通じて行います。

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

<各マザーファンドの運用目標>

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

<各マザーファンドの運用プロセス>



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

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



原則として、為替ヘッジは行いません。

- 為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

■ ファンドの仕組み

運用は主に各マザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債(マイゴールキーパーは、新興国株式、新興国債券を除く)および不動産投資信託証券へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。

<マイゴールキーパー>



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



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

■ 主な投資制限

株式	株式への実質投資割合に制限を設けません。
株式の一銘柄制限	同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
デリバティブ	デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

■ 分配方針

- 年1回の決算時(1月26日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。
- 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

ibbotson イボットソン・アソシエイツ・ジャパンについて

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

1977年に米国Ibbotson Associates, Inc. (現Morningstar Investment Management LLC)を創立したロジャー・G・イボットソン(イェール大学経営大学院教授)の理念は、金融経済学の研究成果を投資実務に役立たせることでした。日本ではイボットソン・アソシエイツ・ジャパンが、資本市場の長期的なリターンとリスクの調査・研究をもとに、資産運用サービス(基本資産配分の策定、資産クラス別の期待リターン・リスクの推計、ファンドの選定・アロケーション構築など)を金融機関や機関投資家を通じて投資家の皆様にご提供しています。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。



指数について

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

<最適化バランス指数の名称と目標リスク水準>

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

東証REIT指数の指数値及び東証REIT指数に係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証REIT指数に係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。

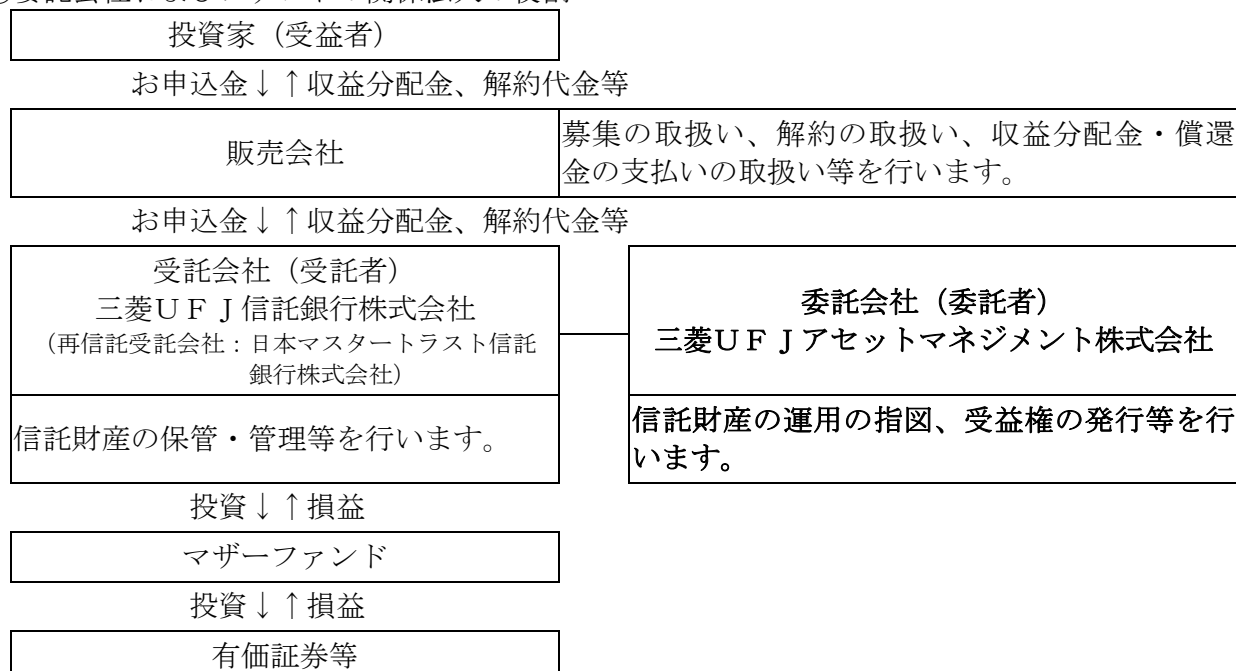
・S&P先進国REITインデックスとは、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが有するS&Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託(REIT)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数です。S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)は、S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み)をもとに、委託会社が計算したものです。

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

(2)【ファンドの沿革】

(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



※委託会社は、自らファンドの募集等を行い、特定の販売会社と共同でファンドの販売に係る業務を行う場合があります。

② 委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「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7月末現在）

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

2023年10月

菱UFJ国際投信株式会社に変更

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二丁目7番1号	211,581株	100.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

「eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)」

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として各マザーファンドの対象インデックスに採用されている、日本を含む先進国の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を最適化バランス(6%)指数の変動率に連動させることを目的とした運用を行います。なお、各マザーファンドは、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)、東証REIT指数(配当込み)およびS&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)を対象インデックスとし、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を各対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行うものです。このほか、日本を含む先進国の株式、公社債および上場投資信託証券(不動産投資信託証券を含みます。)に直接投資することがあります。国内株式、先進国株式、国内債券、先進国債券、国内不動産投資信託証券および先進国不動産投資信託証券への実質的な投資割合は、目標リスク水準(6%程度)に対し過去の市場データを用いて最適化を行い決定される、最適化バランス(6%)指数の各資産の構成比率となるよう運用を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。最適化バランス(6%)指数との連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

「eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)」

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として各マザーファンドの対象インデックスに採用されている、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を最適化バランス(9%)指数の変動率に連動させることを目的とした運用を行います。なお、各マザーファンドは、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)、東証REIT指数(配当込み)およびS&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)を対象インデックスとし、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を各対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行うものです。このほか、日本を含む世界各国の株式(DR(預託証券)を含みます。以下同じ。)、公社債および上場投資信託証券(不動産投資信託証券を含みます。)に直接投資することがあります。

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

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

「eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）」

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として各マザーファンドの対象インデックスに採用されている、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を最適化バランス（12%）指数の変動率に連動させることを目的とした運用を行います。なお、各マザーファンドは、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）、NOMURABPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）およびS&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）を対象インデックスとし、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を各対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行うものです。このほか、日本を含む世界各国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に直接投資することがあります。

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

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

「eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）」

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として各マザーファンドの対象インデックスに採用されている、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を最適化バランス（16%）指数の変動率に連動させることを目的とした運用を行います。なお、各マザーファンドは、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）、NOMURABPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）およびS&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）を対象インデックスとし、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を各対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行うものです。このほか、日本を含む世界各国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に直接投資することがあ

ります。

国内株式、先進国株式、新興国株式、国内債券、先進国債券、新興国債券、国内不動産投資信託証券および先進国不動産投資信託証券への実質的な投資割合は、目標リスク水準（16%程度）に対し過去の市場データを用いて最適化を行い決定される、最適化バランス（16%）指数の各資産の構成比率となるよう運用を行います。

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

「eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）」

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として各マザーファンドの対象インデックスに採用されている、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を最適化バランス（20%）指数の変動率に連動させることを目的とした運用を行います。なお、各マザーファンドは、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）およびS&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）を対象インデックスとし、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を各対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行うものです。このほか、日本を含む世界各国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に直接投資することがあります。

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

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2)【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

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

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

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

a. 有価証券先物取引等

b. スワップ取引

c. 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

②有価証券の指図範囲

「eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)」

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

1. 株券または新株引受権証券

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す。）
19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの
23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

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

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

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.から12.の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16.において同じ。）で16.で定めるもの以外のもの
16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16.において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 21. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
 22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの
 23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- なお、1.の証券または証書ならびに13.および19.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに16.の証券ならびに13.および19.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

③金融商品の指図範囲

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

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

④その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

<マザーファンドの概要>

TOPIXマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

東京証券取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

②投資態度

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

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

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

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

(投資制限)

①株式への投資割合に制限を設けません。

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

③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外国株式インデックスマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

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

②投資態度

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

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

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

- ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

(投資制限)

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

新興国株式インデックスマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

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

②投資態度

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

株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

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

日本債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

NOMURA-BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

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

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

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

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

(投資制限)

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

外には利用しません。

外国債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

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

②投資態度

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

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

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

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

- ①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
- ⑧有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑨スワップ取引を行うことができます。
- ⑩外国為替予約取引を行うことができます。
- ⑪デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- ⑫外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

新興国債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

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

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

る場合があります。

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

- ①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
- ⑧有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑨スワップ取引を行うことができます。
- ⑩金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことができます。
- ⑪外国為替予約取引を行うことができます。
- ⑫デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- ⑬外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

東証REIT指数マザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

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

②投資態度

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

原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

- ①株式への投資は行いません。
- ②投資信託証券への投資割合に制限を設けません。
- ③外貨建資産への投資は行いません。
- ④不動産投信指数先物取引を行うことができます。
- ⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

MUAM G-REITマザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、信託財産の成長を目指して運用を行います。

(運用方法)

①投資対象

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

②投資態度

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

銘柄選定にあたっては、時価総額および流動性等を勘案します。

原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。

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

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

市場動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

①株式への直接投資は行いません。

②投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

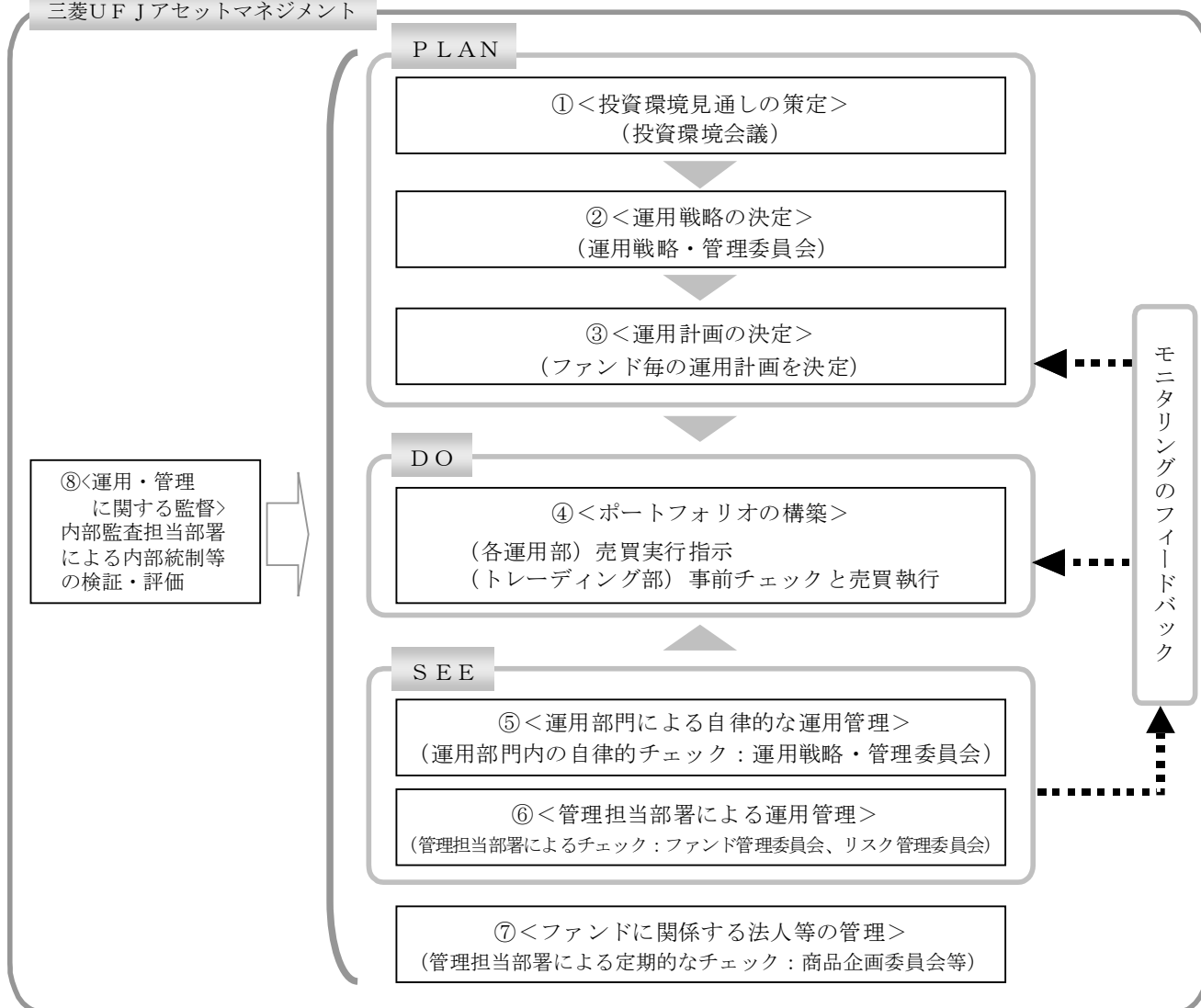
③外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

④不動産投信指数先物取引を行うことができます。

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

⑥外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

(3)【運用体制】



①投資環境見通しの策定

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

②運用戦略の決定

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

③運用計画の決定

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

④ポートフォリオの構築

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

⑤運用部門による自律的な運用管理

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

⑥管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、(a) 運用に関するパフォーマンス測定・分析のほか、(b) リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、(a) についてはファンド管理委員会を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバックされ、(b) についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

⑦ファンドに係る法人等の管理

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

⑧運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（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

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券（金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券をいいます。）を除きます。）の時価総額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

③同一銘柄の株式

同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。

④スワップ取引

- a. 委託会社は、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、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の権利行使により取得する株券
 - 2. 株式分割により取得する株券
 - 3. 有償増資により取得する株券
 - 4. 売出しにより取得する株券
 - 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債（信託約款において、新株予約権付社債のうち、会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第 341 条の 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがあるものをいいます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
 - 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（5. に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑥外国為替予約取引

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

⑦公社債の借入れ

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

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

⑧有価証券の借入れ

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

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

⑨資金の借入れ

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

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

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

⑩投資する株式等の範囲

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

⑪金利先渡取引および為替先渡取引

「eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)」

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

⑫金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引

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

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

⑬有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、投資信託証券（金融商品取引所に上場されているものに限り、以下⑬において同じ。）および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 投資信託証券の貸付は、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
 3. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. a. に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

⑭有価証券の空売り

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

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または⑧の規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- b. a. の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

⑮特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

⑯デリバティブ取引等

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

⑰信用リスクの分散規制

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

<その他法令等に定められた投資制限>

- ・同一の法人の発行する株式への投資制限

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

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

(主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。)

①価格変動リスク

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動し、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動し、また、不動産投資信託証券の価格は保有不動産等の価値やそこから得られる収益の増減等により変動するため、当ファンドはその影響を受け株式や公社債、不動産投資信託証券の価格が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

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

また、不動産投資信託証券は、株式と同様に上場市場で取引が行われ市場の需給を受けて価格が決定しますが、利回りに着目して取引される傾向もあるため、公社債と同様に、金利の影響を受ける

ことがあります。よって、金利の上昇局面では、不動産投資信託証券に対する投資価値が相対的に低下し、不動産投資信託証券の市場価格が下落する場合があります。この場合、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

②為替変動リスク

実質的な主要投資対象である海外の株式や公社債、不動産投資信託証券は外貨建資産であり、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。そのため、為替相場が円高方向に進んだ場合には、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

③信用リスク

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

④流動性リスク

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

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

⑤カントリーリスク

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

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

※留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・有価証券の貸付等においては、取引先の倒産等による決済不履行リスクを伴い、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。
- ・当ファンドは、最適化バランス指数の動きに連動することをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比

に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因によりカイ離を生じることがあります。

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

(2) 投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行い、ファンド管理委員会およびリスク管理委員会においてそれらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を検討しています。

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

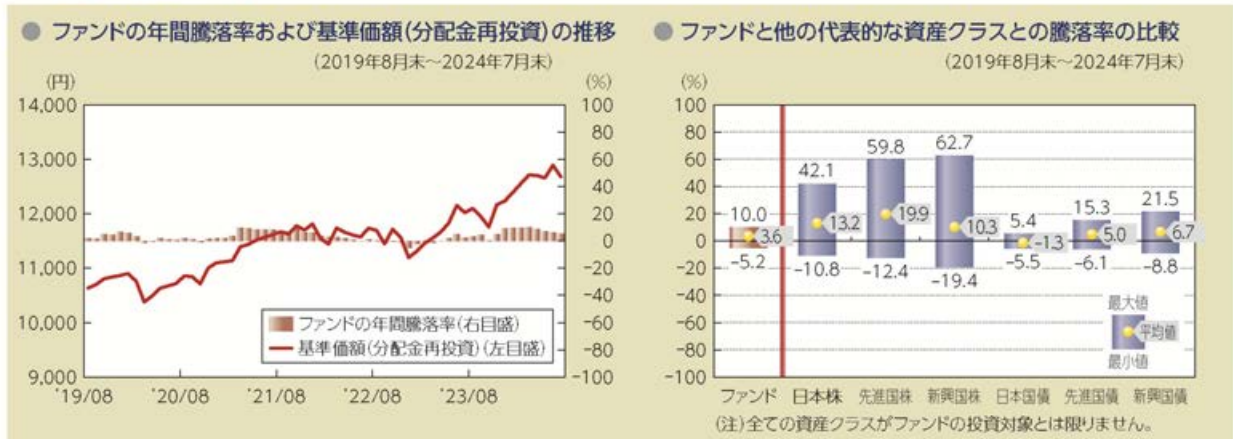
委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

*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

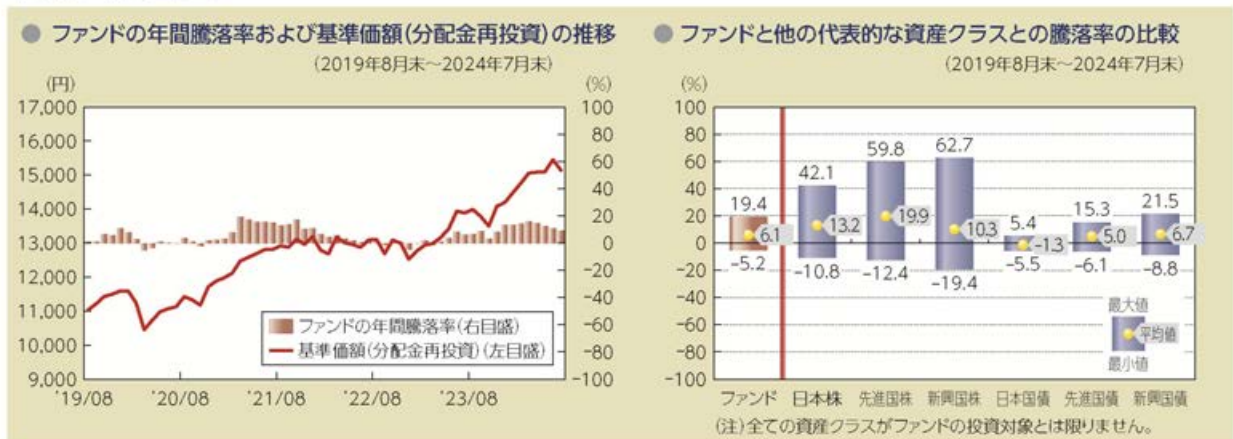
下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

マイゴールキーパー



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

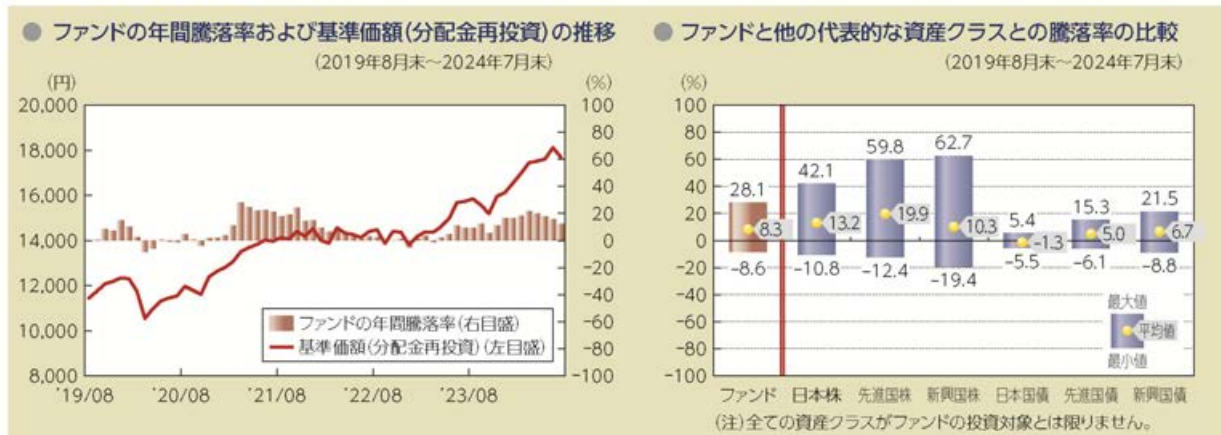
マイディフェンダー



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

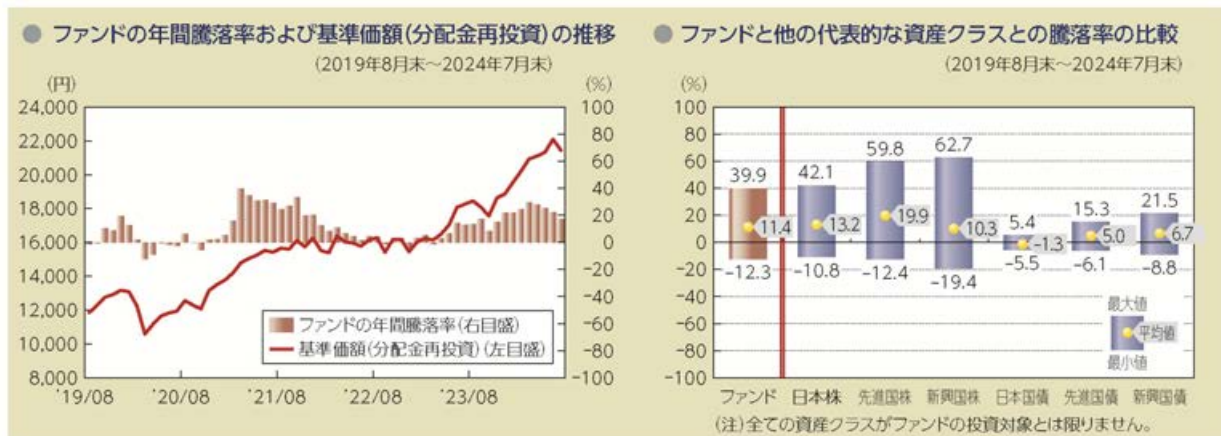
上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

マイミッドフィルダー



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

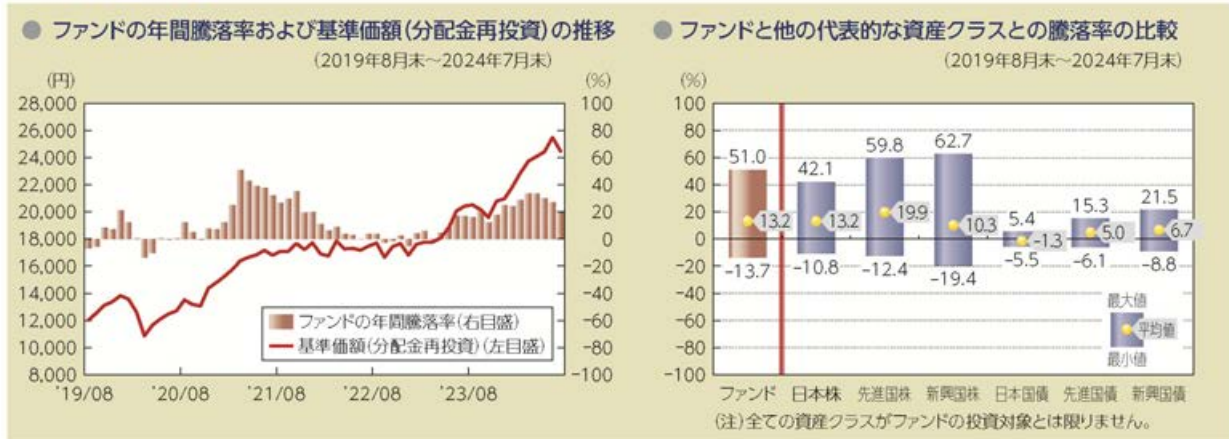
マイフォワード



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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

マイストライカー



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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

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

務手続等です。

(2) 【換金（解約）手数料】

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

かかりません。

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

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

かかりません。

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

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

「eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード） / （マイストライカー）」

かかりません。

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

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

(3) 【信託報酬等】

- 信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年 0.55%（税抜 0.5%）以内の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

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

※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

- 信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- 信託報酬率ならびに配分（委託会社および販売会社、受託会社）は、ファンドの純資産総額に応じて以下の通りとなります。

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

委託会社および販売会社への配分（税抜）は、次の通りです。

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

※上記各支払先への配分には、別途消費税等相当額がかかります。

※委託会社が特定の販売会社と共同で行う投資信託取引サービスにおいては、上記信託報酬の販売会社への配分については委託会社が受領します。

各支払先が信託報酬の対価として提供する役務の内容は以下の通りです。

支払先	対価として提供する役務の内容
委託会社	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書

	等の作成等
販売会社	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

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

(4) 【その他の手数料等】

- ・ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外国株式インデックスマザーファンド、新興国株式インデックスマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、新興国債券インデックスマザーファンド、東証REIT指数マザーファンドおよびMUAM G-R EIT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、

※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「成長投資枠（特定非課税管理勘定）およびつみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象です。販売会社により取扱いが異なる場合があります。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

NISAをご利用の場合、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

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

◇個別元本について

- ①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- ②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。
- ③受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

◇収益分配金について

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

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

※上記は2024年7月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

(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1月27日～2024年1月26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
マイゴールキーパー	0.56%	0.55%	0.01%
マイディフェンダー	0.57%	0.55%	0.02%
マイミッドフィルダー	0.58%	0.55%	0.03%
マイフォワード	0.59%	0.55%	0.04%
マイストライカー	0.60%	0.55%	0.05%

(比率は年率、表示桁数未満四捨五入)

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

詳細につきましては、当期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5 【運用状況】

【eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)】

(1) 【投資状況】

2024年7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	5,589,656,757	99.00
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	56,464,340	1.00
純資産総額		5,646,121,097	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7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	2,229,013,821	1.2716	2,834,413,975	1.2434	2,771,555,785	49.09
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	559,550,530	2.5859	1,446,958,867	2.7022	1,512,017,442	26.78
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	78,154,855	6.3255	494,370,441	7.1279	557,079,990	9.87
日本	親投資信託受益証券	TOPIXマザーファンド	151,328,359	3.0821	466,409,136	3.4317	519,313,529	9.20
日本	親投資信託受益証券	東証REIT指数マザーファンド	33,459,873	3.5026	117,196,552	3.4481	115,372,988	2.04

日本	親投資信託受益証券	MUAM G-REITマザーファンド	39,801,206	2,5678	102,201,537	2.8722	114,317,023	2.02
----	-----------	--------------------	------------	--------	-------------	--------	-------------	------

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.00
合計	99.00

(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7月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末日 (2017年1月26日)	79,528,322	79,528,322	9,992	9,992
第2計算期間末日 (2018年1月26日)	578,287,926	578,287,926	10,536	10,536
第3計算期間末日 (2019年1月28日)	913,675,754	913,675,754	10,279	10,279
第4計算期間末日 (2020年1月27日)	1,722,503,476	1,722,503,476	10,891	10,891
第5計算期間末日 (2021年1月26日)	2,301,813,870	2,301,813,870	11,132	11,132
第6計算期間末日 (2022年1月26日)	3,575,041,678	3,575,041,678	11,514	11,514
第7計算期間末日 (2023年1月26日)	4,149,837,678	4,149,837,678	11,324	11,324
第8計算期間末日 (2024年1月26日)	4,884,420,376	4,884,420,376	12,358	12,358
2023年7月末日	4,598,252,627	—	12,020	—
8月末日	4,720,786,759	—	12,095	—
9月末日	4,688,043,020	—	11,951	—
10月末日	4,666,571,185	—	11,755	—
11月末日	4,835,111,346	—	12,166	—
12月末日	4,808,157,807	—	12,234	—
2024年1月末日	4,908,342,614	—	12,389	—
2月末日	5,046,267,756	—	12,553	—

3月末日	5,239,431,899	—	12,711	—
4月末日	5,354,576,790	—	12,703	—
5月末日	5,458,685,901	—	12,656	—
6月末日	5,570,570,170	—	12,890	—
7月末日	5,646,121,097	—	12,678	—

②【分配の推移】

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

③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第1計算期間	△0.08
第2計算期間	5.44
第3計算期間	△2.43
第4計算期間	5.95
第5計算期間	2.21
第6計算期間	3.43
第7計算期間	△1.65
第8計算期間	9.13
第9中間計算期間	2.50

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

(4)【設定及び解約の実績】

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

第8計算期間	1,287,202,647	999,336,100	3,952,438,503
第9中間計算期間	894,190,897	394,059,456	4,452,569,944

【eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）】

(1) 【投資状況】

2024年7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	4,632,306,625	99.00
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	46,804,503	1.00
純資産総額		4,679,111,128	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7月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	1,320,061,294	1.2716	1,678,589,942	1.2434	1,641,364,212	35.08
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	309,469,645	2.5854	800,109,664	2.7022	836,248,874	17.87
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	116,363,610	6.3023	733,364,786	7.1279	829,428,175	17.73
日本	親投資信託受益証券	TOPIXマザーファンド	193,900,415	3.0790	597,027,785	3.4317	665,408,054	14.22
日本	親投資信託受益証券	東証REIT指数マザーファンド	55,865,294	3.5042	195,763,164	3.4481	192,629,120	4.12
日本	親投資信託受益証券	MUAMGRITマザーファンド	66,474,622	2.5667	170,620,413	2.8722	190,928,409	4.08
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックスマザーファンド	76,131,124	1.7791	135,452,338	1.8229	138,779,425	2.97
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	35,112,178	3.4813	122,236,208	3.9166	137,520,356	2.94

(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7月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.00
合計	99.00

(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7月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末日 (2017年1月26日)	104,038,196	104,038,196	10,247	10,247
第2計算期間末日 (2018年1月26日)	546,855,605	546,855,605	11,145	11,145
第3計算期間末日 (2019年1月28日)	815,892,066	815,892,066	10,692	10,692
第4計算期間末日 (2020年1月27日)	1,412,965,035	1,412,965,035	11,624	11,624
第5計算期間末日 (2021年1月26日)	1,686,114,151	1,686,114,151	12,025	12,025
第6計算期間末日 (2022年1月26日)	2,660,796,064	2,660,796,064	12,728	12,728
第7計算期間末日 (2023年1月26日)	3,094,444,575	3,094,444,575	12,754	12,754
第8計算期間末日 (2024年1月26日)	4,030,221,794	4,030,221,794	14,427	14,427
2023年7月末日	3,681,892,434	—	13,888	—
8月末日	3,785,651,628	—	13,987	—
9月末日	3,806,582,972	—	13,781	—
10月末日	3,779,610,588	—	13,500	—
11月末日	3,931,403,986	—	14,083	—
12月末日	3,930,963,206	—	14,193	—
2024年1月末日	4,056,044,417	—	14,478	—
2月末日	4,171,656,686	—	14,762	—
3月末日	4,336,023,928	—	15,059	—
4月末日	4,439,860,306	—	15,086	—
5月末日	4,525,826,439	—	15,098	—
6月末日	4,648,579,206	—	15,451	—
7月末日	4,679,111,128	—	15,143	—

②【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円

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

③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第1計算期間	2.47
第2計算期間	8.76
第3計算期間	△4.06
第4計算期間	8.71
第5計算期間	3.44
第6計算期間	5.84
第7計算期間	0.20
第8計算期間	13.11
第9中間計算期間	4.65

(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1計算期間	160,337,325	58,805,087	101,532,238
第2計算期間	549,171,328	160,032,694	490,670,872
第3計算期間	529,756,983	257,351,087	763,076,768
第4計算期間	935,152,642	482,620,593	1,215,608,817
第5計算期間	832,042,163	645,464,516	1,402,186,464
第6計算期間	989,014,237	300,622,413	2,090,578,288
第7計算期間	727,844,011	392,262,071	2,426,160,228
第8計算期間	862,948,815	495,513,614	2,793,595,429
第9中間計算期間	518,160,912	231,570,022	3,080,186,319

【eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）】

(1)【投資状況】

2024年7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	14,453,898,523	99.00

コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	146,039,272	1.00
純資産総額		14,599,937,795	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7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	522,176,470	6.2928	3,285,998,704	7.1279	3,722,021,660	25.49
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	2,483,550,157	1.2709	3,156,343,895	1.2434	3,088,046,265	21.15
日本	親投資信託受益証券	TOPIXマザーファンド	819,429,773	3.0792	2,523,226,994	3.4317	2,812,037,152	19.26
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	589,563,602	2.5891	1,526,466,666	2.7022	1,593,118,765	10.91
日本	親投資信託受益証券	東証REIT指数マザーファンド	263,516,964	3.5009	922,546,540	3.4481	908,632,843	6.22
日本	親投資信託受益証券	MUAM GREITマザーファンド	313,807,503	2.5702	806,548,045	2.8722	901,317,910	6.17
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	217,629,514	3.4736	755,961,509	3.9166	852,367,754	5.84
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックスマザーファンド	316,175,421	1.7807	563,016,132	1.8229	576,356,174	3.95

(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7月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.00
合計	99.00

(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7月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末日 (2017年1月26日)	239,586,416	239,586,416	10,516	10,516
第2計算期間末日 (2018年1月26日)	1,592,675,860	1,592,675,860	11,791	11,791
第3計算期間末日 (2019年1月28日)	2,562,665,122	2,562,665,122	11,125	11,125
第4計算期間末日 (2020年1月27日)	3,618,196,941	3,618,196,941	12,386	12,386
第5計算期間末日 (2021年1月26日)	4,870,796,900	4,870,796,900	12,872	12,872
第6計算期間末日 (2022年1月26日)	6,882,109,383	6,882,109,383	13,895	13,895
第7計算期間末日 (2023年1月26日)	8,835,402,651	8,835,402,651	14,136	14,136
第8計算期間末日 (2024年1月26日)	12,014,727,343	12,014,727,343	16,474	16,474
2023年7月末日	10,758,845,942	—	15,735	—
8月末日	11,020,774,767	—	15,846	—
9月末日	11,030,314,166	—	15,571	—
10月末日	10,922,520,121	—	15,188	—
11月末日	11,517,442,710	—	15,960	—
12月末日	11,625,991,577	—	16,124	—
2024年1月末日	12,091,236,941	—	16,545	—
2月末日	12,620,799,847	—	16,975	—
3月末日	13,287,691,808	—	17,446	—
4月末日	13,617,427,068	—	17,519	—
5月末日	13,957,794,128	—	17,608	—
6月末日	14,603,632,755	—	18,116	—
7月末日	14,599,937,795	—	17,687	—

②【分配の推移】

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

③【収益率の推移】

	収益率 (%)

第1計算期間	5.16
第2計算期間	12.12
第3計算期間	△5.64
第4計算期間	11.33
第5計算期間	3.92
第6計算期間	7.94
第7計算期間	1.73
第8計算期間	16.53
第9中間計算期間	6.82

(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1計算期間	260,488,787	32,652,572	227,836,215
第2計算期間	1,456,517,138	333,642,454	1,350,710,899
第3計算期間	1,396,610,241	443,890,186	2,303,430,954
第4計算期間	1,574,849,626	957,094,193	2,921,186,387
第5計算期間	1,787,720,269	924,966,032	3,783,940,624
第6計算期間	2,017,199,558	848,198,851	4,952,941,331
第7計算期間	1,870,039,961	572,529,165	6,250,452,127
第8計算期間	2,219,666,001	1,176,817,768	7,293,300,360
第9中間計算期間	1,522,899,730	580,598,444	8,235,601,646

【eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）】

(1)【投資状況】

2024年7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	9,413,525,962	99.00
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	95,058,015	1.00
純資産総額		9,508,583,977	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7月31日現在

国／	種類	銘柄名	数量	簿価	簿価	評価	評価	投資
----	----	-----	----	----	----	----	----	----

地域				単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	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	444,064,590	6.2848	2,790,894,547	7.1279	3,165,247,991	33.29
日本	親投資信託受益証券	TOPIXマザーファンド	673,042,522	3.0750	2,069,666,220	3.4317	2,309,680,022	24.29
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	236,146,127	3.4665	818,607,566	3.9166	924,889,921	9.73
日本	親投資信託受益証券	東証REIT指数マザーファンド	230,466,125	3.5010	806,882,488	3.4481	794,670,245	8.36
日本	親投資信託受益証券	MUAM G-REITマザーファンド	274,819,422	2.5682	705,797,162	2.8722	789,336,343	8.30
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	246,390,714	2.5919	638,634,353	2.7022	665,796,987	7.00
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックスマザーファンド	310,537,437	1.7823	553,499,106	1.8229	566,078,693	5.95
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	159,100,660	1.2705	202,139,400	1.2434	197,825,760	2.08

(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7月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.00
合計	99.00

(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7月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

		純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末日	(2017年1月26日)	188,359,324	188,359,324	10,764	10,764
第2計算期間末日	(2018年1月26日)	973,394,215	973,394,215	12,500	12,500
第3計算期間末日	(2019年1月28日)	1,462,678,215	1,462,678,215	11,535	11,535
第4計算期間末日	(2020年1月27日)	2,028,368,456	2,028,368,456	13,213	13,213
第5計算期間末日	(2021年1月26日)	2,779,715,457	2,779,715,457	13,876	13,876
第6計算期間末日	(2022年1月26日)	4,174,041,793	4,174,041,793	15,356	15,356

第7計算期間末日	(2023年1月26日)	5,433,899,506	5,433,899,506	15,921	15,921
第8計算期間末日	(2024年1月26日)	7,652,001,603	7,652,001,603	19,434	19,434
	2023年7月末日	6,630,771,844	—	18,266	—
	8月末日	6,814,152,708	—	18,451	—
	9月末日	6,798,750,482	—	18,076	—
	10月末日	6,748,471,287	—	17,569	—
	11月末日	7,155,992,395	—	18,632	—
	12月末日	7,239,943,190	—	18,868	—
	2024年1月末日	7,716,134,537	—	19,546	—
	2月末日	8,099,526,988	—	20,198	—
	3月末日	8,551,091,186	—	20,928	—
	4月末日	8,803,863,200	—	21,104	—
	5月末日	9,110,296,071	—	21,328	—
	6月末日	9,600,895,173	—	22,092	—
	7月末日	9,508,583,977	—	21,441	—

②【分配の推移】

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

③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第1計算期間	7.64
第2計算期間	16.12
第3計算期間	△7.72
第4計算期間	14.54
第5計算期間	5.01
第6計算期間	10.66
第7計算期間	3.67
第8計算期間	22.06
第9中間計算期間	9.58

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

(4)【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	215,753,311	40,763,565	174,989,746
第2計算期間	829,352,524	225,629,350	778,712,920
第3計算期間	779,203,269	289,913,679	1,268,002,510
第4計算期間	798,079,346	530,976,262	1,535,105,594
第5計算期間	1,029,073,218	560,968,918	2,003,209,894
第6計算期間	1,171,870,790	456,890,240	2,718,190,444
第7計算期間	1,108,556,067	413,734,207	3,413,012,304
第8計算期間	1,299,340,431	774,837,783	3,937,514,952
第9中間計算期間	801,669,536	316,035,797	4,423,148,691

【eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）】

(1)【投資状況】

2024年7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	16,166,160,925	99.00
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	163,351,385	1.00
純資産総額		16,329,512,310	100.00

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

(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7月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	951,272,163	6.3429	6,033,907,587	7.1279	6,780,572,850	41.52
日本	親投資信託受益証券	TOPIXマザーファンド	1,266,583,079	3.0889	3,912,468,422	3.4317	4,346,533,152	26.62
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	947,055,802	3.4949	3,309,934,291	3.9166	3,709,238,754	22.71
日本	親投資信託受益証券	東証REIT指数マザーファンド	98,851,896	3.4973	345,714,736	3.4481	340,851,222	2.09
日本	親投資信託受益証券	MUAM-GREITマザーファンド	114,991,663	2.5791	296,574,999	2.8722	330,279,054	2.02
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックスマザーファンド	179,319,046	1.7874	320,514,863	1.8229	326,880,688	2.00

日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	91,443,063	2.6009	237,834,263	2.7022	247,097,444	1.51
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	68,125,914	1.2693	86,472,223	1.2434	84,707,761	0.52

(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7月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.00
合計	99.00

(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7月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末日 (2017年1月26日)	182,414,441	182,414,441	11,152	11,152
第2計算期間末日 (2018年1月26日)	2,145,447,863	2,145,447,863	13,714	13,714
第3計算期間末日 (2019年1月28日)	3,008,888,114	3,008,888,114	12,038	12,038
第4計算期間末日 (2020年1月27日)	3,277,796,593	3,277,796,593	13,812	13,812
第5計算期間末日 (2021年1月26日)	4,503,577,169	4,503,577,169	15,541	15,541
第6計算期間末日 (2022年1月26日)	6,580,279,930	6,580,279,930	16,750	16,750
第7計算期間末日 (2023年1月26日)	8,332,473,177	8,332,473,177	17,502	17,502
第8計算期間末日 (2024年1月26日)	12,264,113,724	12,264,113,724	21,731	21,731
2023年7月末日	10,424,746,830	—	20,421	—
8月末日	10,702,651,313	—	20,518	—
9月末日	10,771,977,484	—	20,176	—
10月末日	10,646,981,568	—	19,589	—
11月末日	11,381,492,857	—	20,790	—
12月末日	11,474,709,763	—	20,976	—
2024年1月末日	12,391,614,710	—	21,863	—

2月末日	13,369,016,064	—	22,883	—
3月末日	14,220,717,610	—	23,742	—
4月末日	14,773,951,610	—	24,084	—
5月末日	15,493,860,352	—	24,430	—
6月末日	16,505,051,925	—	25,485	—
7月末日	16,329,512,310	—	24,480	—

②【分配の推移】

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

③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第1計算期間	11.52
第2計算期間	22.97
第3計算期間	△12.22
第4計算期間	14.73
第5計算期間	12.51
第6計算期間	7.77
第7計算期間	4.48
第8計算期間	24.16
第9中間計算期間	12.10

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

(4)【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	182,226,207	18,654,277	163,571,930
第2計算期間	1,905,710,622	504,850,166	1,564,432,386
第3計算期間	1,752,807,683	817,772,802	2,499,467,267
第4計算期間	1,151,729,676	1,278,059,271	2,373,137,672
第5計算期間	1,813,569,711	1,288,759,235	2,897,948,148

第6計算期間	2,073,770,424	1,043,131,929	3,928,586,643
第7計算期間	1,544,412,998	712,265,698	4,760,733,943
第8計算期間	2,077,699,068	1,194,818,191	5,643,614,820
第9中間計算期間	1,586,649,700	580,827,502	6,649,437,018

(参考)

TOPIXマザーファンド

投資状況

2024年7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率 (%)
株式	日本	1,536,336,509,930	99.12
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	13,622,656,740	0.88
純資産総額		1,549,959,166,670	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7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	建別	国/地域	時価合計	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	8,335,060,000	0.54

(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7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	20,750,600	3,782.48	78,488,729,488	2,949.00	61,193,519,400	3.95
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	23,412,500	1,583.79	37,080,483,375	1,750.00	40,971,875,000	2.64
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2,733,600	13,070.01	35,728,179,336	13,530.00	36,985,608,000	2.39
日本	株式	日立製作所	電気機器	9,474,000	2,805.94	26,583,475,560	3,288.00	31,150,512,000	2.01
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2,692,200	9,043.68	24,347,395,296	10,915.00	29,385,363,000	1.90
日本	株式	キーエンス	電気機器	390,500	70,259.54	27,436,350,370	65,890.00	25,730,045,000	1.66
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	826,100	38,421.20	31,739,753,320	31,020.00	25,625,622,000	1.65
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	2,890,000	6,634.79	19,174,543,100	8,658.00	25,021,620,000	1.61

日本	株式	三菱商事	卸売業	7,930,300	3,524.73	27,952,166,319	3,144.00	24,932,863,200	1.61
日本	株式	信越化学工業	化学	3,506,300	6,698.83	23,488,107,629	6,748.00	23,660,512,400	1.53
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	3,753,500	4,759.85	17,866,096,975	6,022.00	22,603,577,000	1.46
日本	株式	三井物産	卸売業	6,186,800	3,576.29	22,125,790,972	3,530.00	21,839,404,000	1.41
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	2,776,200	6,629.19	18,403,957,278	7,783.00	21,607,164,600	1.39
日本	株式	第一三共	医薬品	3,410,500	4,879.32	16,640,920,860	6,148.00	20,967,754,000	1.35
日本	株式	任天堂	その他製品	2,464,400	8,290.97	20,432,266,468	8,388.00	20,671,387,200	1.33
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	116,452,000	180.67	21,039,382,840	160.40	18,678,900,800	1.21
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	5,189,200	3,056.43	15,860,426,556	3,448.00	17,892,361,600	1.15
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,931,200	9,181.28	17,730,887,936	9,162.00	17,693,654,400	1.14
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	9,248,800	1,864.84	17,247,532,192	1,647.00	15,232,773,600	0.98
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	3,464,900	4,341.51	15,042,897,999	4,302.00	14,905,999,800	0.96
日本	株式	HOYA	精密機器	768,500	19,021.75	14,618,214,875	18,940.00	14,555,390,000	0.94
日本	株式	KDDI	情報・通信業	2,879,500	4,501.44	12,961,896,480	4,520.00	13,015,340,000	0.84
日本	株式	三菱重工業	機械	6,894,400	1,378.00	9,500,483,200	1,830.00	12,616,752,000	0.81
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	6,254,600	2,016.61	12,613,088,906	1,965.00	12,290,289,000	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	3,486,900	2,876.74	10,030,904,706	3,351.00	11,684,601,900	0.75
日本	株式	三菱電機	電気機器	4,318,600	2,552.59	11,023,615,174	2,601.00	11,232,678,600	0.72
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	2,335,600	4,010.89	9,367,834,684	4,434.00	10,356,050,400	0.67
日本	株式	ダイキン工業	機械	470,700	20,598.33	9,695,633,931	21,905.00	10,310,683,500	0.67
日本	株式	富士通	電気機器	3,627,900	2,507.55	9,097,140,645	2,732.50	9,913,236,750	0.64
日本	株式	丸紅	卸売業	3,425,700	2,685.26	9,198,895,182	2,860.50	9,799,214,850	0.63

(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7月31日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.30
	建設業	2.12
	食料品	3.20
	繊維製品	0.37
	パルプ・紙	0.15
	化学	5.69
	医薬品	4.77
	石油・石炭製品	0.53
	ゴム製品	0.63
	ガラス・土石製品	0.68
	鉄鋼	0.85
	非鉄金属	0.73

	金属製品	0.53
	機械	5.47
	電気機器	17.05
	輸送用機器	7.70
	精密機器	2.24
	その他製品	2.41
	電気・ガス業	1.37
	陸運業	2.28
	海運業	0.75
	空運業	0.35
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	7.10
	卸売業	7.46
	小売業	4.00
	銀行業	8.27
	証券、商品先物取引業	0.94
	保険業	3.27
	その他金融業	1.20
	不動産業	2.00
	サービス業	4.52
	小計	99.12
合計		99.12

(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7月31日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX 24年09月限	買建	298	円	8,168,928,900	8,335,060,000	0.54

(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7月31日現在

(単位:円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率(%)
株式	アメリカ	4,366,611,567,552	72.60

	イギリス	235,465,192,467	3.91
	カナダ	186,182,828,449	3.10
	フランス	162,262,386,735	2.70
	スイス	158,700,372,543	2.64
	ドイツ	134,928,189,729	2.24
	オーストラリア	108,807,430,112	1.81
	オランダ	96,466,501,713	1.60
	デンマーク	58,385,164,215	0.97
	スウェーデン	50,001,516,967	0.83
	スペイン	41,317,932,920	0.69
	イタリア	33,623,615,184	0.56
	香港	25,449,830,340	0.42
	シンガポール	17,393,446,743	0.29
	フィンランド	15,621,202,928	0.26
	ベルギー	12,674,614,573	0.21
	ノルウェー	9,118,892,367	0.15
	イスラエル	5,556,528,526	0.09
	アイルランド	4,482,667,620	0.07
	オーストリア	2,927,770,283	0.05
	ルクセンブルク	2,819,029,188	0.05
	ニュージーランド	2,758,352,327	0.05
	ポルトガル	2,566,398,840	0.04
	バミューダ	842,756,825	0.01
	小計	5,734,964,189,146	95.35
投資証券	アメリカ	98,409,501,191	1.64
	オーストラリア	7,561,856,545	0.13
	イギリス	2,065,112,451	0.03
	フランス	1,997,112,823	0.03
	シンガポール	1,379,217,268	0.02
	香港	1,028,202,363	0.02
	ベルギー	411,824,931	0.01
	カナダ	311,772,865	0.01
	小計	113,164,600,437	1.88
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	166,525,076,288	2.77
純資産総額		6,014,653,865,871	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7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
-------	----	------	------	----------

株価指数先物取引	買建	アメリカ	132,350,256,335	2.20
	買建	カナダ	5,906,894,532	0.10
	買建	ドイツ	19,272,224,479	0.32
	買建	オーストラリア	4,396,612,807	0.07
	買建	イギリス	7,023,975,489	0.12
	買建	スイス	4,549,017,902	0.08

(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7月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	9,013,925	28,242.15	254,572,643,246	33,353.87	300,649,300,668	5.00
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4,337,279	63,488.53	275,367,483,608	64,469.92	279,624,050,967	4.65
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	15,361,349	14,114.50	216,817,794,666	15,812.60	242,902,885,631	4.04
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	5,753,253	28,559.38	164,309,381,058	27,699.87	159,364,373,985	2.65
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	4,730,117	25,717.67	121,647,597,352	25,959.00	122,789,143,152	2.04
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	1,346,819	72,778.30	98,019,209,105	70,608.68	95,097,116,637	1.58
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	496,686	117,220.78	58,221,924,823	120,459.61	59,830,603,045	0.99
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1,761,871	26,148.77	46,070,769,258	33,936.19	59,791,193,945	0.99
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	2,705,900	20,586.26	55,704,382,032	21,878.18	59,200,191,074	0.98
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1,765,170	30,351.04	53,574,762,078	32,803.56	57,903,866,360	0.96
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	805,141	62,842.50	50,597,075,790	67,265.67	54,158,352,352	0.90
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	2,036,487	26,065.71	53,082,490,965	26,198.33	53,352,575,573	0.89
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	566,856	78,127.90	44,287,269,784	87,855.74	49,801,556,301	0.83
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	2,756,880	17,932.80	49,438,587,940	18,013.83	49,661,980,883	0.83

			ー						
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	2,006,707	19,647.81	39,427,408,897	19,810.43	39,753,748,621	0.66
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	972,085	42,681.05	41,489,609,858	40,106.96	38,987,378,100	0.65
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	1,480,734	22,822.62	33,794,233,964	24,593.14	36,415,906,265	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	1,445,927	25,423.65	36,760,755,366	24,649.54	35,641,446,991	0.59
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	511,847	69,538.22	35,592,930,765	68,209.27	34,912,714,316	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	609,903	52,783.49	32,192,813,834	55,440.90	33,813,573,428	0.56
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	272,657	120,614.37	32,886,352,952	123,480.97	33,667,951,710	0.56
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	245,782	143,465.68	35,261,283,517	132,851.87	32,652,599,050	0.54
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	1,088,564	24,551.44	26,725,816,762	28,472.74	30,994,403,229	0.52
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	2,722,992	9,300.66	25,325,631,859	10,547.32	28,720,277,784	0.48
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	4,369,560	5,887.42	25,725,476,757	6,292.72	27,496,431,586	0.46
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	1,557,566	19,792.68	30,828,418,875	17,568.71	27,364,425,360	0.45
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	1,078,756	25,187.74	27,171,434,505	24,324.85	26,240,578,750	0.44
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	2,511,587	9,647.44	24,230,387,192	10,317.13	25,912,392,692	0.43
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	266,223	93,561.40	24,908,197,882	94,906.09	25,266,185,382	0.42
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	1,642,628	16,443.97	27,011,340,710	15,328.33	25,178,757,192	0.42

(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7月31日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	エネルギー	4.39

	素材	3.58
	資本財	6.83
	商業・専門サービス	1.57
	運輸	1.59
	自動車・自動車部品	1.62
	耐久消費財・アパレル	1.27
	消費者サービス	1.79
	メディア・娯楽	6.18
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.71
	生活必需品流通・小売り	1.71
	食品・飲料・タバコ	3.11
	家庭用品・パーソナル用品	1.52
	ヘルスケア機器・サービス	4.07
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.95
	銀行	5.63
	金融サービス	6.58
	保険	3.00
	ソフトウェア・サービス	9.53
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.45
	電気通信サービス	1.09
	公益事業	2.58
	半導体・半導体製造装置	8.33
	不動産管理・開発	0.28
	小計	95.35
投資証券	—	1.88
合計		97.23

(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7月31日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額 (円)	評価金額	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2409	買建	3,173	アメリカドル	887,453,700.8	135,283,442,150	868,212,125	132,350,256,335	2.20
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602409	買建	196	カナダドル	52,367,759	5,762,024,523	53,684,400	5,906,894,532	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引	EURO ST 2409	買建	2,399	ユーロ	118,855,158.55	19,598,027,093	116,879,280	19,272,224,479	0.32

	引所									
オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2409	買建	223	オーストラリアドル	43,777,838.25	4,362,461,581	44,120,550	4,396,612,807	0.07
イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2409	買建	433	イギリスポンド	35,554,756.25	6,960,199,083	35,880,545	7,023,975,489	0.12
スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX2409	買建	214	スイスフラン	26,016,055.9	4,496,875,262	26,317,720	4,549,017,902	0.08

(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7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
株式	インド	174,191,921,081	19.67
	台湾	161,475,425,527	18.24
	香港	157,949,913,002	17.84
	韓国	103,947,247,725	11.74
	ブラジル	37,284,988,425	4.21
	サウジアラビア	35,173,400,922	3.97
	中国	33,172,194,488	3.75
	南アフリカ	26,328,064,708	2.97
	アメリカ	20,894,571,254	2.36
	メキシコ	17,370,835,274	1.96
	インドネシア	14,379,033,054	1.62
	マレーシア	12,227,172,361	1.38
	タイ	11,829,838,867	1.34
	アラブ首長国連邦	9,983,678,609	1.13
	ポーランド	7,826,157,758	0.88
	カタール	6,944,989,062	0.78
	クウェート	6,719,983,001	0.76
	トルコ	6,591,501,503	0.74
	フィリピン	4,667,577,297	0.53
	ギリシャ	4,526,905,853	0.51
チリ	3,601,899,489	0.41	
ハンガリー	2,126,585,619	0.24	
チェコ	1,171,101,923	0.13	
コロンビア	893,916,196	0.10	
小計		861,278,902,998	97.27
投資証券	メキシコ	947,383,975	0.11

コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	23,244,302,243	2.62
純資産総額		885,470,589,216	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7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	建別	国/地域	時価合計	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	24,715,365,494	2.79

(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7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・ 半導体製 造装置	18,737,000	3,779.18	70,810,662,906	4,359.15	81,677,505,972	9.22
香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア ・エンタ	5,034,300	7,252.22	36,509,886,639	6,898.73	34,730,306,645	3.92
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	3,638,140	8,775.87	31,927,861,982	8,950.50	32,563,172,070	3.68
香港	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	11,875,700	1,516.66	18,011,497,557	1,486.66	17,655,151,913	1.99
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギ ー	2,323,730	5,186.21	12,051,359,699	5,538.12	12,869,116,501	1.45
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	3,985,940	2,059.31	8,208,320,875	2,213.29	8,822,055,093	1.00
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・ 半導体製 造装置	419,762	20,266.10	8,506,940,923	20,873.45	8,761,881,119	0.99
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	9,556,272	800.03	7,645,332,680	908.93	8,685,986,131	0.98
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウ ェア・サ ービス	2,494,977	2,626.35	6,552,691,059	3,435.18	8,570,706,318	0.97
アメリカ	株式	PDD HOLDINGS INC	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	455,886	20,821.99	9,492,456,853	18,774.51	8,559,036,448	0.97
香港	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サ ービス	3,896,420	2,310.61	9,003,143,002	2,075.86	8,088,438,007	0.91

香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	74,076,550	109.70	8,126,720,362	105.93	7,847,617,853	0.89
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	1,170,236	5,178.19	6,059,712,505	5,819.93	6,810,699,795	0.77
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	2,100,874	2,651.54	5,570,567,104	2,956.45	6,211,142,593	0.70
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	679,483	7,123.61	4,840,374,605	7,988.59	5,428,111,439	0.61
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	1,478,604	3,221.95	4,763,992,170	3,459.50	5,115,230,538	0.58
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	1,696,401	2,393.51	4,060,363,455	2,690.74	4,564,574,875	0.52
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	632,998	7,173.52	4,540,829,423	6,961.50	4,406,615,577	0.50
ブラジル	株式	VALE SA	素材	2,610,029	1,737.97	4,536,169,766	1,634.25	4,265,440,833	0.48
香港	株式	NETEASE INC	メディア・エンターテインメント	1,508,895	2,966.83	4,476,643,351	2,782.12	4,197,936,011	0.47
香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	62,449,000	72.64	4,536,416,569	67.11	4,191,227,166	0.47
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	42,970,200	88.62	3,808,303,047	95.64	4,109,884,779	0.46
香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	48,677,350	88.07	4,287,499,937	84.28	4,102,682,826	0.46
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	137,190	31,228.06	4,284,178,259	28,874.31	3,961,266,644	0.45
インド	株式	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	自動車・自動車部品	702,072	4,089.66	2,871,237,973	5,347.44	3,754,290,002	0.42
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	11,615,800	376.03	4,367,963,261	318.40	3,698,507,891	0.42
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	1,712,951	2,068.30	3,542,898,809	2,141.09	3,667,599,386	0.41
インド	株式	LARSEN & TOUBRO LTD	資本財	523,254	6,039.37	3,160,125,518	6,925.90	3,624,009,849	0.41
香港	株式	JD.COM INC-CLASS A	一般消費財・サービス流通・小売り	1,816,983	2,437.67	4,429,219,208	1,993.92	3,622,922,377	0.41
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	3,609,800	1,122.01	4,050,246,159	994.60	3,590,334,875	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7月31日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	エネルギー	5.03
	素材	6.62
	資本財	4.84
	商業・専門サービス	0.03
	運輸	1.86
	自動車・自動車部品	3.87

	耐久消費財・アパレル	1.03
	消費者サービス	2.25
	メディア・娯楽	5.86
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.84
	生活必需品流通・小売り	1.28
	食品・飲料・タバコ	3.08
	家庭用品・パーソナル用品	0.79
	ヘルスケア機器・サービス	0.87
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.50
	銀行	16.46
	金融サービス	2.69
	保険	2.67
	ソフトウェア・サービス	2.59
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.86
	電気通信サービス	2.60
	公益事業	2.93
	半導体・半導体製造装置	12.36
	不動産管理・開発	1.34
	小計	97.27
投資証券	—	0.11
合計		97.37

(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7月31日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額(円)	評価金額	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	ニューヨーク証券取引所	MINI MS 2409	買建	3,024	アメリカドル	166,484,865.4	25,378,952,881	162,131,760	24,715,365,494	2.79

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

日本債券インデックスマザーファンド

投資状況

2024年7月31日現在

(単位:円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率(%)
-------	------	------	---------

国債証券	日本	795,961,579,060	83.23
地方債証券	日本	49,644,773,592	5.19
特殊債券	日本	39,550,285,386	4.14
社債券	日本	58,910,064,000	6.16
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	12,267,079,046	1.28
純資産総額		956,333,781,084	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7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	建別	国/地域	時価合計	投資比率 (%)
債券先物取引	買建	日本	3,282,560,000	0.34

(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7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	12,670,000,000	99.22	12,571,334,900	99.07	12,553,309,300	0.005000	2026/9/20	1.31
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	11,290,000,000	97.08	10,960,643,400	96.55	10,900,946,600	0.100000	2030/6/20	1.14
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	10,970,000,000	95.39	10,464,398,200	94.85	10,405,374,100	0.100000	2031/12/20	1.09
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	10,130,000,000	95.20	9,644,627,100	94.62	9,585,107,300	0.200000	2032/9/20	1.00
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	9,860,000,000	97.09	9,573,841,800	96.44	9,509,772,800	0.500000	2033/3/20	0.99
日本	国債証券	第373回利付国債(10年)	9,780,000,000	97.03	9,489,694,800	96.40	9,428,115,600	0.600000	2033/12/20	0.99
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	9,580,000,000	97.53	9,343,716,000	97.14	9,306,491,000	0.100000	2029/9/20	0.97
日本	国債証券	第163回利付国債(5年)	9,330,000,000	99.60	9,293,548,500	99.21	9,256,479,600	0.400000	2028/9/20	0.97
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	9,520,000,000	95.97	9,137,000,000	95.49	9,091,028,800	0.100000	2031/6/20	0.95
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	9,510,000,000	96.00	9,129,633,600	95.29	9,062,839,800	0.400000	2033/6/20	0.95
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	9,370,000,000	97.27	9,114,329,000	96.69	9,060,040,400	0.500000	2032/12/20	0.95
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	9,360,000,000	96.48	9,030,528,000	96.06	8,991,871,200	0.100000	2030/12/20	0.94
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	9,240,000,000	97.29	8,990,506,500	96.77	8,941,917,600	0.100000	2030/3/20	0.94
日本	国債証券	第158回利付国債	9,040,000,000	98.73	8,925,741,400	98.41	8,896,625,600	0.100000	2028/3/20	0.93

		債(5年)								
日本	国債証券	第372回利付国債(10年)	8,570,000,000	99.12	8,495,293,500	98.44	8,437,079,300	0.800000	2033/9/20	0.88
日本	国債証券	第168回利付国債(5年)	8,300,000,000	99.80	8,284,110,000	99.86	8,288,712,000	0.600000	2029/3/20	0.87
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	8,390,000,000	95.54	8,016,141,600	94.95	7,966,388,900	0.200000	2032/6/20	0.83
日本	国債証券	第156回利付国債(5年)	8,050,000,000	99.23	7,988,498,000	98.91	7,962,899,000	0.200000	2027/12/20	0.83
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	7,430,000,000	99.05	7,359,777,000	98.93	7,351,019,100	0.005000	2026/12/20	0.77
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	7,200,000,000	99.30	7,149,976,000	99.20	7,142,760,000	0.005000	2026/6/20	0.75
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	7,440,000,000	96.28	7,163,641,200	95.80	7,127,668,800	0.100000	2031/3/20	0.75
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	7,220,000,000	98.85	7,137,496,000	98.63	7,121,374,800	0.005000	2027/6/20	0.74
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	7,210,000,000	95.72	6,901,879,700	95.27	6,869,111,200	0.200000	2032/3/20	0.72
日本	国債証券	第460回利付国債(2年)	6,700,000,000	99.90	6,693,722,000	99.81	6,687,739,000	0.300000	2026/5/1	0.70
日本	国債証券	第457回利付国債(2年)	6,510,000,000	99.66	6,488,217,400	99.61	6,484,676,100	0.100000	2026/2/1	0.68
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,530,000,000	98.73	6,447,134,300	98.41	6,426,434,200	0.100000	2028/3/20	0.67
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	6,640,000,000	96.84	6,430,594,400	96.32	6,396,112,800	0.100000	2030/9/20	0.67
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	6,410,000,000	99.87	6,401,731,100	99.76	6,394,744,200	0.100000	2025/9/20	0.67
日本	国債証券	第458回利付国債(2年)	6,400,000,000	99.82	6,388,544,000	99.72	6,382,336,000	0.200000	2026/3/1	0.67
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	6,340,000,000	99.35	6,299,107,000	99.16	6,286,807,400	0.100000	2026/12/20	0.66

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	83.23
地方債証券	5.19
特殊債券	4.14
社債券	6.16
合計	98.72

(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7月31日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
-------	------	-------	----	----	----	----------	----------	----------

債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物24年09月限	買建	23	円	3,298,801,505	3,282,560,000	0.34
--------	-------	---------------	----	----	---	---------------	---------------	------

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

外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

2024年7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	301,472,073,180	46.05
	中国	65,912,051,632	10.07
	フランス	49,227,851,314	7.52
	イタリア	45,896,925,032	7.01
	ドイツ	38,954,600,194	5.95
	イギリス	34,020,034,204	5.20
	スペイン	31,221,979,195	4.77
	カナダ	12,580,639,008	1.92
	ベルギー	10,576,947,038	1.62
	オランダ	9,619,952,275	1.47
	オーストラリア	8,066,160,933	1.23
	オーストリア	7,502,965,629	1.15
	メキシコ	4,860,639,138	0.74
	ポーランド	3,516,151,366	0.54
	フィンランド	3,512,068,087	0.54
	マレーシア	3,235,368,326	0.49
	アイルランド	3,160,231,761	0.48
	シンガポール	2,558,194,056	0.39
	イスラエル	2,044,710,980	0.31
	デンマーク	1,600,187,295	0.24
ニュージーランド	1,550,969,037	0.24	
スウェーデン	1,007,199,509	0.15	
ノルウェー	988,398,818	0.15	
	小計	643,086,298,007	98.22
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	11,635,393,189	1.78
純資産総額		654,721,691,196	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7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	4 T-NOTE 340215	25,750,000	14,640.68	3,769,975,834	15,071.31	3,880,863,390	4.000000	2034/2/15	0.59
アメリカ	国債証券	4.5 T-NOTE 331115	19,430,000	15,228.51	2,958,901,019	15,662.01	3,043,130,317	4.500000	2033/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	4.625 T-NOTE 260228	19,800,000	15,166.88	3,003,043,595	15,266.33	3,022,733,343	4.625000	2026/2/28	0.46
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 301115	22,310,000	12,171.38	2,715,435,156	12,580.46	2,806,702,481	0.875000	2030/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	3.875 T-NOTE 330815	18,320,000	14,513.65	2,658,902,056	14,940.01	2,737,010,407	3.875000	2033/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	2.375 T-NOTE 270515	18,570,000	14,281.53	2,652,080,505	14,515.14	2,695,462,658	2.375000	2027/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	3.5 T-NOTE 330215	17,690,000	14,137.32	2,500,892,130	14,557.72	2,575,261,070	3.500000	2033/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 311115	20,320,000	12,239.26	2,487,018,566	12,652.22	2,570,931,568	1.375000	2031/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 310815	19,990,000	12,214.85	2,441,748,600	12,623.04	2,523,346,566	1.250000	2031/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	4.125 T-NOTE 321115	16,070,000	14,833.12	2,383,683,449	15,263.35	2,452,820,780	4.125000	2032/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	3.375 T-NOTE 330515	16,800,000	13,970.68	2,347,075,798	14,399.32	2,419,087,021	3.375000	2033/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 320815	17,340,000	13,410.25	2,325,338,036	13,835.71	2,399,113,229	2.750000	2032/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 320515	17,030,000	13,581.45	2,312,921,147	14,004.82	2,385,022,474	2.875000	2032/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 310515	17,540,000	12,651.66	2,219,102,293	13,050.59	2,289,073,631	1.625000	2031/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 320215	16,860,000	12,643.88	2,131,759,119	13,060.41	2,201,986,146	1.875000	2032/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	4.625 T-NOTE 290430	14,050,000	15,429.34	2,167,822,967	15,618.25	2,194,364,417	4.625000	2029/4/30	0.34
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 310215	17,120,000	12,311.91	2,107,799,313	12,712.96	2,176,458,754	1.125000	2031/2/15	0.33
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300815	17,350,000	12,045.73	2,089,935,420	12,463.16	2,162,358,408	0.625000	2030/8/15	0.33
アメリカ	国債証券	3.125 T-NOTE 281115	14,380,000	14,370.10	2,066,421,018	14,673.54	2,110,055,175	3.125000	2028/11/15	0.32
アメリカ	国債証券	4.25 T-NOTE 251231	13,580,000	15,071.31	2,046,684,457	15,173.43	2,060,552,730	4.250000	2025/12/31	0.31
アメリカ	国債証券	4.25 T-NOTE 260131	13,390,000	15,098.65	2,021,710,395	15,177.30	2,032,241,474	4.250000	2026/1/31	0.31
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 280831	14,930,000	13,218.33	1,973,497,696	13,560.31	2,024,554,593	1.125000	2028/8/31	0.31
アメリカ	国債証券	4.5 T-NOTE 270415	13,000,000	15,170.16	1,972,121,044	15,351.77	1,995,731,375	4.500000	2027/4/15	0.30
アメリカ	国債証券	4.25 T-BOND 540215	13,340,000	14,275.31	1,904,327,055	14,853.37	1,981,439,890	4.250000	2054/2/15	0.30
アメリカ	国債証券	0.75 T-NOTE 260331	13,590,000	14,123.03	1,919,319,779	14,337.99	1,948,533,432	0.750000	2026/3/31	0.30
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 270131	13,540,000	14,006.91	1,896,536,119	14,261.47	1,931,003,937	1.500000	2027/1/31	0.29
アメリカ	国債証券	4.5 T-NOTE 270515	12,500,000	15,226.46	1,903,308,675	15,360.11	1,920,014,555	4.500000	2027/5/15	0.29
中国	国債証券	2.39 CHINA GOVT 261115	88,000,000	2,126.65	1,871,456,955	2,137.48	1,880,988,525	2.390000	2026/11/15	0.29
アメリカ	国債証券	4 T-NOTE 270115	12,300,000	14,970.67	1,841,393,616	15,149.91	1,863,439,650	4.000000	2027/1/15	0.28
アメリカ	国債証券	4.125 T-NOTE 310331	12,100,000	14,905.76	1,803,598,053	15,294.61	1,850,648,390	4.125000	2031/3/31	0.28

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.22
合計	98.22

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

新興国債券インデックスマザーファンド

投資状況

2024年7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
国債証券	マレーシア	9,885,314,214	9.87
	インドネシア	9,784,361,903	9.77
	中国	9,644,557,700	9.63
	メキシコ	9,372,739,330	9.36
	タイ	9,357,524,499	9.35
	ブラジル	8,491,295,128	8.48
	南アフリカ	8,471,792,609	8.46
	ポーランド	7,712,193,762	7.70
	チェコ	5,932,761,413	5.93
	コロンビア	4,198,435,279	4.19
	ルーマニア	3,840,666,175	3.84
	ハンガリー	2,914,590,541	2.91
	ペルー	1,897,929,118	1.90
	チリ	1,760,515,300	1.76
	トルコ	1,453,492,488	1.45
	インド	844,766,155	0.84
	セルビア	353,111,624	0.35
	ウルグアイ	173,816,550	0.17
	ドミニカ共和国	135,695,317	0.14
	小計	96,225,559,105	96.12
コール・ローン、その他資産	—	3,888,726,747	3.88

(負債控除後)			
純資産総額		100,114,285,852	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7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限(年/月/日)	投資比率(%)
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 260701	65,800,000	2,166.08	1,425,282,024	2,190.46	1,441,327,559	—	2026/7/1	1.44
ブラジル	国債証券	10(IN) BRAZIL NTN 290101	50,900,000	2,679.25	1,363,739,028	2,562.09	1,304,107,872	10.000000	2029/1/1	1.30
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 260101	54,700,000	2,273.38	1,243,543,885	2,319.19	1,268,599,665	—	2026/1/1	1.27
ブラジル	国債証券	10(IN)BRAZIL NT 270101	44,870,000	2,725.52	1,222,942,461	2,636.86	1,183,161,211	10.000000	2027/1/1	1.18
南アフリカ	国債証券	8.75 SOUTH AFRICA 480228	166,000,000	606.74	1,007,198,901	643.05	1,067,467,648	8.750000	2048/2/28	1.07
南アフリカ	国債証券	8 SOUTH AFRICA 300131	132,200,000	767.35	1,014,448,201	780.47	1,031,792,445	8.000000	2030/1/31	1.03
南アフリカ	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	118,600,000	866.25	1,027,384,178	869.44	1,031,155,840	10.500000	2026/12/21	1.03
メキシコ	国債証券	5.75 MEXICAN BONO 260305	135,200,000	748.23	1,011,609,974	752.96	1,018,009,254	5.750000	2026/3/5	1.02
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 250701	40,800,000	2,387.30	974,020,529	2,462.23	1,004,591,303	—	2025/7/1	1.00
メキシコ	国債証券	5.5 MEXICAN BONOS 270304	134,200,000	724.34	972,073,126	727.35	976,110,860	5.500000	2027/3/4	0.97
メキシコ	国債証券	7.75 MEXICAN BONO 310529	133,500,000	743.71	992,863,659	729.81	974,306,839	7.750000	2031/5/29	0.97
南アフリカ	国債証券	8.25 SOUTH AFRICA 320331	129,200,000	725.80	937,734,257	744.05	961,322,419	8.250000	2032/3/31	0.96
南アフリカ	国債証券	8.875 SOUTH AFRIC 350228	131,500,000	699.04	919,243,170	723.13	950,919,632	8.875000	2035/2/28	0.95
南アフリカ	国債証券	8.5 SOUTH AFRICA 370131	121,440,000	648.40	787,417,434	674.62	819,267,272	8.500000	2037/1/31	0.82
チェコ	国債証券	0.25 CZECH REPUB 270210	133,500,000	582.46	777,588,997	596.27	796,028,692	0.250000	2027/2/10	0.80
ポーランド	国債証券	6 POLAND 331025	19,700,000	4,024.14	792,755,680	3,989.05	785,844,118	6.000000	2033/10/25	0.78
マレーシア	国債証券	3.885 MALAYSIAGOV 290815	23,200,000	3,339.20	774,694,656	3,354.82	778,318,928	3.885000	2029/8/15	0.78
ポーランド	国債証券	7.5 POLAND 280725	18,500,000	4,197.14	776,472,417	4,150.02	767,754,159	7.500000	2028/7/25	0.77
マレーシア	国債証券	4.696 MALAYSIAGOV 421015	21,040,000	3,558.10	748,625,210	3,583.33	753,932,870	4.696000	2042/10/15	0.75
メキシコ	国債証券	7.75 MEXICAN BONO 421113	113,900,000	686.31	781,716,441	657.33	748,703,526	7.750000	2042/11/13	0.75
メキシコ	国債証券	7.5 MEXICAN BONOS 270603	98,200,000	767.94	754,123,196	762.40	748,686,119	7.500000	2027/6/3	0.75
チェコ	国債証券	5 CZECH REPUBLIC 300930	103,700,000	692.21	717,831,008	700.27	726,187,033	5.000000	2030/9/30	0.73
チェコ	国債証券	5.5 CZECH REPUBLI 281212	102,000,000	699.37	713,363,246	699.95	713,951,088	5.500000	2028/12/12	0.71

メキシコ	国債証券	7.5 MEXICAN BONOS 330526	101,800,000	717.55	730,467,948	701.19	713,814,798	7.500000	2033/5/26	0.71
ポーランド	国債証券	2.75 POLAND 291025	20,800,000	3,403.92	708,016,293	3,407.82	708,827,034	2.750000	2029/10/25	0.71
ポーランド	国債証券	2.5 POLAND 260725	19,000,000	3,624.36	688,629,005	3,666.14	696,568,127	2.500000	2026/7/25	0.70
メキシコ	国債証券	8.5 MEXICAN BONOS 290531	89,100,000	786.85	701,091,575	771.41	687,332,835	8.500000	2029/5/31	0.69
マレーシア	国債証券	3.955 MALAYSIAGOV 250915	20,600,000	3,330.76	686,137,150	3,329.35	685,847,795	3.955000	2025/9/15	0.69
南アフリカ	国債証券	8.75 SOUTH AFRICA 440131	105,700,000	617.80	653,023,504	646.50	683,356,419	8.750000	2044/1/31	0.68
マレーシア	国債証券	3.906 MALAYSIAGOV 260715	20,300,000	3,339.95	678,009,982	3,339.83	677,986,778	3.906000	2026/7/15	0.68

(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7月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	96.12
合計	96.12

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

東証REIT指数マザーファンド

投資状況

2024年7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
投資証券	日本	119,402,928,500	98.56
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	1,740,340,894	1.44
純資産総額		121,143,269,394	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7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	1,719,350,000	1.42

(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7月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	14,006	590,973.49	8,277,174,700	579,000	8,109,474,000	6.69
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	12,332	557,908	6,880,121,456	520,000	6,412,640,000	5.29
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	38,824	157,937.87	6,131,779,864	147,700	5,734,304,800	4.73
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	60,484	98,050.15	5,930,465,382	93,600	5,661,302,400	4.67
日本	投資証券	GLP投資法人	40,327	131,289.41	5,294,508,037	131,400	5,298,967,800	4.37
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	33,588	159,580.08	5,359,975,727	154,600	5,192,704,800	4.29
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	20,915	266,746.9	5,579,011,413	247,100	5,168,096,500	4.27
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	66,149	62,347.35	4,124,215,384	68,100	4,504,746,900	3.72
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	18,097	253,330.94	4,584,530,021	242,100	4,381,283,700	3.62
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	26,856	149,599.96	4,017,656,525	143,400	3,851,150,400	3.18
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	23,922	168,584.49	4,032,878,169	156,100	3,734,224,200	3.08
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	11,799	328,716.91	3,878,530,821	315,000	3,716,685,000	3.07
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	44,104	76,395.41	3,369,343,162	76,800	3,387,187,200	2.80
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	36,077	78,401.76	2,828,500,295	79,300	2,860,906,100	2.36
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	21,982	134,354.11	2,953,372,225	123,600	2,716,975,200	2.24
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	8,211	349,230.97	2,867,535,494	326,500	2,680,891,500	2.21
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,146	610,638.45	2,531,707,013	642,000	2,661,732,000	2.20
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	15,381	149,767.27	2,303,570,379	148,200	2,279,464,200	1.88
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	5,006	457,162.21	2,288,554,023	422,500	2,115,035,000	1.75
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	8,067	278,520.15	2,246,822,109	256,200	2,066,765,400	1.71
日本	投資証券	アクティブア・プロパティーズ投資法人	5,836	403,032.64	2,352,098,487	353,500	2,063,026,000	1.70
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,455	431,639.99	1,922,956,155	434,500	1,935,697,500	1.60
日本	投資証券	イオンリート投資法人	14,727	140,546.94	2,069,834,785	129,600	1,908,619,200	1.58
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,912	314,752.46	1,860,816,544	311,500	1,841,588,000	1.52
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	14,118	138,622.66	1,957,074,713	128,600	1,815,574,800	1.50
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	17,732	105,964.33	1,878,959,499	101,900	1,806,890,800	1.49
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	23,142	73,815.12	1,708,229,507	69,800	1,615,311,600	1.33
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	4,146	376,235.05	1,559,870,517	378,500	1,569,261,000	1.30
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	10,609	154,625.65	1,640,423,520	142,700	1,513,904,300	1.25
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	4,974	303,912.09	1,511,658,735	293,400	1,459,371,600	1.20

(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7月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資証券	98.56
合計	98.56

(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7月31日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT 24年09月限	買建	1,004	円	1,707,168,840	1,719,350,000	1.42

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

MUAM G-REITマザーファンド

投資状況

2024年7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	107,150,394,463	76.38
	オーストラリア	9,756,179,618	6.95
	イギリス	6,783,250,145	4.84
	シンガポール	4,064,975,065	2.90
	フランス	2,260,374,927	1.61
	カナダ	1,947,595,112	1.39
	ベルギー	1,392,926,921	0.99
	香港	1,191,110,863	0.85
	スペイン	629,841,867	0.45
	ニュージーランド	372,287,777	0.27
	オランダ	241,432,802	0.17
	韓国	239,354,173	0.17
	イスラエル	126,654,785	0.09
	ガンジー	111,688,242	0.08
	ドイツ	46,720,996	0.03
	アイルランド	34,996,273	0.02
イタリア	7,513,134	0.01	
小計		136,357,297,163	97.20
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	3,922,066,971	2.80

純資産総額	140,279,364,134	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7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	アメリカ	3,883,104,120	2.77

(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7月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	578,556	19,713.54	11,405,387,312	19,221.15	11,120,517,214	7.93
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	59,304	121,192.15	7,187,179,359	117,191.29	6,949,912,784	4.95
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	373,522	13,719.02	5,124,359,395	17,109.86	6,390,911,219	4.56
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	543,786	8,716.32	4,739,818,172	8,897.92	4,838,565,848	3.45
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	203,617	21,462.02	4,370,033,674	23,599.23	4,805,205,718	3.43
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	98,814	45,512.48	4,497,270,831	46,398.16	4,584,788,059	3.27
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	202,763	20,314.15	4,118,958,889	22,109.89	4,483,069,167	3.20
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,079,366	2,456.37	2,651,324,960	3,492.73	3,769,936,708	2.69
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	132,306	23,774.54	3,145,514,607	24,862.96	3,289,519,315	2.34
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	652,459	4,832.46	3,152,982,263	4,789.66	3,125,059,906	2.23
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	183,118	10,301.89	1,886,462,445	15,440.64	2,827,460,507	2.02
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	88,654	28,027.61	2,484,760,482	31,423.98	2,785,861,665	1.99
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	215,323	9,289.69	2,000,284,695	10,605.25	2,283,554,418	1.63
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	252,783	7,452.79	1,883,939,019	8,362.85	2,113,988,435	1.51
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	359,471	5,186.00	1,864,219,770	5,333.87	1,917,373,596	1.37
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	98,370	19,122.07	1,881,038,380	18,143.40	1,784,767,124	1.27
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	40,091	37,187.73	1,490,893,604	42,805.15	1,716,101,349	1.22
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	72,957	20,131.22	1,468,713,884	21,541.29	1,571,588,361	1.12
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	77,882	20,096.16	1,565,129,538	19,396.46	1,510,635,534	1.08
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	834,522	1,695.28	1,414,749,791	1,787.28	1,491,531,824	1.06
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	439,619	2,971.05	1,306,132,492	3,329.28	1,463,618,965	1.04
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	416,715	3,144.83	1,310,500,834	3,358.25	1,399,434,482	1.00
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	168,540	7,352.86	1,239,251,044	7,660.10	1,291,034,939	0.92
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	136,577	9,756.15	1,332,467,064	9,268.35	1,265,843,711	0.90
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	116,370	10,533.60	1,225,795,498	10,449.76	1,216,038,804	0.87
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	440,505	3,000.01	1,321,523,457	2,713.43	1,195,280,363	0.85
アメリカ	投資証券	UDR INC	189,159	5,765.28	1,090,554,751	6,227.17	1,177,926,007	0.84

アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	66,518	14,933.02	993,314,784	17,041.26	1,133,551,038	0.81
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	201,191	5,456.52	1,097,804,323	5,509.18	1,108,397,755	0.79
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	3,234,389	294.96	954,028,317	338.80	1,095,843,337	0.78

(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7月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資証券	97.20
合計	97.20

(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7月31日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額 (円)	評価金額	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産 投信指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ商品 取引所	DJREIT2409	買建	700	アメリカ ドル	23,703,740	3,613,398,126	25,473,000	3,883,104,120	2.77

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

《参考情報》

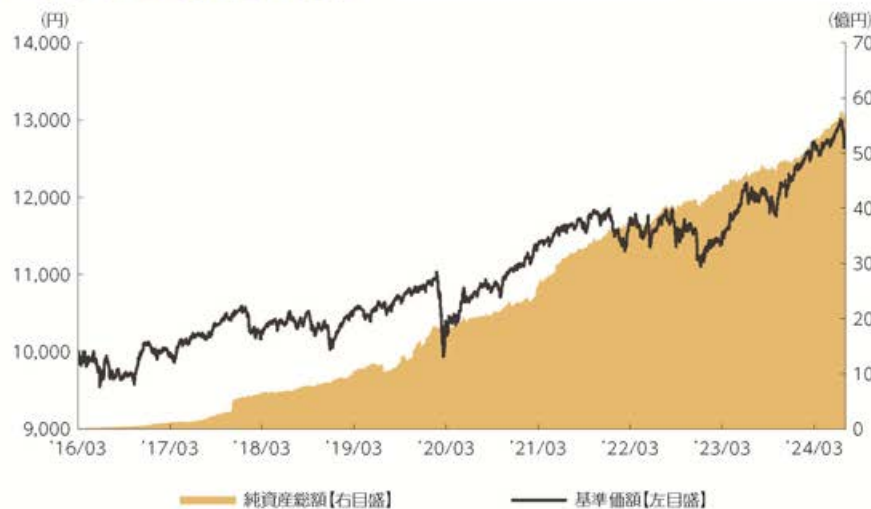


運用実績

2024年7月31日現在

マイゴールキーパー

■基準価額・純資産の推移 2016年3月30日(設定日)～2024年7月31日



■基準価額・純資産

基準価額	12,678円
純資産総額	56.4億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024年 1月	0円
2023年 1月	0円
2022年 1月	0円
2021年 1月	0円
2020年 1月	0円
2019年 1月	0円
設定来累計	0円

●分配金は1万口当たり、税引前

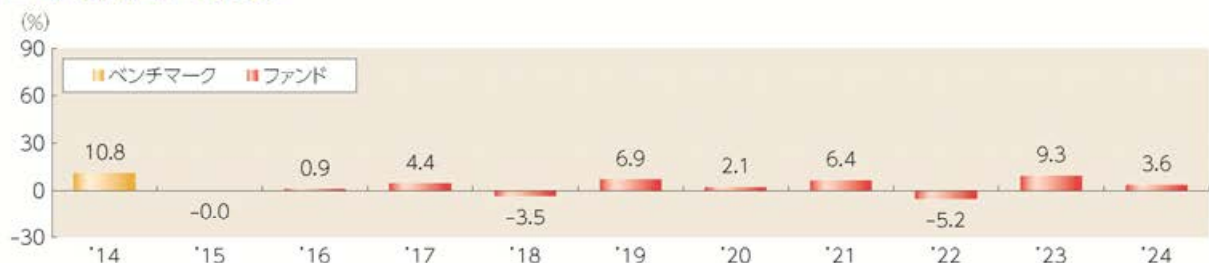
■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	種類	業種/種別	国・地域	比率
国内株式	9.1%	1 円	61.3%	APPLE INC	株式	テクノロジー/ハードウェアおよび機器	アメリカ	0.5%
国内債券	48.5%	2 アメリカドル	21.7%	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.5%
国内リート	2.0%	3 ユーロ	9.2%	NVIDIA CORP	株式	半導体・半導体製造装置	アメリカ	0.4%
外国株式	9.4%	4 中国元	2.7%	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	日本	0.4%
外国債券	26.3%	5 イギリスポンド	1.9%	第149回利付国債(5年)	債券	国債	日本	0.6%
外国リート	2.2%	6 カナダドル	0.9%	第359回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.6%
コールローン他		7 オーストラリアドル	0.7%	第365回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.5%
(負債控除後)	2.5%	8 スイスフラン	0.3%	PROLOGIS INC	リート	-	アメリカ	0.2%
合計	100.0%	9 メキシコペソ	0.2%	日本ビルファンド投資法人	リート	-	日本	0.1%
		10 シンガポールドル	0.2%	EQUINIX INC	リート	-	アメリカ	0.1%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	0.3%
債券先物取引 (買建)	0.2%
不動産投信指数先物取引 (買建)	0.1%

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

■年間収益率の推移

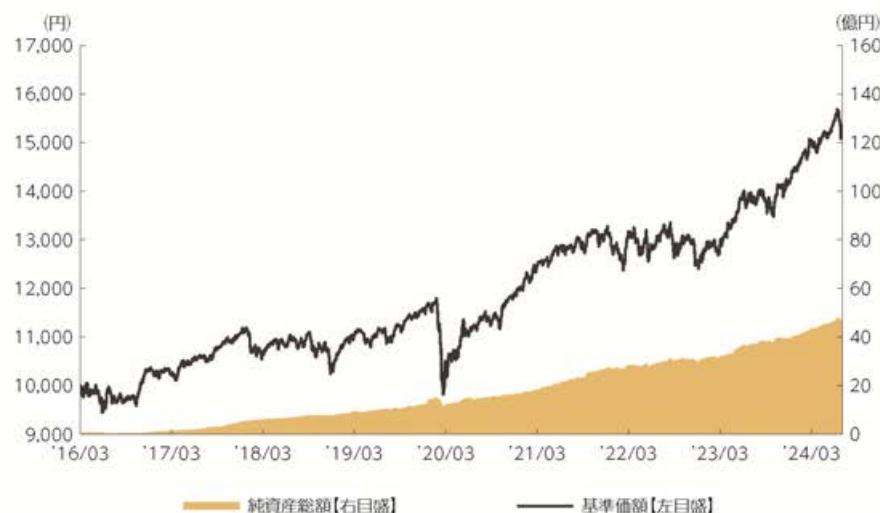


- 収益率は基準価額で計算
- 2016年は設定日から年末までの、2024年は年初から7月31日までの収益率を表示
- 2015年以前はベンチマークの年間収益率を表示

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

マイディフェンダー

■基準価額・純資産の推移 2016年3月30日(設定日)～2024年7月31日



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

■基準価額・純資産

基準価額	15,143円
純資産総額	46.7億円

•純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024年1月	0円
2023年1月	0円
2022年1月	0円
2021年1月	0円
2020年1月	0円
2019年1月	0円
設定来累計	0円

•分配金は1万口当たり、税引前

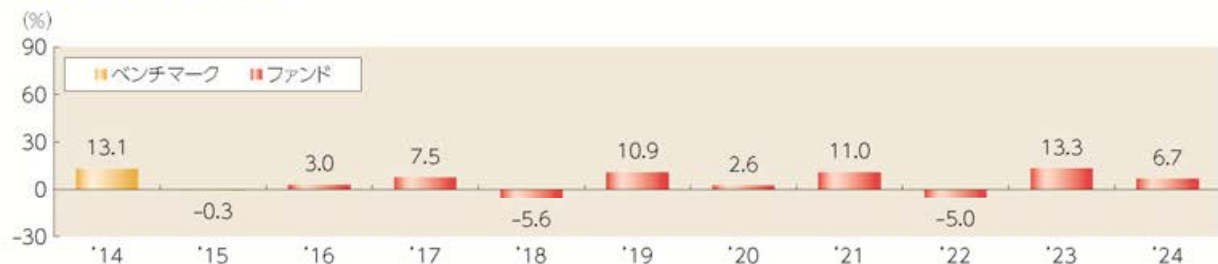
■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	種類	業種/種別	国・地域	比率
国内株式	14.1%	1 円	54.4%	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	0.9%
国内債券	34.6%	2 アメリカドル	25.3%	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.8%
国内リート	4.1%	3 ユーロ	7.2%	NVIDIA CORP	株式	半導体・半導体製造装置	アメリカ	0.7%
外国株式	19.8%	4 中国元	2.2%	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	日本	0.6%
外国債券	20.4%	5 イギリスポンド	1.9%	第149回利付国債(5年)	債券	国債	日本	0.5%
外国リート	4.3%	6 カナダドル	1.0%	第359回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.4%
		7 オーストラリアドル	0.9%	第365回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.4%
コールローン他		8 香港ドル	0.6%	PROLOGIS INC	リート	-	アメリカ	0.4%
(負債控除後)	2.7%	9 インドルピー	0.6%	日本ビルファンド投資法人	リート	-	日本	0.3%
合計	100.0%	10 ニュー台湾ドル	0.5%	EQUINIX INC	リート	-	アメリカ	0.2%

その他資産の状況	比率
株指先物取引 (買建)	0.7%
債券先物取引 (買建)	0.1%
不動産投信先物取引 (買建)	0.2%

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

■年間収益率の推移

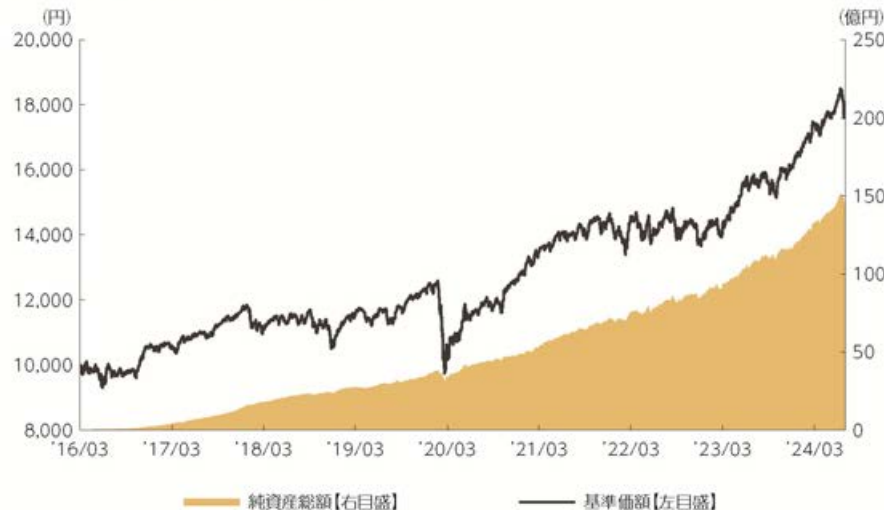


- 収益率は基準価額で計算
- 2016年は設定日から年末までの、2024年は年年初から7月31日までの収益率を表示
- 2015年以前はベンチマークの年間収益率を表示

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

マイミッドフィルダー

■基準価額・純資産の推移 2016年3月30日(設定日)～2024年7月31日



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

■基準価額・純資産

基準価額	17,687円
純資産総額	145.9億円

•純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024年1月	0円
2023年1月	0円
2022年1月	0円
2021年1月	0円
2020年1月	0円
2019年1月	0円
設定来累計	0円

•分配金は1万口当たり、税引前

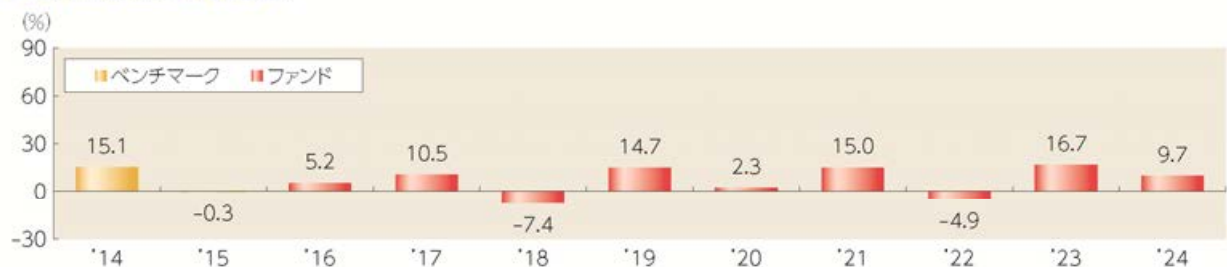
■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	種類	業種/種別	国・地域	比率
国内株式	19.1%	1 円	47.6%	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	1.3%
国内債券	20.9%	2 アメリカドル	29.7%	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.2%
国内リート	6.1%	3 ユーロ	5.9%	NVIDIA CORP	株式	半導体・半導体製造装置	アメリカ	1.0%
外国株式	30.0%	4 イギリスポンド	1.9%	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	日本	0.8%
外国債券	14.5%	5 中国元	1.7%	第149回利付国債(5年)	債券	国債	日本	0.3%
外国リート	6.5%	6 香港ドル	1.2%	第359回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.2%
		7 インドルピー	1.2%	第365回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.2%
コールローン他 (負債控除後)	2.9%	8 カナダドル	1.1%	PROLOGIS INC	リート	-	アメリカ	0.5%
合計	100.0%	9 オーストラリアドル	1.1%	日本ビルファンド投資法人	リート	-	日本	0.4%
		10 ニュー台湾ドル	1.1%	EQUINIX INC	リート	-	アメリカ	0.3%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	1.0%
債券先物取引 (買建)	0.1%
不動産投信指数先物取引 (買建)	0.3%

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

■年間収益率の推移

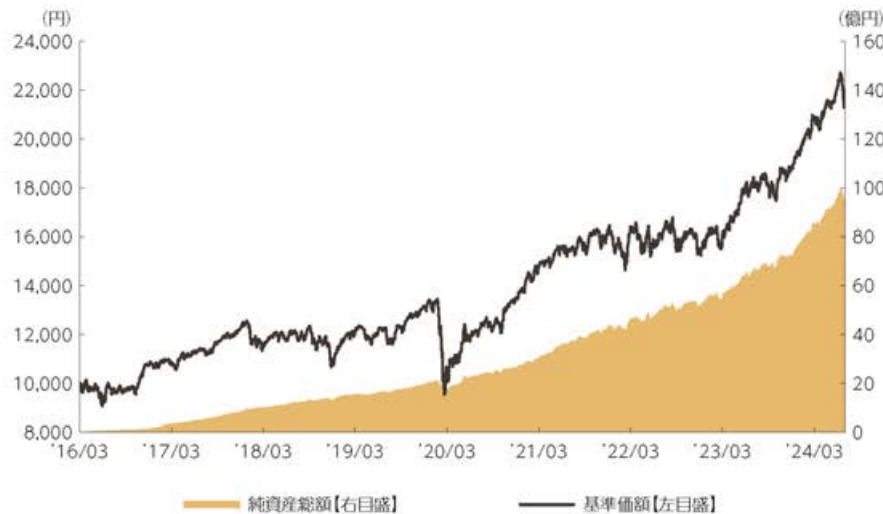


- 収益率は基準価額で計算
- 2016年は設定日から年末までの、2024年は年初から7月31日までの収益率を表示
- 2015年以前はベンチマークの年間収益率を表示

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

マイフォワード

■基準価額・純資産の推移 2016年3月30日(設定日)～2024年7月31日



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

■基準価額・純資産

基準価額	21,441円
純資産総額	95.0億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024年1月	0円
2023年1月	0円
2022年1月	0円
2021年1月	0円
2020年1月	0円
2019年1月	0円
設定来累計	0円

●分配金は1万円当たり、税引前

■主要な資産の状況

資産別構成	比率
国内株式	24.1%
国内債券	2.1%
国内リート	8.2%
外国株式	41.2%
外国債券	12.6%
外国リート	8.7%
コールローン他 (負債控除後)	3.1%
合計	100.0%

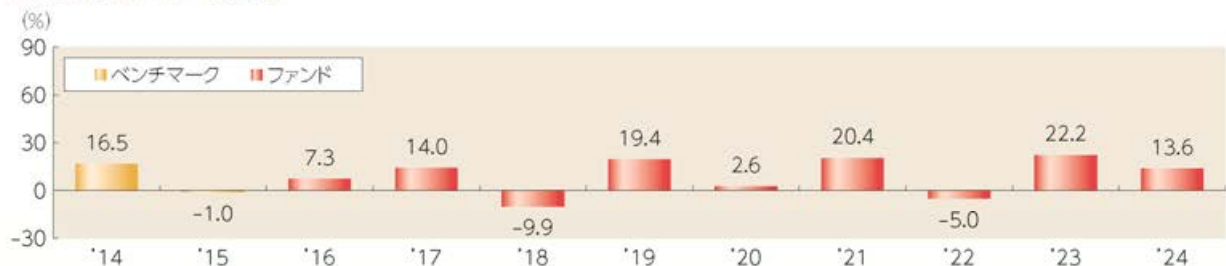
組入上位通貨	比率
1 アメリカドル	35.7%
2 円	35.7%
3 ユーロ	5.4%
4 イギリスポンド	2.1%
5 インドルピー	2.0%
6 香港ドル	2.0%
7 ニュー台湾ドル	1.8%
8 中国元	1.7%
9 オーストラリアドル	1.3%
10 カナダドル	1.3%

組入上位銘柄	種類	業種/種別	国・地域	比率
APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	1.7%
MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.5%
NVIDIA CORP	株式	半導体・半導体製造装置	アメリカ	1.3%
トヨタ自動車	株式	輸送用機器	日本	1.0%
BRAZIL-LTN 260701	債券	国債	ブラジル	0.1%
10(IN) BRAZIL NTN 290101	債券	国債	ブラジル	0.1%
BRAZIL-LTN 260101	債券	国債	ブラジル	0.1%
PROLOGIS INC	リート	-	アメリカ	0.7%
日本ビルファンド投資法人	リート	-	日本	0.6%
EQUINIX INC	リート	-	アメリカ	0.4%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	1.4%
債券先物取引 (買建)	0.0%
不動産投信指数先物取引 (買建)	0.3%

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

■年間収益率の推移

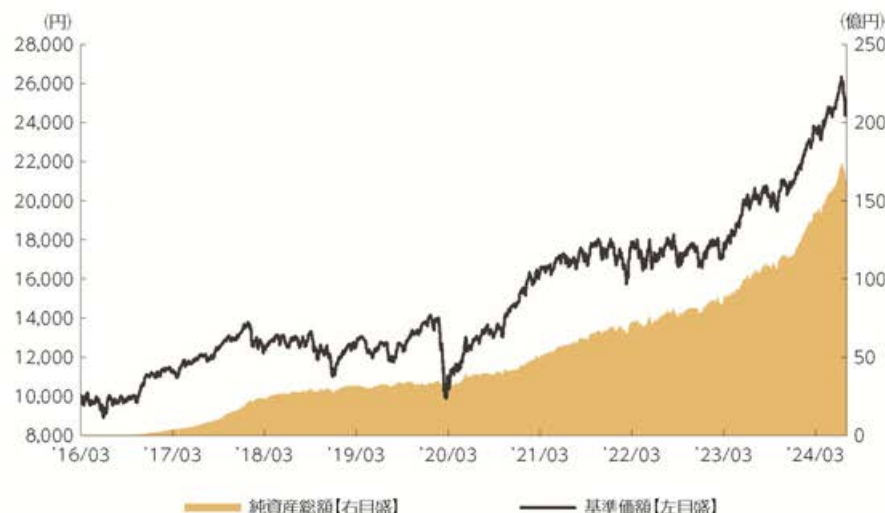


- 収益率は基準価額で計算
- 2016年は設定日から年末までの、2024年は年初から7月31日までの収益率を表示
- 2015年以前はベンチマークの年間収益率を表示

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

マイストライカー

■基準価額・純資産の推移 2016年3月30日(設定日)～2024年7月31日



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

■基準価額・純資産

基準価額	24,480円
純資産総額	163.2億円

•純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024年1月	0円
2023年1月	0円
2022年1月	0円
2021年1月	0円
2020年1月	0円
2019年1月	0円
設定来累計	0円

•分配金は1万口当たり、税引前

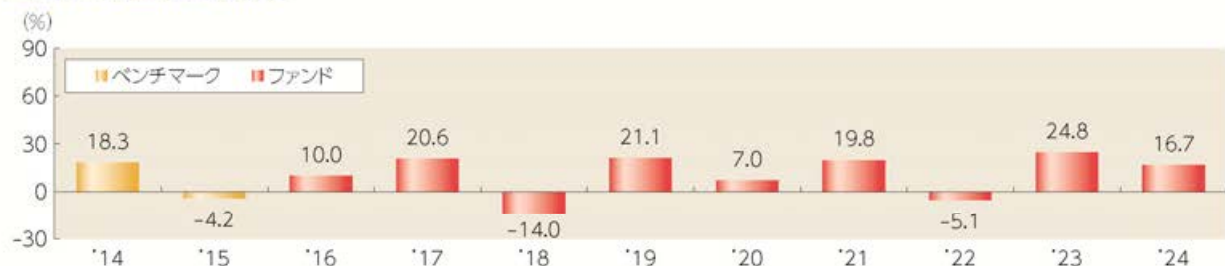
■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	種類	業種/種別	国・地域	比率
国内株式	26.4%	1 アメリカドル	35.0%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	株式	半導体・半導体製造装置	台湾	2.1%
国内債券	0.5%	2 円	30.1%	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	2.1%
国内リート	2.1%	3 インドルピー	4.5%	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.9%
外国株式	61.7%	4 香港ドル	4.3%	NVIDIA CORP	株式	半導体・半導体製造装置	アメリカ	1.7%
外国債券	3.4%	5 ユーロ	4.3%	BRAZIL-LTN 260701	債券	国債	ブラジル	0.0%
外国リート	2.8%	6 ニュー台湾ドル	4.2%	10(IN) BRAZIL NTN 290101	債券	国債	ブラジル	0.0%
コールローン他		7 韓国ウォン	2.7%	BRAZIL-LTN 260101	債券	国債	ブラジル	0.0%
(負債控除後)	3.1%	8 イギリスポンド	1.9%	PROLOGIS INC	リート	—	アメリカ	0.2%
合計	100.0%	9 カナダドル	1.4%	EQUINIX INC	リート	—	アメリカ	0.1%
		10 中国元	1.2%	日本ビルファンド投資法人	リート	—	日本	0.1%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	2.0%
債券先物取引 (買建)	0.0%
不動産投信指数先物取引 (買建)	0.1%

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

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2016年は設定日から年末までの、2024年は年初から7月31日までの収益率を表示
- 2015年以前はベンチマークの年間収益率を表示

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

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、以下の日は申込みできません。

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

香港取引所の休業日

香港の銀行の休業日

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

②申込単位

販売会社が定める単位

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては、1円以上1円単位

③申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

④申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑤申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ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/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.am.mufg.jp/>

⑥申込手数料

ありません。

⑦申込方法

取得申込者は、販売会社取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

なお、申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があります。申込みコースの取扱い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時までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

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

ただし、2024年11月5日以降は、以下の通りとなります。

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時30分までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

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

⑨取得申込みの受付の中止および取消し

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

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

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

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

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

⑩スイッチング

各ファンド間でのスイッチングが可能です。

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

スイッチングを行う場合は、解約金の利益に対して税金がかかります。

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

①解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

ニューヨーク証券取引所の休業日
ニューヨークの銀行の休業日
ロンドン証券取引所の休業日
ロンドンの銀行の休業日
オーストラリア証券取引所の休業日
シドニーの銀行の休業日
その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日
「eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) / (マイミッドフィルダー) / (マイフォワード) / (マイストライカー)」
ニューヨーク証券取引所の休業日
ニューヨークの銀行の休業日
ロンドン証券取引所の休業日
ロンドンの銀行の休業日
香港取引所の休業日
香港の銀行の休業日
オーストラリア証券取引所の休業日
シドニーの銀行の休業日
その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日
受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されません。

②解約単位

販売会社が定める単位

確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については、1口単位

③解約価額

「eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)」

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

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

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差引いた価額

④信託財産留保額

「eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)」

ありません。

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

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.05%をかけた額

「eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード) / (マイストライカー)」

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.10%をかけた額

⑤解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

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/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.am.mufg.jp/>

⑦支払開始日

「eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)」
解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。
「eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) / (マイミッドフィルダー) / (マイフォワード) / (マイストライカー)」
解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して6営業日目から販売会社において支払います。

⑧解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。
確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については上記と異なる取扱いをしている場合があります。

ただし、2024年11月5日以降は、以下の通りとなります。
解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時30分までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。
確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については上記と異なる取扱いをしている場合があります。

⑨解約請求受付の中止および取消し

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

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

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/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.am.mufg.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限（2016年3月30日設定）

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

(4)【計算期間】

毎年1月27日から翌年1月26日まで

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

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

①ファンドの償還条件等

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

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

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

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

②信託約款の変更等

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

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

③ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還（信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたとき、また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の手続を行うことが困難な場合を除きます。）、信託約款の変更または併合（変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面による決議（「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を發します。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 1 月 27 日から 2024 年 1 月 26 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4月3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eMAXIS最適化バランス（マイゴールキーパー）の2023年1月27日から2024年1月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、eMAXIS最適化バランス（マイゴールキーパー）の2024年1月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

【eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 [2023年1月26日現在]	第8期 [2024年1月26日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	56,244,231	65,368,130
親投資信託受益証券	4,108,331,836	4,835,642,260
未収入金	3,783,924	7,326,721
流動資産合計	4,168,359,991	4,908,337,111
資産合計	4,168,359,991	4,908,337,111
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,195,772	10,626,275
未払受託者報酬	1,349,484	1,583,469
未払委託者報酬	9,896,121	11,612,033
未払利息	25	16
その他未払費用	80,911	94,942
流動負債合計	18,522,313	23,916,735
負債合計	18,522,313	23,916,735
純資産の部		
元本等		
元本	3,664,571,956	3,952,438,503
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	485,265,722	931,981,873
（分配準備積立金）	117,941,182	347,272,170
元本等合計	4,149,837,678	4,884,420,376
純資産合計	4,149,837,678	4,884,420,376
負債純資産合計	4,168,359,991	4,908,337,111

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期 自 2022年1月27日 至 2023年1月26日	第8期 自 2023年1月27日 至 2024年1月26日
営業収益		
受取利息	181	516
有価証券売買等損益	△47,483,109	423,592,739
営業収益合計	△47,482,928	423,593,255
営業費用		
支払利息	15,816	21,571
受託者報酬	2,569,305	3,029,343

委託者報酬	18,841,449	22,215,062
その他費用	154,043	181,631
営業費用合計	21,580,613	25,447,607
営業利益又は営業損失(△)	△69,063,541	398,145,648
経常利益又は経常損失(△)	△69,063,541	398,145,648
当期純利益又は当期純損失(△)	△69,063,541	398,145,648
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(△)	6,294,934	55,784,071
期首剰余金又は期首欠損金(△)	470,196,649	485,265,722
剰余金増加額又は欠損金減少額	222,183,256	243,935,963
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	222,183,256	243,935,963
剰余金減少額又は欠損金増加額	131,755,708	139,581,389
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	131,755,708	139,581,389
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	485,265,722	931,981,873

(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、基準額で評価しております。
--------------------	--

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第7期 [2023年1月26日現在]	第8期 [2024年1月26日現在]
1. 期首元本額	3,104,845,029円	3,664,571,956円
期中追加設定元本額	1,422,813,306円	1,287,202,647円
期中一部解約元本額	863,086,379円	999,336,100円
2. 受益権の総数	3,664,571,956口	3,952,438,503口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期 自2022年1月27日 至2023年1月26日			第8期 自2023年1月27日 至2024年1月26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	36,226,496円	費用控除後の配当等収益額	A	68,522,905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	187,631,887円
収益調整金額	C	367,324,540円	収益調整金額	C	584,709,703円
分配準備積立金額	D	81,714,686円	分配準備積立金額	D	91,117,378円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	485,265,722円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	931,981,873円
当ファンドの期末残存口数	F	3,664,571,956口	当ファンドの期末残存口数	F	3,952,438,503口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,324円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,357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7期 自 2022年1月27日 至 2023年1月26日	第8期 自 2023年1月27日 至 2024年1月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	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7期 [2023年1月26日現在]	第8期 [2024年1月26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(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7期 [2023年1月26日現在]	第8期 [2024年1月26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	△61,944,707	368,707,461
合計	△61,944,707	368,707,461

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

(関連当事者との取引に関する注記)
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第7期 [2023年1月26日現在]	第8期 [2024年1月26日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1324円 (11,324円)	1.2358円 (12,358円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	MUAM G-REITマザーファンド	57,075,291	145,970,056	
	東証REIT指数マザーファンド	27,504,631	97,039,088	
	TOPIXマザーファンド	128,295,672	388,928,329	
	外国株式インデックスマザーファンド	79,736,746	496,991,164	
	日本債券インデックスマザーファンド	1,873,154,147	2,387,709,591	
	外国債券インデックスマザーファンド	512,433,579	1,319,004,032	
合計		2,678,200,066	4,835,642,260	

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4月3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eMAXIS最適化バランス（マイディフェンダー）の2023年1月27日から2024年1月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、eMAXIS最適化バランス（マイディフェンダー）の2024年1月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

【eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 [2023年1月26日現在]	第8期 [2024年1月26日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	38,777,852	64,458,238
親投資信託受益証券	3,063,500,795	3,989,981,441
未収入金	811,220	2,752,245
流動資産合計	3,103,089,867	4,057,191,924
資産合計	3,103,089,867	4,057,191,924
負債の部		
流動負債		
未払解約金	141,097	16,213,892
未払受託者報酬	1,013,221	1,281,534
未払委託者報酬	7,430,222	9,397,859
未払利息	17	16
その他未払費用	60,735	76,829
流動負債合計	8,645,292	26,970,130
負債合計	8,645,292	26,970,130
純資産の部		
元本等		
元本	2,426,160,228	2,793,595,429
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	668,284,347	1,236,626,365
（分配準備積立金）	188,344,192	514,777,623
元本等合計	3,094,444,575	4,030,221,794
純資産合計	3,094,444,575	4,030,221,794
負債純資産合計	3,103,089,867	4,057,191,924

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期 自 2022年1月27日 至 2023年1月26日	第8期 自 2023年1月27日 至 2024年1月26日
営業収益		
受取利息	136	387
有価証券売買等損益	18,311,594	456,865,488
営業収益合計	18,311,730	456,865,875
営業費用		
支払利息	12,278	17,257
受託者報酬	1,927,727	2,372,516
委託者報酬	14,136,568	17,398,309
その他費用	115,550	142,222

営業費用合計	16,192,123	19,930,304
営業利益又は営業損失(△)	2,119,607	436,935,571
経常利益又は経常損失(△)	2,119,607	436,935,571
当期純利益又は当期純損失(△)	2,119,607	436,935,571
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(△)	8,048,747	40,705,729
期首剰余金又は期首欠損金(△)	570,217,776	668,284,347
剰余金増加額又は欠損金減少額	212,007,918	314,176,338
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	212,007,918	314,176,338
剰余金減少額又は欠損金増加額	108,012,207	142,064,162
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	108,012,207	142,064,162
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	668,284,347	1,236,626,365

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第7期 [2023年1月26日現在]	第8期 [2024年1月26日現在]
1. 期首元本額	2,090,578,288円	2,426,160,228円
期中追加設定元本額	727,844,011円	862,948,815円
期中一部解約元本額	392,262,071円	495,513,614円
2. 受益権の総数	2,426,160,228口	2,793,595,429口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期 自2022年1月27日 至2023年1月26日			第8期 自2023年1月27日 至2024年1月26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	39,664,336円	費用控除後の配当等収益額	A	69,346,374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	289,061,558円
収益調整金額	C	479,940,155円	収益調整金額	C	721,848,742円
分配準備積立金額	D	148,679,856円	分配準備積立金額	D	156,369,691円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	668,284,347円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,236,626,365円
当ファンドの期末残存口数	F	2,426,160,228口	当ファンドの期末残存口数	F	2,793,595,429口
1万円当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,754円	1万円当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	4,426円
1万円当たり分配金額	H	—円	1万円当たり分配金額	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7期 自 2022年 1月 27日 至 2023年 1月 26日	第8期 自 2023年 1月 27日 至 2024年 1月 26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	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7期 [2023年 1月 26日現在]	第8期 [2024年 1月 26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(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7期 [2023年 1月 26日現在]	第8期 [2024年 1月 26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	4,006,216	417,814,691
合計	4,006,216	417,814,691

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第7期 [2023年1月26日現在]	第8期 [2024年1月26日現在]
1口当たり純資産額	1.2754円	1.4427円
(1万口当たり純資産額)	(12,754円)	(14,427円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	MUAM G-REITマザーファンド	93,671,219	239,564,142	
	新興国株式インデックスマザーファンド	35,478,076	122,111,989	
	東証REIT指数マザーファンド	45,142,333	159,266,665	
	新興国債券インデックスマザーファンド	90,816,773	160,945,485	
	TOPIXマザーファンド	157,971,210	478,889,723	
	外国株式インデックスマザーファンド	111,555,236	695,312,630	
	日本債券インデックスマザーファンド	1,105,939,774	1,409,741,429	
	外国債券インデックスマザーファンド	281,332,315	724,149,378	
合計		1,921,906,936	3,989,981,441	

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4月3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eMAXIS最適化バランス（マイミッドフィルダー）の2023年1月27日から2024年1月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、eMAXIS最適化バランス（マイミッドフィルダー）の2024年1月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

【eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 [2023年1月26日現在]	第8期 [2024年1月26日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	110,651,746	184,228,395
親投資信託受益証券	8,747,016,469	11,894,803,890
未収入金	2,291,418	11,255,749
流動資産合計	8,859,959,633	12,090,288,034
資産合計	8,859,959,633	12,090,288,034
負債の部		
流動負債		
未払解約金	996,183	44,122,583
未払受託者報酬	2,807,098	3,745,613
未払委託者報酬	20,585,295	27,467,771
未払利息	49	47
その他未払費用	168,357	224,677
流動負債合計	24,556,982	75,560,691
負債合計	24,556,982	75,560,691
純資産の部		
元本等		
元本	6,250,452,127	7,293,300,360
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,584,950,524	4,721,426,983
（分配準備積立金）	786,736,339	2,084,981,198
元本等合計	8,835,402,651	12,014,727,343
純資産合計	8,835,402,651	12,014,727,343
負債純資産合計	8,859,959,633	12,090,288,034

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期 自 2022年1月27日 至 2023年1月26日	第8期 自 2023年1月27日 至 2024年1月26日
営業収益		
受取利息	407	1,141
有価証券売買等損益	162,727,127	1,648,016,557
営業収益合計	162,727,534	1,648,017,698
営業費用		
支払利息	32,510	51,021
受託者報酬	5,247,446	6,890,874
委託者報酬	38,481,113	50,532,946
その他費用	314,716	413,332

営業費用合計	44,075,785	57,888,173
営業利益又は営業損失(△)	118,651,749	1,590,129,525
経常利益又は経常損失(△)	118,651,749	1,590,129,525
当期純利益又は当期純損失(△)	118,651,749	1,590,129,525
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△)	19,238,751	135,562,580
期首剰余金又は期首欠損金(△)	1,929,168,052	2,584,950,524
剰余金増加額又は欠損金減少額	781,523,282	1,185,397,044
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	781,523,282	1,185,397,044
剰余金減少額又は欠損金増加額	225,153,808	503,487,530
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	225,153,808	503,487,530
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	2,584,950,524	4,721,426,983

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第7期 [2023年1月26日現在]	第8期 [2024年1月26日現在]
1. 期首元本額	4,952,941,331円	6,250,452,127円
期中追加設定元本額	1,870,039,961円	2,219,666,001円
期中一部解約元本額	572,529,165円	1,176,817,768円
2. 受益権の総数	6,250,452,127口	7,293,300,360口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期 自2022年1月27日 至2023年1月26日			第8期 自2023年1月27日 至2024年1月26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	138,389,682円	費用控除後の配当等収益額	A	241,022,312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	1,180,704,203円
収益調整金額	C	1,798,214,185円	収益調整金額	C	2,636,445,785円
分配準備積立金額	D	648,346,657円	分配準備積立金額	D	663,254,683円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,584,950,524円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,721,426,983円
当ファンドの期末残存口数	F	6,250,452,127口	当ファンドの期末残存口数	F	7,293,300,360口
1万円当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	4,135円	1万円当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	6,473円
1万円当たり分配金額	H	—円	1万円当たり分配金額	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7期 自 2022年 1月 27日 至 2023年 1月 26日	第8期 自 2023年 1月 27日 至 2024年 1月 26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	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7期 [2023年 1月 26日現在]	第8期 [2024年 1月 26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(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7期 [2023年 1月 26日現在]	第8期 [2024年 1月 26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	128,584,601	1,561,159,759
合計	128,584,601	1,561,159,759

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

(関連当事者との取引に関する注記)
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第7期 [2023年1月26日現在]	第8期 [2024年1月26日現在]
1口当たり純資産額	1.4136円	1.6474円
(1万口当たり純資産額)	(14,136円)	(16,474円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	MUAM G-REITマザーファンド	417,450,558	1,067,629,802	
	新興国株式インデックスマザーファンド	209,703,466	721,778,359	
	東証REIT指数マザーファンド	201,173,222	709,759,244	
	新興国債券インデックスマザーファンド	540,095,515	957,157,271	
	TOPIXマザーファンド	589,860,601	1,788,162,411	
	外国株式インデックスマザーファンド	470,474,739	2,932,422,000	
	日本債券インデックスマザーファンド	2,260,834,355	2,881,885,552	
	外国債券インデックスマザーファンド	324,789,919	836,009,251	
合計		5,014,382,375	11,894,803,890	

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4月3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eMAXIS最適化バランス（マイフォワード）の2023年1月27日から2024年1月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、eMAXIS最適化バランス（マイフォワード）の2024年1月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

【eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 [2023年1月26日現在]	第8期 [2024年1月26日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	67,390,056	126,743,348
親投資信託受益証券	5,379,516,267	7,575,621,574
未収入金	1,734,050	63,432
流動資産合計	5,448,640,373	7,702,428,354
資産合計	5,448,640,373	7,702,428,354
負債の部		
流動負債		
未払解約金	237,002	30,943,812
未払受託者報酬	1,728,033	2,321,251
未払委託者報酬	12,672,180	17,022,445
未払利息	30	32
その他未払費用	103,622	139,211
流動負債合計	14,740,867	50,426,751
負債合計	14,740,867	50,426,751
純資産の部		
元本等		
元本	3,413,012,304	3,937,514,952
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,020,887,202	3,714,486,651
（分配準備積立金）	609,667,829	1,654,547,478
元本等合計	5,433,899,506	7,652,001,603
純資産合計	5,433,899,506	7,652,001,603
負債純資産合計	5,448,640,373	7,702,428,354

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期 自 2022年1月27日 至 2023年1月26日	第8期 自 2023年1月27日 至 2024年1月26日
営業収益		
受取利息	243	719
有価証券売買等損益	190,224,814	1,323,263,020
営業収益合計	190,225,057	1,323,263,739
営業費用		
支払利息	21,186	32,881
受託者報酬	3,221,162	4,251,097
委託者報酬	23,621,689	31,174,573
その他費用	193,146	254,941

営業費用合計	27,057,183	35,713,492
営業利益又は営業損失(△)	163,167,874	1,287,550,247
経常利益又は経常損失(△)	163,167,874	1,287,550,247
当期純利益又は当期純損失(△)	163,167,874	1,287,550,247
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(△)	21,929,237	127,160,561
期首剰余金又は期首欠損金(△)	1,455,851,349	2,020,887,202
剰余金増加額又は欠損金減少額	648,067,846	1,007,255,549
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	648,067,846	1,007,255,549
剰余金減少額又は欠損金増加額	224,270,630	474,045,786
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	224,270,630	474,045,786
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	2,020,887,202	3,714,486,651

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第7期 [2023年1月26日現在]	第8期 [2024年1月26日現在]
1. 期首元本額	2,718,190,444円	3,413,012,304円
期中追加設定元本額	1,108,556,067円	1,299,340,431円
期中一部解約元本額	413,734,207円	774,837,783円
2. 受益権の総数	3,413,012,304口	3,937,514,952口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期 自2022年1月27日 至2023年1月26日			第8期 自2023年1月27日 至2024年1月26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	113,697,484円	費用控除後の配当等収益額	A	180,201,151円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	27,541,153円	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	980,188,535円
収益調整金額	C	1,411,219,373円	収益調整金額	C	2,059,939,173円
分配準備積立金額	D	468,429,192円	分配準備積立金額	D	494,157,792円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,020,887,202円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,714,486,651円
当ファンドの期末残存口数	F	3,413,012,304口	当ファンドの期末残存口数	F	3,937,514,952口
1万円当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	5,921円	1万円当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	9,433円
1万円当たり分配金額	H	—円	1万円当たり分配金額	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7期 自 2022年 1月 27日 至 2023年 1月 26日	第8期 自 2023年 1月 27日 至 2024年 1月 26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	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7期 [2023年 1月 26日現在]	第8期 [2024年 1月 26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(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7期 [2023年 1月 26日現在]	第8期 [2024年 1月 26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	171, 720, 247	1, 273, 221, 392
合計	171, 720, 247	1, 273, 221, 392

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第7期 [2023年1月26日現在]	第8期 [2024年1月26日現在]
1口当たり純資産額	1. 5921 円	1. 9434 円
(1万口当たり純資産額)	(15, 921 円)	(19, 434 円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	MUAM G-R E I Tマザーファンド	356, 143, 118	910, 836, 024	
	新興国株式インデックスマザーファンド	225, 272, 658	775, 365, 961	
	東証R E I T指数マザーファンド	171, 204, 247	604, 025, 703	
	新興国債券インデックスマザーファンド	429, 232, 924	760, 686, 587	
	T O P I Xマザーファンド	497, 928, 025	1, 509, 468, 807	
	外国株式インデックスマザーファンド	385, 029, 925	2, 399, 853, 019	
	日本債券インデックスマザーファンド	124, 356, 518	158, 517, 253	
	外国債券インデックスマザーファンド	177, 493, 481	456, 868, 220	
合計		2, 366, 660, 896	7, 575, 621, 574	

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4月3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eMAXIS最適化バランス（マイストライカー）の2023年1月27日から2024年1月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、eMAXIS最適化バランス（マイストライカー）の2024年1月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

【eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 [2023年1月26日現在]	第8期 [2024年1月26日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	103,456,798	208,946,726
親投資信託受益証券	8,249,041,604	12,142,185,589
未収入金	2,863,350	51,932
流動資産合計	8,355,361,752	12,351,184,247
資産合計	8,355,361,752	12,351,184,247
負債の部		
流動負債		
未払解約金	837,851	56,261,290
未払受託者報酬	2,627,178	3,670,687
未払委託者報酬	19,265,930	26,918,313
未払利息	46	53
その他未払費用	157,570	220,180
流動負債合計	22,888,575	87,070,523
負債合計	22,888,575	87,070,523
純資産の部		
元本等		
元本	4,760,733,943	5,643,614,820
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,571,739,234	6,620,498,904
（分配準備積立金）	963,500,725	2,720,261,092
元本等合計	8,332,473,177	12,264,113,724
純資産合計	8,332,473,177	12,264,113,724
負債純資産合計	8,355,361,752	12,351,184,247

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期 自 2022年1月27日 至 2023年1月26日	第8期 自 2023年1月27日 至 2024年1月26日
営業収益		
受取利息	353	1,171
有価証券売買等損益	363,528,578	2,240,108,412
営業収益合計	363,528,931	2,240,109,583
営業費用		
支払利息	31,541	51,573
受託者報酬	4,937,490	6,650,211
委託者報酬	36,208,169	48,768,078
その他費用	296,121	398,891

営業費用合計	41,473,321	55,868,753
営業利益又は営業損失(△)	322,055,610	2,184,240,830
経常利益又は経常損失(△)	322,055,610	2,184,240,830
当期純利益又は当期純損失(△)	322,055,610	2,184,240,830
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(△)	33,729,636	229,810,081
期首剰余金又は期首欠損金(△)	2,651,693,287	3,571,739,234
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,116,579,462	2,022,501,265
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,116,579,462	2,022,501,265
剰余金減少額又は欠損金増加額	484,859,489	928,172,344
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	484,859,489	928,172,344
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	3,571,739,234	6,620,498,904

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第7期 [2023年1月26日現在]	第8期 [2024年1月26日現在]
1. 期首元本額	3,928,586,643円	4,760,733,943円
期中追加設定元本額	1,544,412,998円	2,077,699,068円
期中一部解約元本額	712,265,698円	1,194,818,191円
2. 受益権の総数	4,760,733,943口	5,643,614,820口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期 自2022年1月27日 至2023年1月26日			第8期 自2023年1月27日 至2024年1月26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	162,671,800円	費用控除後の配当等収益額	A	236,195,389円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	125,654,174円	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	1,718,235,360円
収益調整金額	C	2,608,238,509円	収益調整金額	C	3,900,237,812円
分配準備積立金額	D	675,174,751円	分配準備積立金額	D	765,830,343円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,571,739,234円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,620,498,904円
当ファンドの期末残存口数	F	4,760,733,943口	当ファンドの期末残存口数	F	5,643,614,820口
1万円当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	7,502円	1万円当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	11,730円
1万円当たり分配金額	H	—円	1万円当たり分配金額	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7期 自 2022年 1月 27日 至 2023年 1月 26日	第8期 自 2023年 1月 27日 至 2024年 1月 26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	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7期 [2023年 1月 26日現在]	第8期 [2024年 1月 26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(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7期 [2023年 1月 26日現在]	第8期 [2024年 1月 26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	339,032,401	2,155,848,193
合計	339,032,401	2,155,848,193

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

(関連当事者との取引に関する注記)
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第7期 [2023年1月26日現在]	第8期 [2024年1月26日現在]
1口当たり純資産額	1.7502円	2.1731円
(1万口当たり純資産額)	(17,502円)	(21,731円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	MUAM G-REITマザーファンド	141,510,853	361,914,006	
	新興国株式インデックスマザーファンド	933,195,358	3,211,965,102	
	東証REIT指数マザーファンド	70,532,341	248,845,152	
	新興国債券インデックスマザーファンド	204,942,771	363,199,578	
	TOPIXマザーファンド	990,555,948	3,002,870,356	
	外国株式インデックスマザーファンド	751,709,815	4,685,332,105	
	日本債券インデックスマザーファンド	67,705,551	86,304,265	
	外国債券インデックスマザーファンド	70,611,898	181,755,025	
合計		3,230,764,535	12,142,185,589	

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1月26日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	72,840,188,264
株式	1,255,140,150,820
派生商品評価勘定	210,245,700
未収配当金	1,660,274,048
未収利息	246,307
その他未収収益	10,304,786
差入委託証拠金	563,067,892
流動資産合計	1,330,424,477,817
資産合計	1,330,424,477,817
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	98,872,200
前受金	290,258,500
未払金	996,238,760
未払解約金	789,140,304
未払利息	18,619
受入担保金	61,636,051,496
流動負債合計	63,810,579,879
負債合計	63,810,579,879
純資産の部	
元本等	
元本	417,817,127,461
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	848,796,770,477
元本等合計	1,266,613,897,938
純資産合計	1,266,613,897,938
負債純資産合計	1,330,424,477,817

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1月26日現在]
1. 期首	2023年1月27日
期首元本額	366,259,437,339円
期中追加設定元本額	192,381,950,775円
期中一部解約元本額	140,824,260,653円
元本の内訳※	
三菱UFJ トピックスインデックスオープン	6,447,018,234円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	840,780,915円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	3,761,141,819円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	3,598,073,030円
三菱UFJ トピックスオープン(確定拠出年金)	3,565,619,436円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	6,356,443,497円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	35,553,887,762円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	42,242,188,254円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	92,405,749円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	244,937,376円
ファンド・マネジャー(国内株式)	612,208,925円
eMAXIS TOPIXインデックス	6,978,711,056円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,993,275,807円
eMAXIS バランス(波乗り型)	228,954,458円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	2,866,630,004円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	858,983,509円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	1,082,939,793円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	1,052,405,792円
eMAXIS Slim 国内株式(TOPIX)	38,944,512,990円
国内株式セレクション(ラップ向け)	4,601,781,983円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	10,068,792,022円
つみたて日本株式(TOPIX)	8,659,070,945円
つみたて8資産均等バランス	5,019,302,203円
つみたて4資産均等バランス	1,747,997,110円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,638,218円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	4,475,360円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	7,789,488円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	706,699,665円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	894,234,726円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	646,107,976円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	559,296,813円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	1,772,410,850円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	4,027,732,153円
eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)	1,172,977,495円
三菱UFJ DC年金インデックス(国内株式)	4,028,231,985円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	574,783,344円

三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	163,770,540円
国内株式インデックス・オープン (ラップ向け)	19,607,155,130円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	261,577,385円
ラップ向けインデックスf 国内株式	3,966,842,893円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	160,349,292円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	2,710,125,103円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	1,467,640,059円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	45,804,787円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	6,964,475,565円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	145,989,087円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	23,075,486円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	29,710,782円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	1,601,769円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	1,211,727,734円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	2,638,567,745円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	448,561,299円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	1,498,549,889円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	335,496,678円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	15,511,339円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	103,433,057円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	698,350,090円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	128,295,672円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	157,971,210円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	589,860,601円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	497,928,025円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	990,555,948円
三菱UFJ トピックスオープン	976,536,102円
三菱UFJ DCトピックスオープン	7,919,035,586円
三菱UFJ トピックスオープンVA (適格機関投資家限定)	52,966,008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)	4,295,287,317円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型) VA (適格機関投資家限定)	604円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	7,904,229円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,902,061,723円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	69,091,505円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,287,114,079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)	41,935,804,106円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	200,683,429円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	225,958円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	129,085円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	205,706,647円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	359,856,686円
MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)	3,913,205,044円
MUKAM バランス・イノベーション (株式抑制型) (適格機関投資家転売制限付)	3,716,634,839円
MUKAM バランス・イノベーション (リスク抑制型) (適格機関投資家転売制限付)	1,121,022,107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)	500,920,574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)	87,858,660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)	3,480,217,629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)	172,866,220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)	3,179,402,391円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	322,075,532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)	17,337,864,283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)	103,238,774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)	310,244円
日米コアバランス (F O F s 用) (適格機関投資家限定)	123,848,439円
日本株式インデックスファンドS	2,549,588,259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)	333,253,973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)	710,000,989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

三菱UFJ TOPIX・ファンド	5,447,585,274円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	2,728,314円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	6,896,345円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	1,487,796円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	6,058,830円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	471,389,680円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	74,343,277円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	3,030,411円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	25,320,501円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	1,438,650円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	14,619,491円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,578,965,324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)	327,017,765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)	1,404,986,549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)	1,356,780,443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)	1,267,602,997円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	59,531,179,818円
合計	417,817,127,461円
2. 貸付有価証券 貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っております。 株式	57,979,517,320円
3. 受益権の総数	417,817,127,461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 1 月 27 日 至 2024 年 1 月 26 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、新株予約権証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年1月26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。

2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 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 1月26日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		232,891,016,432
合計		232,891,016,432

(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 1月26日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	12,360,851,500	—	12,472,500,000	111,648,500
合計		12,360,851,500	—	12,472,500,000	111,648,500

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[2024年 1月26日現在]
1口当たり純資産額	3.0315円
(1万口当たり純資産額)	(30,315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	18,800	3,895.00	73,226,000	
1332	ニッスイ	496,600	785.90	390,277,940	貸付有価証券 19,200株
1333	マルハニチロ	73,700	2,896.00	213,435,200	
1375	雪国まいたけ	42,300	954.00	40,354,200	
1376	カネコ種苗	15,200	1,434.00	21,796,800	
1377	サカタのタネ	56,500	3,665.00	207,072,500	
1379	ホクト	39,800	1,775.00	70,645,000	
1384	ホクリョウ	3,100	1,048.00	3,248,800	貸付有価証券 200株
1514	住石ホールディングス	51,000	1,780.00	90,780,000	貸付有価証券 20,900株
1515	日鉄鉱業	19,900	5,170.00	102,883,000	貸付有価証券 2,800株
1518	三井松島ホールディングス	29,400	2,837.00	83,407,800	貸付有価証券 4,100株
1605	I N P E X	1,836,800	1,984.50	3,645,129,600	貸付有価証券 70,700株
1662	石油資源開発	57,500	6,020.00	346,150,000	貸付有価証券 7,900株
1663	K&Oエナジーグループ	22,500	2,275.00	51,187,500	貸付有価証券 2,900株
1414	ショーボンドホールディングス	67,600	6,531.00	441,495,600	貸付有価証券 2,700株
1417	ミライト・ワン	164,200	1,911.50	313,868,300	
1419	タマホーム	31,200	4,030.00	125,736,000	
1420	サンヨーホームズ	2,600	760.00	1,976,000	
1429	日本アクア	8,800	963.00	8,474,400	
1430	ファーストコーポレーション	5,400	772.00	4,168,800	
1433	ベステラ	4,800	1,069.00	5,131,200	
1446	キャンディル	3,500	585.00	2,047,500	貸付有価証券 400株
1712	ダイセキ環境ソリューション	4,300	1,092.00	4,695,600	
1716	第一カッター興業	12,700	1,421.00	18,046,700	
1719	安藤・間	287,700	1,157.00	332,868,900	
1720	東急建設	155,600	819.00	127,436,400	貸付有価証券 5,500株
1721	コムシスホールディングス	158,600	3,205.00	508,313,000	貸付有価証券

					23,800株
1726	ビーアールホールディングス	72,800	369.00	26,863,200	
1762	高松コンストラクショングループ	36,900	2,880.00	106,272,000	貸付有価証券 900株
1766	東建コーポレーション	14,300	9,350.00	133,705,000	
1768	ソネック	2,200	945.00	2,079,000	貸付有価証券 500株
1780	ヤマウラ	25,200	1,660.00	41,832,000	
1786	オリエンタル白石	183,900	363.00	66,755,700	
1801	大成建設	325,100	5,294.00	1,721,079,400	貸付有価証券 43,900株
1802	大林組	1,242,400	1,341.50	1,666,679,600	貸付有価証券 32,400株
1803	清水建設	985,100	987.80	973,081,780	
1805	飛島建設	35,800	1,461.00	52,303,800	
1808	長谷工コーポレーション	318,700	1,880.00	599,156,000	
1810	松井建設	32,400	806.00	26,114,400	貸付有価証券 2,400株
1811	銭高組	1,900	4,435.00	8,426,500	貸付有価証券 600株
1812	鹿島建設	770,300	2,591.50	1,996,232,450	
1813	不動テトラ	24,000	2,349.00	56,376,000	
1814	大末建設	5,700	1,406.00	8,014,200	
1815	鉄建建設	24,900	2,080.00	51,792,000	
1820	西松建設	66,300	3,992.00	264,669,600	
1821	三井住友建設	258,600	403.00	104,215,800	貸付有価証券 10,800株
1822	大豊建設	12,000	3,760.00	45,120,000	
1826	佐田建設	9,400	673.00	6,326,200	
1827	ナカノフドー建設	10,500	498.00	5,229,000	
1833	奥村組	56,300	4,980.00	280,374,000	
1835	東鉄工業	43,000	2,994.00	128,742,000	
1847	イチケン	3,600	2,305.00	8,298,000	
1848	富士ピー・エス	6,700	454.00	3,041,800	
1852	浅沼組	25,700	4,265.00	109,610,500	
1860	戸田建設	470,100	925.90	435,265,590	
1861	熊谷組	57,300	3,695.00	211,723,500	貸付有価証券 200株
1866	北野建設	2,800	3,090.00	8,652,000	
1867	植木組	4,200	1,581.00	6,640,200	

1870	矢作建設工業	47,300	1,427.00	67,497,100	貸付有価証券 6,200株
1871	ピーエス三菱	44,000	931.00	40,964,000	
1873	日本ハウスホールディングス	74,200	304.00	22,556,800	貸付有価証券 13,700株
1879	新日本建設	48,800	1,197.00	58,413,600	貸付有価証券 2,400株
1882	東亜道路工業	13,800	6,940.00	95,772,000	
1884	日本道路	40,700	2,121.00	86,324,700	
1885	東亜建設工業	26,800	3,775.00	101,170,000	貸付有価証券 1,200株
1887	日本国土開発	98,800	546.00	53,944,800	貸付有価証券 16,100株
1888	若築建設	12,000	3,020.00	36,240,000	
1890	東洋建設	87,500	1,295.00	113,312,500	貸付有価証券 600株
1893	五洋建設	492,500	796.90	392,473,250	
1898	世紀東急工業	44,600	1,845.00	82,287,000	
1899	福田組	13,100	5,380.00	70,478,000	
1911	住友林業	300,200	4,323.00	1,297,764,600	貸付有価証券 35,200株
1914	日本基礎技術	9,000	500.00	4,500,000	貸付有価証券 4,900株
1921	巴コーポレーション	18,700	548.00	10,247,600	
1925	大和ハウス工業	960,700	4,494.00	4,317,385,800	貸付有価証券 37,100株
1926	ライト工業	71,500	2,053.00	146,789,500	貸付有価証券 2,500株
1928	積水ハウス	1,053,600	3,388.00	3,569,596,800	
1929	日特建設	33,200	1,147.00	38,080,400	貸付有価証券 500株
1930	北陸電気工事	23,800	1,192.00	28,369,600	貸付有価証券 2,800株
1934	ユアテック	76,500	1,124.00	85,986,000	
1938	日本リーテック	27,100	1,225.00	33,197,500	
1939	四電工	14,500	3,330.00	48,285,000	
1941	中電工	53,900	2,663.00	143,535,700	
1942	関電工	217,500	1,420.00	308,850,000	貸付有価証券 19,900株
1944	きんでん	244,600	2,409.00	589,241,400	貸付有価証券 11,000株
1945	東京エネシス	34,500	1,011.00	34,879,500	
1946	トーエネック	11,500	4,590.00	52,785,000	

1949	住友電設	33,000	2,846.00	93,918,000	
1950	日本電設工業	65,200	2,014.00	131,312,800	貸付有価証券 600株
1951	エクシオグループ	169,800	3,191.00	541,831,800	
1952	新日本空調	22,500	2,472.00	55,620,000	貸付有価証券 800株
1959	九電工	75,100	5,063.00	380,231,300	
1961	三機工業	75,100	1,833.00	137,658,300	
1963	日揮ホールディングス	343,700	1,734.50	596,147,650	貸付有価証券 13,200株
1964	中外炉工業	11,400	2,608.00	29,731,200	
1967	ヤマト	12,400	962.00	11,928,800	
1968	太平電業	21,600	4,230.00	91,368,000	
1969	高砂熱学工業	93,000	3,270.00	304,110,000	貸付有価証券 15,300株
1972	三晃金属工業	1,900	4,750.00	9,025,000	
1975	朝日工業社	16,200	2,980.00	48,276,000	
1976	明星工業	67,200	1,167.00	78,422,400	貸付有価証券 1,900株
1979	大気社	40,000	4,270.00	170,800,000	貸付有価証券 1,200株
1980	ダイダン	45,700	1,626.00	74,308,200	
1982	日比谷総合設備	25,200	2,517.00	63,428,400	
3267	フィル・カンパニー	5,400	804.00	4,341,600	
5074	テスホールディングス	74,800	455.00	34,034,000	
5076	インフロニア・ホールディングス	400,500	1,549.00	620,374,500	
6330	東洋エンジニアリング	51,100	774.00	39,551,400	
6379	レイズネクスト	50,200	1,546.00	77,609,200	
2001	ニッポン	104,400	2,219.00	231,663,600	貸付有価証券 3,700株
2002	日清製粉グループ本社	322,500	2,070.00	667,575,000	貸付有価証券 12,500株
2003	日東富士製粉	6,200	5,060.00	31,372,000	
2004	昭和産業	33,800	3,305.00	111,709,000	
2009	鳥越製粉	12,400	693.00	8,593,200	貸付有価証券 2,100株
2053	中部飼料	48,300	1,115.00	53,854,500	貸付有価証券 1,100株
2060	フィード・ワン	51,000	833.00	42,483,000	
2107	東洋精糖	2,800	2,250.00	6,300,000	
2108	日本甜菜製糖	20,300	2,156.00	43,766,800	

2109	DM三井製糖ホールディングス	34,600	3,170.00	109,682,000	
2112	塩水港精糖	19,600	318.00	6,232,800	
2117	ウェルネオシュガー	17,400	2,300.00	40,020,000	
2201	森永製菓	149,300	2,744.50	409,753,850	
2204	中村屋	8,700	3,120.00	27,144,000	
2206	江崎グリコ	99,800	4,250.00	424,150,000	貸付有価証券 3,900株
2207	名糖産業	13,700	1,721.00	23,577,700	
2209	井村屋グループ	20,800	2,409.00	50,107,200	
2211	不二家	23,900	2,511.00	60,012,900	貸付有価証券 100株
2212	山崎製パン	233,400	3,511.00	819,467,400	貸付有価証券 9,000株
2215	第一屋製パン	2,700	645.00	1,741,500	
2217	モロゾフ	11,300	3,815.00	43,109,500	
2220	亀田製菓	20,000	4,170.00	83,400,000	貸付有価証券 1,600株
2222	寿スピリッツ	164,900	1,970.50	324,935,450	
2229	カルビー	159,700	3,077.00	491,396,900	貸付有価証券 2,800株
2264	森永乳業	121,800	2,925.50	356,325,900	貸付有価証券 2,800株
2266	六甲バター	25,600	1,348.00	34,508,800	貸付有価証券 300株
2267	ヤクルト本社	498,400	3,211.00	1,600,362,400	貸付有価証券 80,600株
2269	明治ホールディングス	427,600	3,539.00	1,513,276,400	
2270	雪印メグミルク	84,300	2,217.00	186,893,100	貸付有価証券 3,300株
2281	プリマハム	46,800	2,387.00	111,711,600	
2282	日本ハム	150,000	4,943.00	741,450,000	貸付有価証券 5,200株
2286	林兼産業	5,000	550.00	2,750,000	
2288	丸大食品	35,100	1,621.00	56,897,100	
2292	S F o o d s	38,500	3,300.00	127,050,000	
2294	柿安本店	13,600	2,523.00	34,312,800	貸付有価証券 600株
2296	伊藤ハム米久ホールディングス	53,300	4,080.00	217,464,000	貸付有価証券 2,000株
2501	サッポロホールディングス	114,800	6,859.00	787,413,200	貸付有価証券 19,700株
2502	アサヒグループホールディングス	805,900	5,435.00	4,380,066,500	
2503	キリンホールディングス	1,452,800	2,087.00	3,031,993,600	貸付有価証券

					56,000株
2531	宝ホールディングス	238,100	1,235.00	294,053,500	貸付有価証券 42,500株
2533	オエノンホールディングス	104,300	361.00	37,652,300	
2540	養命酒製造	11,500	1,893.00	21,769,500	
2579	コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	273,200	1,981.00	541,209,200	
2585	ライフドリンク カンパニー	5,200	5,570.00	28,964,000	
2587	サントリー食品インターナショナル	245,600	4,784.00	1,174,950,400	貸付有価証券 42,900株
2590	ダイドーグループホールディングス	39,500	2,921.00	115,379,500	貸付有価証券 1,200株
2593	伊藤園	118,200	4,292.00	507,314,400	
2594	キーコーヒー	39,100	2,100.00	82,110,000	
2597	ユニカフェ	5,000	910.00	4,550,000	貸付有価証券 1,100株
2599	ジャパンフーズ	2,300	1,257.00	2,891,100	
2602	日清オイリオグループ	49,100	4,395.00	215,794,500	貸付有価証券 1,900株
2607	不二製油グループ本社	81,200	2,289.00	185,866,800	貸付有価証券 10,800株
2612	かどや製油	1,500	3,705.00	5,557,500	
2613	J-オイルミルズ	39,900	2,017.00	80,478,300	
2801	キッコーマン	231,100	9,141.00	2,112,485,100	貸付有価証券 8,900株
2802	味の素	828,800	5,925.00	4,910,640,000	貸付有価証券 130,600株
2804	ブルドックソース	18,500	2,220.00	41,070,000	貸付有価証券 900株
2809	キューピー	187,400	2,566.00	480,868,400	貸付有価証券 7,300株
2810	ハウス食品グループ本社	120,100	3,227.00	387,562,700	貸付有価証券 5,200株
2811	カゴメ	150,000	3,143.00	471,450,000	貸付有価証券 18,300株
2812	焼津水産化学工業	8,000	1,188.00	9,504,000	
2815	アリアケジャパン	34,800	4,615.00	160,602,000	貸付有価証券 1,000株
2818	ピエトロ	2,000	1,805.00	3,610,000	
2819	エバラ食品工業	8,300	2,924.00	24,269,200	
2820	やまみ	1,300	3,805.00	4,946,500	貸付有価証券 100株
2871	ニチレイ	159,800	3,535.00	564,893,000	貸付有価証券 6,200株
2875	東洋水産	176,200	7,825.00	1,378,765,000	貸付有価証券

					6,800株
2882	イートアンドホールディングス	16,500	2,101.00	34,666,500	
2883	大冷	2,000	1,940.00	3,880,000	
2884	ヨシムラ・フード・ホールディングス	15,800	1,003.00	15,847,400	貸付有価証券 2,400株
2897	日清食品ホールディングス	367,900	4,817.00	1,772,174,300	貸付有価証券 13,000株
2899	永谷園ホールディングス	17,100	2,201.00	37,637,100	
2904	一正蒲鉾	6,400	733.00	4,691,200	
2908	フジッコ	35,800	1,963.00	70,275,400	
2910	ロック・フィールド	39,000	1,608.00	62,712,000	
2914	日本たばこ産業	2,119,400	3,765.00	7,979,541,000	
2915	ケンコーマヨネーズ	24,000	1,705.00	40,920,000	
2918	わらべや日洋ホールディングス	23,300	2,836.00	66,078,800	
2922	なとり	21,900	2,123.00	46,493,700	
2924	イフジ産業	2,800	1,338.00	3,746,400	貸付有価証券 200株
2929	ファーマフーズ	50,100	1,012.00	50,701,200	貸付有価証券 2,000株
2931	ユーグレナ	217,100	683.00	148,279,300	貸付有価証券 19,000株
2933	紀文食品	30,200	1,178.00	35,575,600	貸付有価証券 1,000株
2935	ピククルスホールディングス	20,400	1,228.00	25,051,200	
4404	ミヨシ油脂	5,500	1,308.00	7,194,000	
4526	理研ビタミン	30,100	2,279.00	68,597,900	
3001	片倉工業	32,700	1,694.00	55,393,800	
3002	グンゼ	25,200	5,240.00	132,048,000	
3101	東洋紡	153,300	1,090.00	167,097,000	貸付有価証券 6,000株
3103	ユニチカ	114,700	169.00	19,384,300	
3104	富士紡ホールディングス	15,500	3,895.00	60,372,500	
3106	倉敷紡績	26,500	3,055.00	80,957,500	
3109	シキボウ	16,400	1,208.00	19,811,200	貸付有価証券 600株
3201	日本毛織	93,500	1,441.00	134,733,500	貸付有価証券 3,700株
3202	ダイトウボウ	24,600	92.00	2,263,200	貸付有価証券 7,000株
3204	トーア紡コーポレーション	6,000	423.00	2,538,000	
3205	ダイドーリミテッド	21,800	479.00	10,442,200	貸付有価証券 5,700株

3302	帝国繊維	40,000	2,192.00	87,680,000	貸付有価証券 4,900株
3401	帝人	340,900	1,352.50	461,067,250	
3402	東レ	2,377,200	722.30	1,717,051,560	
3501	住江織物	2,800	2,352.00	6,585,600	
3512	日本フェルト	10,800	434.00	4,687,200	
3513	イチカワ	1,900	1,800.00	3,420,000	
3524	日東製網	1,600	1,598.00	2,556,800	
3529	アツギ	10,300	518.00	5,335,400	貸付有価証券 5,200株
3551	ダイニック	4,500	707.00	3,181,500	貸付有価証券 1,600株
3569	セーレン	68,500	2,481.00	169,948,500	
3571	ソトー	4,800	688.00	3,302,400	貸付有価証券 1,700株
3577	東海染工	1,400	854.00	1,195,600	
3580	小松マテール	51,400	806.00	41,428,400	
3591	ワコールホールディングス	72,700	3,361.00	244,344,700	
3593	ホギメディカル	46,800	3,535.00	165,438,000	
3607	クラウディアホールディングス	3,500	424.00	1,484,000	貸付有価証券 1,500株
3608	T S Iホールディングス	115,300	680.00	78,404,000	貸付有価証券 4,700株
3611	マツオカコーポレーション	4,500	1,606.00	7,227,000	貸付有価証券 1,200株
3612	ワールド	50,100	1,720.00	86,172,000	
8011	三陽商会	11,700	2,640.00	30,888,000	
8013	ナイガイ	5,100	270.00	1,377,000	貸付有価証券 2,600株
8016	オンワードホールディングス	209,200	529.00	110,666,800	貸付有価証券 800株
8029	ルックホールディングス	8,600	2,532.00	21,775,200	
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	62,800	9,900.00	621,720,000	貸付有価証券 3,500株
8114	デサント	61,100	3,580.00	218,738,000	
8118	キング	5,700	700.00	3,990,000	貸付有価証券 2,100株
8127	ヤマトインターナショナル	11,900	304.00	3,617,600	
3708	特種東海製紙	19,400	3,905.00	75,757,000	貸付有価証券 200株
3861	王子ホールディングス	1,478,000	572.30	845,859,400	貸付有価証券

					238,900株
3863	日本製紙	200,200	1,383.00	276,876,600	貸付有価証券 7,200株
3864	三菱製紙	20,300	575.00	11,672,500	貸付有価証券 5,000株
3865	北越コーポレーション	174,400	1,357.00	236,660,800	貸付有価証券 28,800株
3877	中越パルプ工業	6,000	1,890.00	11,340,000	貸付有価証券 1,700株
3880	大王製紙	156,700	1,124.50	176,209,150	貸付有価証券 6,100株
3896	阿波製紙	3,700	502.00	1,857,400	貸付有価証券 1,500株
3941	レンゴー	323,100	951.80	307,526,580	
3946	トーモク	20,500	2,357.00	48,318,500	貸付有価証券 300株
3950	ザ・パック	26,400	3,350.00	88,440,000	貸付有価証券 2,100株
2930	北の達人コーポレーション	149,500	240.00	35,880,000	貸付有価証券 21,300株
3405	クラレ	517,100	1,519.00	785,474,900	
3407	旭化成	2,400,300	1,101.50	2,643,930,450	貸付有価証券 369,800株
3553	共和レザー	8,700	765.00	6,655,500	貸付有価証券 2,400株
3878	巴川コーポレーション	4,300	1,064.00	4,575,200	貸付有価証券 1,300株
4004	レゾナック・ホールディングス	342,900	2,966.50	1,017,212,850	貸付有価証券 30,900株
4005	住友化学	2,633,000	341.40	898,906,200	貸付有価証券 421,000株
4008	住友精化	16,700	5,210.00	87,007,000	貸付有価証券 600株
4021	日産化学	166,700	5,905.00	984,363,500	貸付有価証券 30,800株
4022	ラサ工業	13,700	2,295.00	31,441,500	
4023	クレハ	77,600	2,863.00	222,168,800	
4025	多木化学	13,800	3,150.00	43,470,000	
4027	テイカ	30,700	1,387.00	42,580,900	
4028	石原産業	58,800	1,545.00	90,846,000	
4031	片倉コープアグリ	3,500	1,118.00	3,913,000	貸付有価証券 1,100株
4041	日本曹達	41,900	5,750.00	240,925,000	貸付有価証券 1,500株
4042	東ソー	473,700	1,870.00	885,819,000	
4043	トクヤマ	114,600	2,467.50	282,775,500	

4044	セントラル硝子	37,900	2,717.00	102,974,300	
4045	東亜合成	177,800	1,357.50	241,363,500	
4046	大阪ソーダ	24,800	10,240.00	253,952,000	貸付有価証券 900株
4047	関東電化工業	68,600	888.00	60,916,800	貸付有価証券 10,300株
4061	デンカ	129,000	2,554.50	329,530,500	貸付有価証券 5,000株
4063	信越化学工業	3,217,400	5,740.00	18,467,876,000	貸付有価証券 113,700株
4064	日本カーバイド工業	13,100	1,521.00	19,925,100	
4078	堺化学工業	27,000	1,882.00	50,814,000	貸付有価証券 1,100株
4082	第一稀元素化学工業	38,800	983.00	38,140,400	貸付有価証券 4,700株
4088	エア・ウォーター	334,800	1,926.50	644,992,200	貸付有価証券 10,300株
4091	日本酸素ホールディングス	344,200	3,707.00	1,275,949,400	貸付有価証券 53,100株
4092	日本化学工業	13,000	1,951.00	25,363,000	
4093	東邦アセチレン	20,000	372.00	7,440,000	
4095	日本パーカライジング	158,100	1,166.00	184,344,600	
4097	高圧ガス工業	51,500	845.00	43,517,500	貸付有価証券 2,700株
4098	チタン工業	2,000	1,136.00	2,272,000	貸付有価証券 500株
4099	四国化成ホールディングス	45,400	1,966.00	89,256,400	貸付有価証券 200株
4100	戸田工業	8,100	1,560.00	12,636,000	貸付有価証券 1,000株
4109	ステラ ケミファ	19,300	3,250.00	62,725,000	貸付有価証券 800株
4112	保土谷化学工業	11,100	3,560.00	39,516,000	貸付有価証券 300株
4114	日本触媒	51,700	5,501.00	284,401,700	貸付有価証券 2,100株
4116	大日精化工業	24,700	2,703.00	66,764,100	
4118	カネカ	90,100	3,579.00	322,467,900	
4182	三菱瓦斯化学	264,900	2,384.50	631,654,050	貸付有価証券 15,200株
4183	三井化学	292,600	4,310.00	1,261,106,000	貸付有価証券 51,500株
4185	J S R	386,500	4,050.00	1,565,325,000	
4186	東京応化工業	169,300	3,385.00	573,080,500	
4187	大阪有機化学工業	29,700	2,972.00	88,268,400	貸付有価証券 4,300株

4188	三菱ケミカルグループ	2,593,800	887.00	2,300,700,600	貸付有価証券 241,000株
4189	KHネオケム	54,100	2,319.00	125,457,900	貸付有価証券 7,600株
4202	ダイセル	456,100	1,425.50	650,170,550	貸付有価証券 19,100株
4203	住友ベークライト	49,700	7,360.00	365,792,000	貸付有価証券 8,300株
4204	積水化学工業	712,900	2,155.00	1,536,299,500	
4205	日本ゼオン	243,200	1,329.00	323,212,800	貸付有価証券 8,200株
4206	アイカ工業	89,500	3,424.00	306,448,000	
4208	UBE	168,800	2,414.00	407,483,200	
4212	積水樹脂	53,000	2,540.00	134,620,000	
4215	タキロンシーアイ	90,500	648.00	58,644,000	
4216	旭有機材	23,600	3,965.00	93,574,000	貸付有価証券 2,500株
4218	ニチバン	19,200	1,728.00	33,177,600	貸付有価証券 400株
4220	リケンテクノス	76,400	851.00	65,016,400	
4221	大倉工業	16,400	2,607.00	42,754,800	
4228	積水化成成品工業	49,800	498.00	24,800,400	
4229	群栄化学工業	8,300	3,295.00	27,348,500	
4231	タイガースポリマー	6,800	905.00	6,154,000	
4238	ミライアル	5,200	1,512.00	7,862,400	
4245	ダイキアクシス	5,900	719.00	4,242,100	貸付有価証券 1,500株
4246	ダイキョーニシカワ	78,300	739.00	57,863,700	
4248	竹本容器	5,300	786.00	4,165,800	
4249	森六ホールディングス	18,400	2,785.00	51,244,000	
4251	恵和	25,500	1,395.00	35,572,500	
4272	日本化薬	271,000	1,314.50	356,229,500	貸付有価証券 10,500株
4275	カーリットホールディングス	38,200	949.00	36,251,800	
4362	日本精化	23,500	3,105.00	72,967,500	貸付有価証券 500株
4368	扶桑化学工業	37,600	4,200.00	157,920,000	貸付有価証券 4,300株
4369	トリケミカル研究所	43,000	3,605.00	155,015,000	
4401	ADEKA	123,700	2,854.50	353,101,650	
4403	日油	107,100	6,603.00	707,181,300	貸付有価証券 800株

4406	新日本理化	20,800	195.00	4,056,000	
4410	ハリマ化成グループ	19,300	867.00	16,733,100	
4452	花王	802,300	5,850.00	4,693,455,000	
4461	第一工業製薬	14,200	2,009.00	28,527,800	
4462	石原ケミカル	15,900	2,110.00	33,549,000	貸付有価証券 700株
4463	日華化学	6,000	899.00	5,394,000	
4465	ニイタカ	2,800	1,890.00	5,292,000	
4471	三洋化成工業	21,800	4,315.00	94,067,000	
4531	有機合成薬品工業	11,700	284.00	3,322,800	貸付有価証券 3,300株
4611	大日本塗料	39,400	1,069.00	42,118,600	
4612	日本ペイントホールディングス	1,884,000	1,157.00	2,179,788,000	
4613	関西ペイント	347,700	2,465.50	857,254,350	
4615	神東塗料	12,500	127.00	1,587,500	貸付有価証券 3,400株
4617	中国塗料	72,900	1,742.00	126,991,800	
4619	日本特殊塗料	10,700	1,297.00	13,877,900	
4620	藤倉化成	40,900	447.00	18,282,300	
4626	太陽ホールディングス	61,800	3,115.00	192,507,000	
4631	D I C	138,600	2,808.00	389,188,800	貸付有価証券 5,400株
4633	サカタインクス	78,900	1,414.00	111,564,600	貸付有価証券 3,700株
4634	a r t i e n c e	77,200	2,706.00	208,903,200	
4636	T & K TOKA	34,000	1,407.00	47,838,000	
4901	富士フイルムホールディングス	659,100	9,219.00	6,076,242,900	貸付有価証券 76,100株
4911	資生堂	741,800	4,049.00	3,003,548,200	貸付有価証券 28,600株
4912	ライオン	465,000	1,301.50	605,197,500	貸付有価証券 18,000株
4914	高砂香料工業	26,700	3,515.00	93,850,500	貸付有価証券 700株
4917	マンダム	76,700	1,270.00	97,409,000	貸付有価証券 3,000株
4919	ミルボン	48,300	3,505.00	169,291,500	
4921	ファンケル	155,400	2,359.50	366,666,300	
4922	コーセー	72,200	9,493.00	685,394,600	貸付有価証券 2,800株
4923	コタ	32,700	1,595.00	52,156,500	
4926	シーボン	2,000	1,498.00	2,996,000	

4927	ポーラ・オルビスホールディングス	182,100	1,534.00	279,341,400	
4928	ノエビアホールディングス	31,700	5,190.00	164,523,000	
4929	アジュバンホールディングス	3,600	927.00	3,337,200	
4931	新日本製薬	20,300	1,751.00	35,545,300	
4933	I - n e	7,100	2,439.00	17,316,900	
4936	アクシージア	18,000	891.00	16,038,000	貸付有価証券 800株
4951	エステー	27,400	1,534.00	42,031,600	
4955	アグロ カネショウ	14,200	1,374.00	19,510,800	
4956	コニシ	102,600	1,357.00	139,228,200	
4958	長谷川香料	67,900	3,235.00	219,656,500	貸付有価証券 3,400株
4967	小林製薬	103,400	6,804.00	703,533,600	
4968	荒川化学工業	30,100	1,054.00	31,725,400	
4971	メック	29,200	4,440.00	129,648,000	
4973	日本高純度化学	8,000	2,590.00	20,720,000	
4974	タカラバイオ	95,700	1,254.00	120,007,800	貸付有価証券 2,700株
4975	J C U	39,700	3,755.00	149,073,500	
4977	新田ゼラチン	9,900	756.00	7,484,400	
4979	O A Tアグリオ	10,300	1,965.00	20,239,500	
4980	デクセリアルズ	89,100	4,194.00	373,685,400	貸付有価証券 3,400株
4985	アース製薬	32,300	4,440.00	143,412,000	貸付有価証券 4,000株
4992	北興化学工業	35,700	1,036.00	36,985,200	
4994	大成ラミック	10,300	2,972.00	30,611,600	
4996	クミアイ化学工業	141,100	848.00	119,652,800	貸付有価証券 21,700株
4997	日本農薬	65,100	678.00	44,137,800	貸付有価証券 2,600株
5142	アキレス	22,400	1,546.00	34,630,400	
5208	有沢製作所	62,200	1,105.00	68,731,000	
6988	日東電工	228,200	11,255.00	2,568,391,000	貸付有価証券 3,800株
7874	レック	45,500	1,034.00	47,047,000	
7888	三光合成	44,700	646.00	28,876,200	
7908	きもと	25,100	225.00	5,647,500	貸付有価証券 7,500株
7917	藤森工業	28,100	4,105.00	115,350,500	
7925	前澤化成工業	22,900	1,572.00	35,998,800	

7931	未来工業	12,700	4,325.00	54,927,500	
7940	ウェーブロックホールディングス	5,200	663.00	3,447,600	
7942	J S P	25,000	1,916.00	47,900,000	
7947	エフピコ	67,200	2,851.00	191,587,200	
7958	天馬	25,800	2,242.00	57,843,600	
7970	信越ポリマー	76,600	1,650.00	126,390,000	
7971	東リ	43,200	331.00	14,299,200	
7988	ニフコ	106,200	3,804.00	403,984,800	貸付有価証券 3,100株
7995	バルカー	29,700	4,385.00	130,234,500	
8113	ユニ・チャーム	740,100	5,069.00	3,751,566,900	貸付有価証券 28,600株
9385	ショーエイコーポレーション	4,500	604.00	2,718,000	貸付有価証券 500株
4151	協和キリン	429,200	2,338.50	1,003,684,200	貸付有価証券 16,600株
4502	武田薬品工業	3,144,000	4,310.00	13,550,640,000	
4503	アステラス製薬	3,116,200	1,688.00	5,260,145,600	貸付有価証券 129,300株
4506	住友ファーマ	263,500	459.00	120,946,500	貸付有価証券 4,800株
4507	塩野義製薬	447,900	7,103.00	3,181,433,700	貸付有価証券 73,900株
4512	わかもと製薬	15,900	213.00	3,386,700	貸付有価証券 5,200株
4516	日本新薬	93,100	5,251.00	488,868,100	貸付有価証券 3,300株
4519	中外製薬	1,112,000	5,416.00	6,022,592,000	
4521	科研製薬	60,900	3,492.00	212,662,800	貸付有価証券 2,400株
4523	エーザイ	432,100	6,955.00	3,005,255,500	貸付有価証券 15,900株
4527	ロート製薬	344,100	3,054.00	1,050,881,400	
4528	小野薬品工業	753,900	2,657.00	2,003,112,300	
4530	久光製薬	79,000	4,211.00	332,669,000	
4534	持田製薬	40,800	3,320.00	135,456,000	
4536	参天製薬	647,400	1,471.50	952,649,100	
4538	扶桑薬品工業	12,500	2,222.00	27,775,000	
4539	日本ケミファ	1,700	1,607.00	2,731,900	貸付有価証券 600株
4540	ツムラ	111,800	2,684.50	300,127,100	貸付有価証券 4,400株
4547	キッセイ薬品工業	58,800	3,130.00	184,044,000	

4548	生化学工業	60,200	772.00	46,474,400	
4549	栄研化学	65,200	1,768.00	115,273,600	
4551	鳥居薬品	19,100	3,780.00	72,198,000	
4552	J C R ファーマ	120,200	1,105.00	132,821,000	貸付有価証券 1,100株
4553	東和薬品	54,600	2,492.00	136,063,200	
4554	富士製薬工業	26,200	1,922.00	50,356,400	
4559	ゼリア新薬工業	49,300	2,028.00	99,980,400	
4565	そーせいグループ	116,600	1,420.00	165,572,000	貸付有価証券 1,400株
4568	第一三共	3,094,800	4,283.00	13,255,028,400	貸付有価証券 380,100株
4569	杏林製薬	77,000	1,779.00	136,983,000	
4574	大幸薬品	73,300	309.00	22,649,700	貸付有価証券 6,100株
4577	ダイト	27,300	1,947.00	53,153,100	貸付有価証券 100株
4578	大塚ホールディングス	738,900	5,785.00	4,274,536,500	
4581	大正製薬ホールディングス	78,900	8,620.00	680,118,000	
4587	ペプチドリーム	172,200	1,332.00	229,370,400	貸付有価証券 29,100株
4880	セルソース	9,800	1,238.00	12,132,400	貸付有価証券 100株
4886	あすか製薬ホールディングス	36,400	1,988.00	72,363,200	
4887	サワイグループホールディングス	81,200	5,652.00	458,942,400	貸付有価証券 1,400株
3315	日本コークス工業	360,400	125.00	45,050,000	
5011	ニチレキ	46,200	2,497.00	115,361,400	貸付有価証券 200株
5013	ユシロ化学工業	18,400	1,823.00	33,543,200	
5015	ビーピー・カストロール	5,900	867.00	5,115,300	
5017	富士石油	103,600	370.00	38,332,000	貸付有価証券 2,800株
5018	MORESCO	5,400	1,445.00	7,803,000	貸付有価証券 600株
5019	出光興産	1,972,800	814.50	1,606,845,600	
5020	ENEOSホールディングス	5,624,200	591.50	3,326,714,300	
5021	コスモエネルギーホールディングス	105,300	6,088.00	641,066,400	
5101	横浜ゴム	179,700	3,459.00	621,582,300	貸付有価証券 7,000株
5105	TOYO TIRE	204,100	2,416.50	493,207,650	
5108	ブリヂストン	1,039,900	6,279.00	6,529,532,100	

5110	住友ゴム工業	348,400	1,659.00	577,995,600	
5121	藤倉コンポジット	23,900	1,470.00	35,133,000	貸付有価証券 800株
5122	オカモト	16,800	5,030.00	84,504,000	
5185	フコク	18,700	1,440.00	26,928,000	
5186	ニッタ	36,100	3,725.00	134,472,500	
5191	住友理工	55,100	1,138.00	62,703,800	
5192	三ツ星ベルト	43,200	4,815.00	208,008,000	貸付有価証券 2,000株
5195	バンドー化学	52,700	1,737.00	91,539,900	貸付有価証券 500株
3110	日東紡績	45,000	4,795.00	215,775,000	貸付有価証券 8,200株
5201	A G C	316,800	5,468.00	1,732,262,400	貸付有価証券 5,800株
5202	日本板硝子	169,500	606.00	102,717,000	貸付有価証券 4,900株
5204	石塚硝子	2,600	3,240.00	8,424,000	
5210	日本山村硝子	5,700	1,392.00	7,934,400	貸付有価証券 1,900株
5214	日本電気硝子	145,000	3,167.00	459,215,000	貸付有価証券 2,400株
5218	オハラ	16,900	1,146.00	19,367,400	
5232	住友大阪セメント	59,100	3,656.00	216,069,600	貸付有価証券 10,400株
5233	太平洋セメント	210,100	2,941.50	618,009,150	
5262	日本ヒューム	31,100	896.00	27,865,600	
5269	日本コンクリート工業	68,900	457.00	31,487,300	貸付有価証券 12,200株
5273	三谷セキサン	14,900	5,000.00	74,500,000	貸付有価証券 100株
5288	アジアパイルホールディングス	50,500	728.00	36,764,000	
5301	東海カーボン	327,800	1,027.50	336,814,500	貸付有価証券 12,700株
5302	日本カーボン	18,800	4,470.00	84,036,000	貸付有価証券 100株
5310	東洋炭素	25,000	5,060.00	126,500,000	貸付有価証券 2,600株
5331	ノリタケカンパニーリミテド	19,700	7,590.00	149,523,000	
5332	T O T O	234,400	4,008.00	939,475,200	貸付有価証券 40,900株
5333	日本碍子	413,200	1,820.00	752,024,000	貸付有価証券 16,000株
5334	日本特殊陶業	297,500	3,863.00	1,149,242,500	
5337	ダントーホールディングス	10,000	1,249.00	12,490,000	貸付有価証券

					4,800株
5344	MARUWA	13,100	28,720.00	376,232,000	貸付有価証券 600株
5351	品川リフラクトリーズ	43,700	1,918.00	83,816,600	
5352	黒崎播磨	7,200	11,920.00	85,824,000	貸付有価証券 900株
5357	ヨータイ	21,900	1,452.00	31,798,800	
5363	東京窯業	16,200	473.00	7,662,600	貸付有価証券 5,600株
5367	ニッカトー	6,700	582.00	3,899,400	貸付有価証券 2,000株
5384	フジミインコーポレーテッド	95,500	2,980.00	284,590,000	貸付有価証券 3,300株
5388	クニミネ工業	4,300	1,068.00	4,592,400	
5391	エーアンドエーマテリアル	2,800	1,319.00	3,693,200	
5393	ニチアス	89,800	3,385.00	303,973,000	
7943	ニチハ	44,500	2,971.00	132,209,500	貸付有価証券 1,800株
5401	日本製鉄	1,636,400	3,468.00	5,675,035,200	貸付有価証券 63,100株
5406	神戸製鋼所	735,000	1,955.00	1,436,925,000	貸付有価証券 28,400株
5408	中山製鋼所	83,600	878.00	73,400,800	貸付有価証券 6,100株
5410	合同製鐵	20,400	4,965.00	101,286,000	
5411	J F Eホールディングス	1,016,400	2,286.00	2,323,490,400	
5423	東京製鐵	102,700	1,759.00	180,649,300	貸付有価証券 25,400株
5440	共英製鋼	41,600	2,068.00	86,028,800	貸付有価証券 4,900株
5444	大和工業	68,900	8,001.00	551,268,900	
5445	東京鐵鋼	16,100	4,435.00	71,403,500	貸付有価証券 1,800株
5449	大阪製鐵	16,800	2,298.00	38,606,400	貸付有価証券 1,400株
5451	淀川製鋼所	41,500	3,880.00	161,020,000	貸付有価証券 1,400株
5461	中部鋼板	24,000	2,427.00	58,248,000	
5463	丸一鋼管	111,300	3,787.00	421,493,100	
5464	モリ工業	6,500	4,655.00	30,257,500	
5471	大同特殊鋼	230,200	1,492.50	343,573,500	貸付有価証券 38,800株
5476	日本高周波鋼業	5,900	604.00	3,563,600	貸付有価証券 1,600株
5480	日本冶金工業	26,700	4,635.00	123,754,500	貸付有価証券

					3,600株
5481	山陽特殊製鋼	36,100	2,516.00	90,827,600	貸付有価証券 1,400株
5482	愛知製鋼	21,100	3,375.00	71,212,500	貸付有価証券 2,000株
5491	日本金属	4,000	881.00	3,524,000	貸付有価証券 1,000株
5541	大太平洋金属	31,100	1,458.00	45,343,800	貸付有価証券 4,000株
5563	新日本電工	181,800	287.00	52,176,600	
5602	栗本鐵工所	17,000	3,510.00	59,670,000	
5603	虹技	1,900	1,220.00	2,318,000	貸付有価証券 600株
5612	日本鑄鉄管	1,700	1,127.00	1,915,900	
5632	三菱製鋼	27,100	1,577.00	42,736,700	
5658	日亜鋼業	15,700	334.00	5,243,800	
5659	日本精線	5,800	5,130.00	29,754,000	
5698	エンビプロ・ホールディングス	19,600	620.00	12,152,000	
6319	シンニッタン	19,600	265.00	5,194,000	貸付有価証券 6,800株
7305	新家工業	3,400	2,999.00	10,196,600	
5702	大紀アルミニウム工業所	46,200	1,239.00	57,241,800	貸付有価証券 1,100株
5703	日本軽金属ホールディングス	106,800	1,816.00	193,948,800	
5706	三井金属鉱業	106,400	4,607.00	490,184,800	
5707	東邦亜鉛	23,400	1,150.00	26,910,000	貸付有価証券 900株
5711	三菱マテリアル	261,300	2,671.00	697,932,300	貸付有価証券 29,000株
5713	住友金属鉱山	423,700	4,101.00	1,737,593,700	
5714	DOWAホールディングス	90,300	5,235.00	472,720,500	貸付有価証券 7,200株
5715	古河機械金属	48,200	1,878.00	90,519,600	
5721	エス・サイエンス	75,500	22.00	1,661,000	貸付有価証券 19,300株
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	63,400	2,717.00	172,257,800	貸付有価証券 4,600株
5727	東邦チタニウム	75,500	1,907.00	143,978,500	貸付有価証券 14,900株
5741	UACJ	51,200	4,105.00	210,176,000	
5757	CKサンエツ	8,800	3,865.00	34,012,000	
5801	古河電気工業	121,700	2,595.50	315,872,350	貸付有価証券 18,200株
5802	住友電気工業	1,367,100	1,908.00	2,608,426,800	貸付有価証券

					3,100株
5803	フジクラ	431,100	1,165.00	502,231,500	貸付有価証券 15,100株
5805	SWCC	40,800	2,942.00	120,033,600	
5809	タツタ電線	65,100	695.00	45,244,500	貸付有価証券 8,700株
5819	カナレ電気	2,500	1,778.00	4,445,000	
5821	平河ヒューテック	23,300	1,397.00	32,550,100	
5851	リョービ	38,900	2,645.00	102,890,500	貸付有価証券 5,400株
5852	アーレスティ	17,100	721.00	12,329,100	貸付有価証券 1,900株
5857	AREホールディングス	137,300	2,008.00	275,698,400	
3421	稲葉製作所	18,000	1,521.00	27,378,000	
3431	宮地エンジニアリンググループ	18,300	3,450.00	63,135,000	貸付有価証券 800株
3433	トーカロ	105,400	1,537.00	161,999,800	
3434	アルファCo	5,700	1,475.00	8,407,500	
3436	SUMCO	649,400	2,272.50	1,475,761,500	貸付有価証券 77,500株
3443	川田テクノロジーズ	8,600	7,050.00	60,630,000	
3445	RS Technologies	24,400	2,991.00	72,980,400	貸付有価証券 2,600株
3446	ジェイテックコーポレーション	2,000	2,192.00	4,384,000	貸付有価証券 500株
3447	信和	9,900	754.00	7,464,600	
5901	東洋製罐グループホールディングス	217,800	2,312.00	503,553,600	
5902	ホッカンホールディングス	17,800	1,771.00	31,523,800	
5909	コロナ	20,400	959.00	19,563,600	
5911	横河ブリッジホールディングス	57,200	2,768.00	158,329,600	
5915	駒井ハルテック	2,700	2,095.00	5,656,500	貸付有価証券 800株
5923	高田機工	1,200	3,595.00	4,314,000	貸付有価証券 100株
5929	三和ホールディングス	367,200	2,290.00	840,888,000	貸付有価証券 49,100株
5930	文化シャッター	95,600	1,450.00	138,620,000	貸付有価証券 4,100株
5932	三協立山	41,800	886.00	37,034,800	
5933	アルインコ	27,900	1,043.00	29,099,700	
5936	東洋シャッター	3,500	719.00	2,516,500	貸付有価証券 1,000株
5938	LIXIL	570,700	1,971.00	1,124,849,700	

5942	日本ファイルコン	10,100	562.00	5,676,200	
5943	ノーリツ	60,600	1,541.00	93,384,600	貸付有価証券 1,100株
5946	長府製作所	36,300	2,058.00	74,705,400	
5947	リンナイ	178,800	3,363.00	601,304,400	貸付有価証券 25,500株
5951	ダイニチ工業	7,700	701.00	5,397,700	
5957	日東精工	53,000	542.00	28,726,000	
5958	三洋工業	1,800	2,870.00	5,166,000	
5959	岡部	65,300	794.00	51,848,200	
5970	ジーテクト	46,600	1,815.00	84,579,000	
5975	東プレ	64,400	2,107.00	135,690,800	貸付有価証券 1,700株
5976	高周波熱錬	56,400	1,044.00	58,881,600	貸付有価証券 200株
5981	東京製綱	23,700	1,347.00	31,923,900	
5985	サンコール	28,400	476.00	13,518,400	
5986	モリテック スチール	13,100	289.00	3,785,900	貸付有価証券 3,400株
5988	パイオラックス	45,400	2,497.00	113,363,800	貸付有価証券 3,200株
5989	エイチワン	37,600	821.00	30,869,600	
5991	日本発條	323,300	1,206.00	389,899,800	貸付有価証券 12,500株
5992	中央発條	27,100	711.00	19,268,100	貸付有価証券 1,000株
5998	アドバネクス	2,000	943.00	1,886,000	貸付有価証券 600株
7989	立川ブラインド工業	16,500	1,431.00	23,611,500	
8155	三益半導体工業	28,200	3,285.00	92,637,000	
1909	日本ドライケミカル	3,500	2,761.00	9,663,500	
5631	日本製鋼所	98,500	2,457.00	242,014,500	
6005	三浦工業	149,400	2,739.50	409,281,300	
6013	タクマ	120,900	1,720.00	207,948,000	貸付有価証券 200株
6101	ツガミ	79,500	1,178.00	93,651,000	貸付有価証券 9,100株
6103	オークマ	31,300	6,553.00	205,108,900	貸付有価証券 1,400株
6104	芝浦機械	35,700	3,580.00	127,806,000	
6113	アマダ	570,800	1,567.00	894,443,600	貸付有価証券 56,100株
6118	アイダエンジニアリング	82,800	840.00	69,552,000	貸付有価証券

					1,400株
6134	F U J I	168,500	2,486.50	418,975,250	
6135	牧野フライス製作所	39,600	5,950.00	235,620,000	貸付有価証券 100株
6136	オーエスジー	157,700	2,040.00	321,708,000	
6138	ダイジェット工業	1,500	837.00	1,255,500	
6140	旭ダイヤモンド工業	82,500	874.00	72,105,000	
6141	DMG森精機	216,900	2,905.00	630,094,500	貸付有価証券 8,400株
6143	ソディック	87,100	720.00	62,712,000	
6146	ディスコ	172,200	39,600.00	6,819,120,000	貸付有価証券 6,600株
6151	日東工器	17,300	1,904.00	32,939,200	
6157	日進工具	33,200	1,033.00	34,295,600	貸付有価証券 2,600株
6165	パンチ工業	14,600	422.00	6,161,200	
6167	富士ダイス	18,500	698.00	12,913,000	貸付有価証券 2,100株
6203	豊和工業	8,300	763.00	6,332,900	貸付有価証券 1,000株
6208	石川製作所	3,900	1,137.00	4,434,300	貸付有価証券 1,000株
6209	リケンNPR	38,800	2,645.00	102,626,000	貸付有価証券 5,600株
6210	東洋機械金属	11,000	688.00	7,568,000	
6217	津田駒工業	2,700	408.00	1,101,600	貸付有価証券 800株
6218	エンシュウ	3,600	691.00	2,487,600	貸付有価証券 1,000株
6222	島精機製作所	56,900	1,508.00	85,805,200	
6235	オプトラン	58,800	1,743.00	102,488,400	貸付有価証券 2,300株
6236	NCホールディングス	3,600	1,613.00	5,806,800	貸付有価証券 1,300株
6237	イワキポンプ	23,800	2,143.00	51,003,400	
6238	フリー	33,700	1,324.00	44,618,800	
6240	ヤマシンフィルタ	85,900	342.00	29,377,800	貸付有価証券 9,400株
6247	日阪製作所	39,000	975.00	38,025,000	
6250	やまびこ	58,400	1,563.00	91,279,200	
6254	野村マイクロ・サイエンス	12,100	14,090.00	170,489,000	貸付有価証券 1,000株
6258	平田機工	17,100	6,780.00	115,938,000	貸付有価証券 2,100株

6262	PEGASUS	39,500	446.00	17,617,000	
6264	マルマエ	15,600	1,873.00	29,218,800	貸付有価証券 2,500株
6266	タツモ	21,600	3,230.00	69,768,000	貸付有価証券 2,000株
6268	ナブテスコ	224,500	2,872.50	644,876,250	貸付有価証券 8,700株
6269	三井海洋開発	45,300	2,315.00	104,869,500	貸付有価証券 4,700株
6272	レオン自動機	41,400	1,524.00	63,093,600	
6273	SMC	107,100	82,120.00	8,795,052,000	貸付有価証券 18,300株
6277	ホソカワミクロン	22,900	4,655.00	106,599,500	
6278	ユニオンツール	15,700	3,405.00	53,458,500	
6279	瑞光	25,800	1,727.00	44,556,600	貸付有価証券 1,200株
6282	オイレス工業	48,500	2,098.00	101,753,000	
6284	日精エー・エス・ビー機械	14,200	4,320.00	61,344,000	
6287	サトーホールディングス	50,900	2,154.00	109,638,600	
6289	技研製作所	33,600	2,137.00	71,803,200	
6291	日本エアージェット	16,700	1,257.00	20,991,900	
6292	カワタ	4,700	1,128.00	5,301,600	貸付有価証券 1,300株
6293	日精樹脂工業	26,600	1,140.00	30,324,000	
6294	オカダアイヨン	5,100	2,643.00	13,479,300	
6298	ワイエイシイホールディングス	11,800	2,464.00	29,075,200	貸付有価証券 2,800株
6301	小松製作所	1,676,900	3,904.00	6,546,617,600	貸付有価証券 216,900株
6302	住友重機械工業	211,600	3,720.00	787,152,000	
6305	日立建機	142,500	4,097.00	583,822,500	貸付有価証券 23,300株
6306	日工	53,000	757.00	40,121,000	
6309	巴工業	14,000	3,670.00	51,380,000	貸付有価証券 500株
6310	井関農機	33,500	1,142.00	38,257,000	貸付有価証券 300株
6315	TOWA	39,800	7,650.00	304,470,000	
6316	丸山製作所	2,600	2,588.00	6,728,800	
6317	北川鉄工所	14,100	1,534.00	21,629,400	
6323	ローツェ	18,700	16,280.00	304,436,000	貸付有価証券 500株
6325	タカキタ	5,000	483.00	2,415,000	貸付有価証券

					1,600株
6326	クボタ	1,875,800	2,210.00	4,145,518,000	貸付有価証券 73,000株
6328	荏原実業	18,800	2,985.00	56,118,000	
6331	三菱化工機	12,600	3,455.00	43,533,000	
6332	月島ホールディングス	48,300	1,345.00	64,963,500	貸付有価証券 500株
6333	帝国電機製作所	25,200	3,005.00	75,726,000	
6335	東京機械製作所	4,000	472.00	1,888,000	貸付有価証券 1,000株
6339	新東工業	72,300	1,094.00	79,096,200	
6340	澁谷工業	33,600	2,489.00	83,630,400	
6345	アイチ コーポレーション	49,800	1,091.00	54,331,800	
6349	小森コーポレーション	88,100	1,335.00	117,613,500	
6351	鶴見製作所	27,300	3,620.00	98,826,000	
6356	日本ギア工業	5,800	510.00	2,958,000	貸付有価証券 1,300株
6358	酒井重工業	4,900	6,900.00	33,810,000	
6361	荏原製作所	146,800	9,197.00	1,350,119,600	貸付有価証券 5,700株
6362	石井鐵工所	1,700	2,688.00	4,569,600	貸付有価証券 300株
6363	西島製作所	30,800	2,436.00	75,028,800	貸付有価証券 4,000株
6364	北越工業	36,000	2,637.00	94,932,000	
6367	ダイキン工業	427,100	23,915.00	10,214,096,500	貸付有価証券 73,100株
6368	オルガノ	43,000	6,110.00	262,730,000	
6369	トーヨーカネツ	12,100	4,230.00	51,183,000	
6370	栗田工業	200,100	5,471.00	1,094,747,100	
6371	椿本チエイン	50,700	4,180.00	211,926,000	
6373	大同工業	6,700	748.00	5,011,600	
6378	木村化工機	27,300	725.00	19,792,500	
6381	アネスト岩田	55,300	1,287.00	71,171,100	
6383	ダイフク	603,700	2,903.00	1,752,541,100	貸付有価証券 89,500株
6387	サムコ	9,600	4,580.00	43,968,000	貸付有価証券 1,200株
6390	加藤製作所	7,700	1,420.00	10,934,000	
6393	油研工業	2,500	2,251.00	5,627,500	貸付有価証券 100株
6395	タダノ	205,800	1,175.00	241,815,000	貸付有価証券

					300 株
6406	フジテック	83,600	3,712.00	310,323,200	
6407	CKD	98,900	2,626.00	259,711,400	貸付有価証券 16,200 株
6412	平和	105,800	2,173.00	229,903,400	貸付有価証券 3,600 株
6413	理想科学工業	28,600	2,775.00	79,365,000	
6417	SANKYO	82,300	8,779.00	722,511,700	貸付有価証券 4,300 株
6418	日本金銭機械	43,200	1,512.00	65,318,400	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	2,685.00	48,598,500	貸付有価証券 3,500 株
6420	フクシマガリレイ	23,400	5,130.00	120,042,000	
6428	オーイズミ	5,700	453.00	2,582,100	貸付有価証券 1,900 株
6430	ダイコク電機	17,600	3,625.00	63,800,000	貸付有価証券 2,100 株
6432	竹内製作所	64,900	4,705.00	305,354,500	
6436	アマノ	101,500	3,369.00	341,953,500	
6440	JUKI	55,400	445.00	24,653,000	
6444	サンデン	22,700	194.00	4,403,800	貸付有価証券 7,600 株
6445	ジャノメ	36,200	693.00	25,086,600	
6454	マックス	50,400	3,255.00	164,052,000	
6457	グローリー	85,900	3,027.00	260,019,300	貸付有価証券 3,400 株
6458	新晃工業	36,000	3,000.00	108,000,000	貸付有価証券 1,400 株
6459	大和冷機工業	54,800	1,580.00	86,584,000	
6460	セガサミーホールディングス	319,500	2,138.50	683,250,750	
6463	T P R	45,400	1,970.00	89,438,000	
6464	ツバキ・ナカシマ	71,600	748.00	53,556,800	貸付有価証券 9,000 株
6465	ホシザキ	211,100	5,304.00	1,119,674,400	
6470	大豊工業	30,900	827.00	25,554,300	
6471	日本精工	662,300	795.90	527,124,570	
6472	N T N	775,800	266.00	206,362,800	
6473	ジェイテクト	318,300	1,306.50	415,858,950	貸付有価証券 23,700 株
6474	不二越	26,400	3,455.00	91,212,000	貸付有価証券 1,100 株
6480	日本トムソン	97,400	586.00	57,076,400	

6481	T H K	206,400	2,874.00	593,193,600	貸付有価証券 25,800株
6482	ユーシン精機	28,300	670.00	18,961,000	
6485	前澤給装工業	27,400	1,298.00	35,565,200	貸付有価証券 1,000株
6486	イーグル工業	39,500	1,680.00	66,360,000	
6489	前澤工業	8,700	1,077.00	9,369,900	
6490	日本ピラー工業	33,200	4,885.00	162,182,000	貸付有価証券 4,400株
6498	キッツ	119,700	1,197.00	143,280,900	
6586	マキタ	408,000	3,938.00	1,606,704,000	
7003	三井E&S	177,500	723.00	128,332,500	貸付有価証券 16,000株
7004	日立造船	315,700	921.00	290,759,700	貸付有価証券 11,300株
7011	三菱重工業	625,600	9,405.00	5,883,768,000	
7013	I H I	266,400	2,800.50	746,053,200	貸付有価証券 40,700株
7022	サノヤスホールディングス	19,500	140.00	2,730,000	
7718	スター精密	66,600	1,775.00	118,215,000	貸付有価証券 2,500株
3105	日清紡ホールディングス	268,900	1,189.50	319,856,550	
4062	イビデン	186,600	7,465.00	1,392,969,000	貸付有価証券 31,900株
4902	コニカミノルタ	799,000	412.90	329,907,100	貸付有価証券 30,800株
6448	ブラザー工業	478,000	2,474.00	1,182,572,000	貸付有価証券 54,200株
6479	ミネベアミツミ	622,300	3,006.00	1,870,633,800	貸付有価証券 54,400株
6501	日立製作所	1,719,400	11,170.00	19,205,698,000	貸付有価証券 13,300株
6503	三菱電機	3,981,800	2,152.50	8,570,824,500	
6504	富士電機	217,500	7,279.00	1,583,182,500	貸付有価証券 26,800株
6505	東洋電機製造	5,000	1,094.00	5,470,000	
6506	安川電機	388,600	5,784.00	2,247,662,400	貸付有価証券 16,400株
6507	シンフォニアテクノロジー	39,500	2,273.00	89,783,500	
6508	明電舎	66,300	2,608.00	172,910,400	
6513	オリジン	3,400	1,223.00	4,158,200	
6516	山洋電気	15,500	6,440.00	99,820,000	
6517	デンヨー	27,300	2,269.00	61,943,700	貸付有価証券 1,200株

6523	PHCホールディングス	66,800	1,533.00	102,404,400	貸付有価証券 8,000株
6525	KOKUSAI ELECTRIC	138,100	3,785.00	522,708,500	
6526	ソシオネクスト	259,500	3,294.00	854,793,000	貸付有価証券 9,500株
6588	東芝テック	45,800	3,025.00	138,545,000	
6590	芝浦メカトロニクス	20,400	7,140.00	145,656,000	貸付有価証券 2,400株
6592	マブチモーター	175,900	2,493.50	438,606,650	貸付有価証券 7,000株
6594	ニデック	789,800	5,628.00	4,444,994,400	
6615	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	22,500	355.00	7,987,500	貸付有価証券 2,500株
6616	トレックス・セミコンダクター	18,400	1,820.00	33,488,000	貸付有価証券 3,400株
6617	東光高岳	21,600	2,154.00	46,526,400	
6619	ダブル・スコープ	102,400	804.00	82,329,600	貸付有価証券 6,000株
6622	ダイヘン	35,900	6,800.00	244,120,000	
6630	ヤーマン	61,800	1,003.00	61,985,400	貸付有価証券 6,400株
6632	JVCケンウッド	282,400	718.00	202,763,200	
6638	ミマキエンジニアリング	34,000	910.00	30,940,000	
6640	I-PEX	24,800	1,763.00	43,722,400	貸付有価証券 1,000株
6644	大崎電気工業	78,300	649.00	50,816,700	
6645	オムロン	273,200	6,763.00	1,847,651,600	貸付有価証券 41,500株
6651	日東工業	48,200	3,915.00	188,703,000	
6652	IDEC	52,800	2,994.00	158,083,200	
6653	正興電機製作所	5,200	1,074.00	5,584,800	貸付有価証券 1,100株
6654	不二電機工業	3,000	1,187.00	3,561,000	貸付有価証券 700株
6674	ジーエス・ユアサコーポレーション	139,600	2,090.00	291,764,000	貸付有価証券 4,600株
6675	サクサホールディングス	3,500	2,671.00	9,348,500	
6676	メルコホールディングス	11,200	3,300.00	36,960,000	
6678	テクノメディカ	8,700	1,971.00	17,147,700	
6699	ダイヤモンドエレクトリックホールディング	13,300	702.00	9,336,600	貸付有価証券 1,100株
6701	日本電気	469,800	9,262.00	4,351,287,600	
6702	富士通	329,200	20,625.00	6,789,750,000	

6703	沖電気工業	161,700	1,018.00	164,610,600	
6704	岩崎通信機	6,900	750.00	5,175,000	
6706	電気興業	16,000	2,320.00	37,120,000	
6707	サンケン電気	33,200	6,976.00	231,603,200	
6715	ナカヨ	2,400	1,170.00	2,808,000	貸付有価証券 200株
6718	アイホン	19,300	2,973.00	57,378,900	貸付有価証券 400株
6723	ルネサスエレクトロニクス	2,334,700	2,481.00	5,792,390,700	貸付有価証券 210,900株
6724	セイコーエプソン	459,000	2,191.50	1,005,898,500	貸付有価証券 17,700株
6727	ワコム	272,100	668.00	181,762,800	貸付有価証券 10,500株
6728	アルバック	85,000	7,247.00	615,995,000	貸付有価証券 12,100株
6730	アクセル	12,500	2,226.00	27,825,000	貸付有価証券 1,000株
6737	E I Z O	26,200	5,140.00	134,668,000	
6740	ジャパンディスプレイ	1,542,000	21.00	32,382,000	貸付有価証券 126,800株
6741	日本信号	81,500	940.00	76,610,000	
6742	京三製作所	74,900	461.00	34,528,900	
6744	能美防災	48,300	2,245.00	108,433,500	
6745	ホーチキ	26,700	1,954.00	52,171,800	
6748	星和電機	6,300	481.00	3,030,300	貸付有価証券 2,200株
6750	エレコム	85,500	1,729.00	147,829,500	
6752	パナソニック ホールディングス	4,226,200	1,395.00	5,895,549,000	
6753	シャープ	603,100	1,034.00	623,605,400	貸付有価証券 50,900株
6754	アンリツ	252,000	1,349.00	339,948,000	
6755	富士通ゼネラル	101,400	2,193.50	222,420,900	貸付有価証券 8,000株
6758	ソニーグループ	2,505,600	14,005.00	35,090,928,000	貸付有価証券 33,700株
6762	T D K	566,500	7,251.00	4,107,691,500	貸付有価証券 21,900株
6763	帝国通信工業	15,700	2,030.00	31,871,000	
6768	タムラ製作所	142,500	540.00	76,950,000	貸付有価証券 14,900株
6770	アルプスアルパイン	319,500	1,273.00	406,723,500	貸付有価証券 12,400株
6771	池上通信機	4,800	950.00	4,560,000	

6779	日本電波工業	42,900	1,261.00	54,096,900	
6785	鈴木	19,100	1,169.00	22,327,900	貸付有価証券 2,400株
6787	メイコー	35,500	4,125.00	146,437,500	
6788	日本トリム	8,000	3,130.00	25,040,000	
6789	ローランド ディー. ジー.	19,600	3,795.00	74,382,000	
6794	フォスター電機	26,500	1,089.00	28,858,500	貸付有価証券 1,300株
6798	SMK	9,500	2,508.00	23,826,000	
6800	ヨコオ	31,600	1,474.00	46,578,400	貸付有価証券 1,000株
6803	ティアック	25,000	97.00	2,425,000	貸付有価証券 3,200株
6804	ホシデン	81,300	1,769.00	143,819,700	
6806	ヒロセ電機	52,800	17,500.00	924,000,000	貸付有価証券 9,100株
6807	日本航空電子工業	85,600	3,040.00	260,224,000	貸付有価証券 10,100株
6809	TOA	40,700	1,109.00	45,136,300	貸付有価証券 4,800株
6810	マクセル	79,000	1,610.00	127,190,000	
6814	古野電気	46,500	2,022.00	94,023,000	貸付有価証券 5,700株
6817	スミダコーポレーション	47,900	1,173.00	56,186,700	貸付有価証券 3,700株
6820	アイコム	13,800	3,745.00	51,681,000	
6823	リオン	14,700	2,435.00	35,794,500	
6841	横河電機	391,400	2,937.50	1,149,737,500	貸付有価証券 15,100株
6844	新電元工業	13,700	3,120.00	42,744,000	貸付有価証券 400株
6845	アズビル	243,700	4,803.00	1,170,491,100	貸付有価証券 11,900株
6848	東亜ディーケーケー	7,000	943.00	6,601,000	貸付有価証券 2,200株
6849	日本光電工業	151,900	4,456.00	676,866,400	貸付有価証券 6,400株
6850	チノー	14,700	2,365.00	34,765,500	
6853	共和電業	14,000	428.00	5,992,000	
6855	日本電子材料	21,800	1,803.00	39,305,400	
6856	堀場製作所	67,600	11,785.00	796,666,000	貸付有価証券 11,500株
6857	アドバンテスト	1,014,800	5,716.00	5,800,596,800	貸付有価証券 43,200株
6858	小野測器	5,900	466.00	2,749,400	

6859	エスペック	28,400	2,550.00	72,420,000	
6861	キーエンス	354,400	66,340.00	23,510,896,000	
6866	日置電機	16,700	6,890.00	115,063,000	貸付有価証券 700株
6869	シスメックス	305,600	7,912.00	2,417,907,200	貸付有価証券 43,600株
6871	日本マイクロニクス	63,600	4,105.00	261,078,000	貸付有価証券 7,700株
6875	メガチップス	28,000	4,950.00	138,600,000	貸付有価証券 3,300株
6877	OBARA GROUP	19,400	4,035.00	78,279,000	貸付有価証券 1,600株
6901	澤藤電機	1,800	1,292.00	2,325,600	貸付有価証券 500株
6904	原田工業	6,700	755.00	5,058,500	貸付有価証券 2,100株
6905	コーセル	42,600	1,454.00	61,940,400	貸付有価証券 3,200株
6908	イリソ電子工業	32,600	3,475.00	113,285,000	
6914	オプテックスグループ	65,000	1,795.00	116,675,000	
6915	千代田インテグレ	13,900	2,762.00	38,391,800	
6920	レーザーテック	162,400	40,010.00	6,497,624,000	貸付有価証券 6,300株
6923	スタンレー電気	226,800	2,833.00	642,524,400	貸付有価証券 40,900株
6925	ウシオ電機	179,900	2,083.50	374,821,650	貸付有価証券 2,300株
6926	岡谷電機産業	11,500	286.00	3,289,000	
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	14,700	543.00	7,982,100	貸付有価証券 6,500株
6928	エノモト	4,200	1,601.00	6,724,200	
6929	日本セラミック	28,900	2,687.00	77,654,300	
6932	遠藤照明	6,800	1,365.00	9,282,000	
6937	古河電池	26,100	898.00	23,437,800	貸付有価証券 3,600株
6938	双信電機	6,000	312.00	1,872,000	
6941	山一電機	31,800	2,134.00	67,861,200	貸付有価証券 1,200株
6947	図研	30,800	4,085.00	125,818,000	
6951	日本電子	88,700	6,952.00	616,642,400	貸付有価証券 8,700株
6952	カシオ計算機	255,900	1,274.50	326,144,550	貸付有価証券 10,200株
6954	ファナック	1,727,300	4,300.00	7,427,390,000	貸付有価証券 207,600株

6958	日本シイエムケイ	75,200	753.00	56,625,600	
6961	エンプラス	10,300	12,340.00	127,102,000	貸付有価証券 1,500株
6962	大真空	52,700	905.00	47,693,500	貸付有価証券 1,300株
6963	ローム	654,900	2,606.50	1,706,996,850	
6965	浜松ホトニクス	284,200	5,945.00	1,689,569,000	
6966	三井ハイテック	31,400	6,857.00	215,309,800	
6967	新光電気工業	125,300	5,468.00	685,140,400	
6971	京セラ	2,200,800	2,162.50	4,759,230,000	
6976	太陽誘電	172,500	3,654.00	630,315,000	貸付有価証券 26,300株
6981	村田製作所	3,222,700	2,984.00	9,616,536,800	貸付有価証券 124,200株
6986	双葉電子工業	67,400	521.00	35,115,400	
6989	北陸電気工業	5,600	1,398.00	7,828,800	
6996	ニチコン	93,000	1,287.00	119,691,000	貸付有価証券 2,800株
6997	日本ケミコン	37,700	1,352.00	50,970,400	
6999	K O A	53,600	1,550.00	83,080,000	貸付有価証券 6,700株
7244	市光工業	63,800	579.00	36,940,200	
7276	小糸製作所	367,000	2,336.50	857,495,500	貸付有価証券 41,800株
7280	ミツバ	66,400	1,071.00	71,114,400	
7735	S C R E E Nホールディングス	121,100	14,280.00	1,729,308,000	貸付有価証券 4,800株
7739	キヤノン電子	39,100	2,021.00	79,021,100	
7751	キヤノン	1,766,700	3,775.00	6,669,292,500	貸付有価証券 68,100株
7752	リコー	888,100	1,165.00	1,034,636,500	貸付有価証券 34,300株
7965	象印マホービン	96,200	1,468.00	141,221,600	貸付有価証券 3,700株
7999	M U T O Hホールディングス	1,900	2,181.00	4,143,900	
8035	東京エレクトロン	749,700	27,970.00	20,969,109,000	貸付有価証券 28,900株
9880	イノテック	23,600	1,812.00	42,763,200	
3116	トヨタ紡織	149,100	2,425.50	361,642,050	
3526	芦森工業	3,000	2,172.00	6,516,000	貸付有価証券 900株
5949	ユニプレス	63,600	1,014.00	64,490,400	貸付有価証券 8,600株
6201	豊田自動織機	302,100	12,650.00	3,821,565,000	貸付有価証券

					30,900株
6455	モリタホールディングス	62,100	1,557.00	96,689,700	
6584	三櫻工業	54,100	828.00	44,794,800	貸付有価証券 5,600株
6902	デンソー	2,922,400	2,284.50	6,676,222,800	貸付有価証券 112,800株
6995	東海理化電機製作所	99,900	2,293.00	229,070,700	
7012	川崎重工業	289,200	3,281.00	948,865,200	貸付有価証券 34,400株
7014	名村造船所	77,200	1,355.00	104,606,000	貸付有価証券 21,000株
7102	日本車輛製造	11,700	2,116.00	24,757,200	
7105	三菱ロジスネクスト	56,500	1,489.00	84,128,500	
7122	近畿車輛	2,000	1,907.00	3,814,000	
7201	日産自動車	5,027,600	560.40	2,817,467,040	貸付有価証券 997,700株
7202	いすゞ自動車	1,029,800	2,030.00	2,090,494,000	
7203	トヨタ自動車	19,449,700	2,892.50	56,258,257,250	貸付有価証券 3,218,700株
7205	日野自動車	532,800	498.90	265,813,920	貸付有価証券 17,600株
7211	三菱自動車工業	1,381,800	453.70	626,922,660	貸付有価証券 163,900株
7212	エフテック	10,500	633.00	6,646,500	貸付有価証券 3,100株
7213	レシップホールディングス	6,500	650.00	4,225,000	
7214	GMB	2,900	1,232.00	3,572,800	貸付有価証券 1,000株
7215	ファルテック	2,700	550.00	1,485,000	貸付有価証券 700株
7220	武蔵精密工業	86,600	1,683.00	145,747,800	
7222	日産車体	41,600	968.00	40,268,800	貸付有価証券 12,500株
7224	新明和工業	102,000	1,225.00	124,950,000	貸付有価証券 4,300株
7226	極東開発工業	58,500	1,993.00	116,590,500	
7231	トピー工業	28,700	2,838.00	81,450,600	貸付有価証券 4,800株
7236	ティラド	7,900	3,585.00	28,321,500	
7238	曙ブレーキ工業	216,200	114.00	24,646,800	貸付有価証券 24,300株
7239	タチエス	65,400	1,950.00	127,530,000	
7240	NOK	137,600	1,920.00	264,192,000	貸付有価証券 1,800株
7241	フタバ産業	94,900	871.00	82,657,900	貸付有価証券

					3,100株
7242	カヤバ	34,100	5,080.00	173,228,000	
7245	大同メタル工業	69,200	541.00	37,437,200	
7246	プレス工業	141,500	638.00	90,277,000	
7247	ミクニ	19,000	480.00	9,120,000	貸付有価証券 5,600株
7250	太平洋工業	81,200	1,422.00	115,466,400	
7256	河西工業	21,100	183.00	3,861,300	貸付有価証券 6,000株
7259	アイシン	273,200	5,391.00	1,472,821,200	
7261	マツダ	1,171,600	1,703.00	1,995,234,800	
7266	今仙電機製作所	9,500	632.00	6,004,000	
7267	本田技研工業	8,637,900	1,583.50	13,678,114,650	貸付有価証券 409,800株
7269	スズキ	650,600	6,298.00	4,097,478,800	貸付有価証券 112,500株
7270	SUBARU	1,098,500	2,901.50	3,187,297,750	貸付有価証券 137,400株
7271	安永	6,600	658.00	4,342,800	
7272	ヤマハ発動機	1,530,900	1,388.50	2,125,654,650	貸付有価証券 59,100株
7277	TBK	16,300	397.00	6,471,100	貸付有価証券 5,200株
7278	エクセディ	57,900	2,775.00	160,672,500	
7282	豊田合成	103,300	2,817.50	291,047,750	
7283	愛三工業	58,600	1,352.00	79,227,200	
7284	盟和産業	2,100	1,024.00	2,150,400	
7291	日本プラスト	12,300	548.00	6,740,400	
7294	ヨロズ	33,200	920.00	30,544,000	
7296	エフ・シー・シー	62,800	1,902.00	119,445,600	
7309	シマノ	143,700	21,520.00	3,092,424,000	貸付有価証券 19,100株
7313	テイ・エス テック	126,100	1,847.00	232,906,700	
7408	ジャムコ	14,900	1,609.00	23,974,100	貸付有価証券 2,200株
4543	テルモ	990,400	4,933.00	4,885,643,200	貸付有価証券 42,000株
5187	クリエートメディック	4,900	899.00	4,405,100	貸付有価証券 300株
6376	日機装	82,500	1,068.00	88,110,000	貸付有価証券 12,800株
7600	日本エム・ディ・エム	28,100	770.00	21,637,000	

7701	島津製作所	470,600	4,095.00	1,927,107,000	
7702	JMS	32,800	529.00	17,351,200	
7709	クボテック	3,600	258.00	928,800	貸付有価証券 1,600株
7715	長野計器	25,700	2,240.00	57,568,000	貸付有価証券 3,200株
7717	ブイ・テクノロジー	18,700	2,749.00	51,406,300	貸付有価証券 2,700株
7721	東京計器	27,100	1,822.00	49,376,200	
7723	愛知時計電機	15,300	2,755.00	42,151,500	
7725	インターアクション	16,800	1,136.00	19,084,800	
7727	オーバル	13,200	554.00	7,312,800	
7729	東京精密	72,400	9,601.00	695,112,400	
7730	マニー	141,700	2,063.50	292,397,950	
7731	ニコン	512,100	1,491.00	763,541,100	貸付有価証券 19,800株
7732	トプコン	172,200	1,593.00	274,314,600	貸付有価証券 12,500株
7733	オリンパス	2,180,300	2,169.50	4,730,160,850	貸付有価証券 309,700株
7734	理研計器	25,100	7,230.00	181,473,000	貸付有価証券 3,900株
7740	タムロン	21,700	5,650.00	122,605,000	
7741	HOYA	697,300	18,190.00	12,683,887,000	貸付有価証券 89,100株
7743	シード	7,500	787.00	5,902,500	
7744	ノーリツ鋼機	33,600	3,315.00	111,384,000	
7745	A&Dホロンホールディングス	51,600	2,030.00	104,748,000	
7747	朝日インテック	395,800	2,880.00	1,139,904,000	貸付有価証券 15,200株
7762	シチズン時計	325,900	925.00	301,457,500	貸付有価証券 12,600株
7769	リズム	3,400	3,060.00	10,404,000	
7775	大研医器	13,000	521.00	6,773,000	貸付有価証券 3,100株
7780	メニコン	121,800	2,213.00	269,543,400	貸付有価証券 4,700株
7782	シンシア	1,400	530.00	742,000	
7979	松風	16,000	2,941.00	47,056,000	
8050	セイコーグループ	49,400	2,592.00	128,044,800	貸付有価証券 100株
8086	ニプロ	295,200	1,168.00	344,793,600	
7795	KYORITSU	22,500	189.00	4,252,500	

7811	中本ボックス	4,800	1,712.00	8,217,600	貸付有価証券 800株
7816	スノーピーク	50,500	876.00	44,238,000	貸付有価証券 6,100株
7817	パラマウントベッドホールディングス	73,600	2,672.00	196,659,200	
7818	トランザクション	23,300	2,371.00	55,244,300	
7819	粧美堂	4,100	690.00	2,829,000	
7820	ニホンフラッシュ	33,200	935.00	31,042,000	
7821	前田工織	29,900	3,170.00	94,783,000	貸付有価証券 6,100株
7822	永大産業	17,900	233.00	4,170,700	貸付有価証券 3,400株
7823	アートネイチャー	31,900	803.00	25,615,700	
7826	フルヤ金属	6,300	9,320.00	58,716,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	970,400	3,151.00	3,057,730,400	貸付有価証券 174,800株
7833	アイフィスジャパン	4,200	609.00	2,557,800	
7839	SHOEI	80,000	1,973.00	157,840,000	貸付有価証券 11,500株
7840	フランスベッドホールディングス	45,800	1,380.00	63,204,000	
7846	パイロットコーポレーション	49,800	4,117.00	205,026,600	
7856	萩原工業	23,700	1,480.00	35,076,000	
7864	フジシールインターナショナル	71,700	1,732.00	124,184,400	
7867	タカラトミー	161,200	2,511.50	404,853,800	
7868	広済堂ホールディングス	79,700	798.00	63,600,600	貸付有価証券 15,500株
7872	エステールホールディングス	3,600	638.00	2,296,800	
7885	タカノ	5,600	1,000.00	5,600,000	
7893	プロネクサス	36,700	1,301.00	47,746,700	
7897	ホクシン	11,600	113.00	1,310,800	貸付有価証券 4,600株
7898	ウッドワン	5,100	1,042.00	5,314,200	貸付有価証券 300株
7911	TOPPANホールディングス	435,400	4,045.00	1,761,193,000	貸付有価証券 16,800株
7912	大日本印刷	387,100	4,198.00	1,625,045,800	貸付有価証券 54,000株
7914	共同印刷	10,000	3,350.00	33,500,000	
7915	NISSHA	60,600	1,604.00	97,202,400	貸付有価証券 2,400株
7916	光村印刷	1,100	1,558.00	1,713,800	貸付有価証券 400株
7921	TAKARA & COMPANY	22,600	2,822.00	63,777,200	

7936	アシックス	301,800	4,514.00	1,362,325,200	貸付有価証券 11,600株
7937	ツツミ	8,300	2,160.00	17,928,000	貸付有価証券 1,400株
7944	ローランド	26,100	4,930.00	128,673,000	貸付有価証券 3,300株
7949	小松ウオール工業	14,400	3,440.00	49,536,000	
7951	ヤマハ	223,300	3,264.00	728,851,200	貸付有価証券 35,000株
7952	河合楽器製作所	10,700	3,670.00	39,269,000	
7955	クリナップ	34,700	737.00	25,573,900	
7956	ビジョン	225,600	1,616.00	364,569,600	貸付有価証券 8,700株
7962	キングジム	31,300	870.00	27,231,000	
7966	リンテック	71,100	2,769.00	196,875,900	
7972	イトーキ	72,600	1,460.00	105,996,000	貸付有価証券 300株
7974	任天堂	2,236,300	7,895.00	17,655,588,500	
7976	三菱鉛筆	50,300	2,013.00	101,253,900	
7981	タカラスタンダード	74,600	1,742.00	129,953,200	
7984	コクヨ	144,900	2,377.50	344,499,750	
7987	ナカバヤシ	38,100	542.00	20,650,200	
7990	グローブライド	31,800	2,072.00	65,889,600	
7994	オカムラ	106,600	2,228.00	237,504,800	
8022	美津濃	35,200	4,340.00	152,768,000	
9501	東京電力ホールディングス	3,193,000	756.20	2,414,546,600	貸付有価証券 123,000株
9502	中部電力	1,305,300	1,858.00	2,425,247,400	貸付有価証券 135,500株
9503	関西電力	1,367,800	1,923.00	2,630,279,400	
9504	中国電力	615,400	1,021.00	628,323,400	貸付有価証券 54,200株
9505	北陸電力	362,200	709.30	256,908,460	貸付有価証券 53,500株
9506	東北電力	932,600	966.40	901,264,640	
9507	四国電力	329,900	1,046.50	345,240,350	貸付有価証券 11,700株
9508	九州電力	816,500	1,059.00	864,673,500	
9509	北海道電力	342,200	643.30	220,137,260	
9511	沖縄電力	90,500	1,145.00	103,622,500	
9513	電源開発	291,000	2,428.50	706,693,500	
9514	エフオン	22,900	444.00	10,167,600	

9517	イーレックス	63,000	780.00	49,140,000	貸付有価証券 8,800株
9519	レノバ	94,400	1,192.00	112,524,800	貸付有価証券 7,300株
9531	東京瓦斯	748,800	3,295.00	2,467,296,000	貸付有価証券 5,700株
9532	大阪瓦斯	717,500	2,988.00	2,143,890,000	貸付有価証券 49,500株
9533	東邦瓦斯	153,400	2,954.50	453,220,300	貸付有価証券 21,800株
9534	北海道瓦斯	21,100	2,244.00	47,348,400	
9535	広島ガス	74,800	389.00	29,097,200	
9536	西部ガスホールディングス	36,900	1,918.00	70,774,200	貸付有価証券 5,000株
9543	静岡ガス	70,600	1,005.00	70,953,000	
9551	メタウォーター	42,400	2,160.00	91,584,000	貸付有価証券 2,300株
2384	SBSホールディングス	31,600	2,520.00	79,632,000	貸付有価証券 1,200株
9001	東武鉄道	389,100	3,884.00	1,511,264,400	貸付有価証券 15,000株
9003	相鉄ホールディングス	126,800	2,713.00	344,008,400	
9005	東急	993,200	1,720.50	1,708,800,600	貸付有価証券 112,700株
9006	京浜急行電鉄	438,300	1,287.00	564,092,100	
9007	小田急電鉄	585,700	2,238.00	1,310,796,600	貸付有価証券 21,400株
9008	京王電鉄	170,300	4,357.00	741,997,100	
9009	京成電鉄	228,400	6,748.00	1,541,243,200	貸付有価証券 40,600株
9010	富士急行	43,600	4,425.00	192,930,000	貸付有価証券 6,000株
9020	東日本旅客鉄道	650,700	8,314.00	5,409,919,800	貸付有価証券 23,200株
9021	西日本旅客鉄道	420,200	6,032.00	2,534,646,400	貸付有価証券 17,500株
9022	東海旅客鉄道	1,364,300	3,616.00	4,933,308,800	貸付有価証券 53,000株
9024	西武ホールディングス	428,500	2,050.00	878,425,000	貸付有価証券 16,600株
9025	鴻池運輸	60,400	1,950.00	117,780,000	貸付有価証券 300株
9031	西日本鉄道	94,600	2,417.00	228,648,200	貸付有価証券 2,500株
9037	ハマキョウレックス	30,200	4,080.00	123,216,000	貸付有価証券 600株
9039	サカイ引越センター	39,200	2,779.00	108,936,800	

9041	近鉄グループホールディングス	353,600	4,532.00	1,602,515,200	貸付有価証券 20,400株
9042	阪急阪神ホールディングス	471,500	4,473.00	2,109,019,500	貸付有価証券 18,200株
9044	南海電気鉄道	157,700	2,824.00	445,344,800	貸付有価証券 16,500株
9045	京阪ホールディングス	194,900	3,601.00	701,834,900	貸付有価証券 6,300株
9046	神戸電鉄	9,600	2,892.00	27,763,200	
9048	名古屋鉄道	364,800	2,256.00	822,988,800	貸付有価証券 15,100株
9052	山陽電気鉄道	26,600	2,173.00	57,801,800	
9055	アルプス物流	28,200	1,799.00	50,731,800	
9064	ヤマトホールディングス	452,800	2,591.00	1,173,204,800	貸付有価証券 55,400株
9065	山九	90,000	5,194.00	467,460,000	
9067	丸運	7,700	280.00	2,156,000	貸付有価証券 2,400株
9068	丸全昭和運輸	21,800	4,015.00	87,527,000	
9069	センコーグループホールディングス	187,200	1,141.00	213,595,200	貸付有価証券 7,300株
9070	トナミホールディングス	7,800	4,755.00	37,089,000	
9072	ニッコンホールディングス	113,200	3,104.00	351,372,800	貸付有価証券 5,100株
9074	日本石油輸送	1,500	2,892.00	4,338,000	
9075	福山通運	40,400	4,070.00	164,428,000	貸付有価証券 1,100株
9076	セイノーホールディングス	198,900	2,131.00	423,855,900	貸付有価証券 7,700株
9078	エスライングループ本社	4,300	886.00	3,809,800	
9081	神奈川中央交通	10,000	3,065.00	30,650,000	
9090	AZ-COM丸和ホールディングス	90,400	1,550.00	140,120,000	
9099	C&Fロジホールディングス	34,000	1,666.00	56,644,000	
9142	九州旅客鉄道	250,000	3,171.00	792,750,000	
9143	SGホールディングス	593,800	2,007.00	1,191,756,600	
9147	NIPPON EXPRESSホール ディン	120,000	8,737.00	1,048,440,000	貸付有価証券 4,700株
9101	日本郵船	1,013,600	4,970.00	5,037,592,000	貸付有価証券 36,500株
9104	商船三井	767,400	5,113.00	3,923,716,200	貸付有価証券 24,100株
9107	川崎汽船	298,600	7,006.00	2,091,991,600	貸付有価証券 10,300株
9110	NSユニテッド海運	19,100	5,100.00	97,410,000	貸付有価証券 1,300株

9115	明海グループ	16,300	793.00	12,925,900	
9119	飯野海運	129,800	1,262.00	163,807,600	貸付有価証券 19,800株
9130	共栄タンカー	2,800	909.00	2,545,200	貸付有価証券 800株
9308	乾汽船	41,400	1,110.00	45,954,000	貸付有価証券 4,300株
9201	日本航空	868,600	2,811.50	2,442,068,900	
9202	A N Aホールディングス	962,200	3,162.00	3,042,476,400	
9232	パスコ	2,800	1,815.00	5,082,000	
9058	トランコム	10,300	7,150.00	73,645,000	
9066	日新	26,900	2,706.00	72,791,400	
9301	三菱倉庫	86,900	4,514.00	392,266,600	貸付有価証券 16,300株
9302	三井倉庫ホールディングス	33,100	4,965.00	164,341,500	
9303	住友倉庫	95,400	2,621.00	250,043,400	
9304	澁澤倉庫	16,100	3,090.00	49,749,000	
9306	東陽倉庫	4,000	1,555.00	6,220,000	
9310	日本トランスシティ	71,100	632.00	44,935,200	
9312	ケイヒン	2,700	1,838.00	4,962,600	
9319	中央倉庫	18,900	1,160.00	21,924,000	
9322	川西倉庫	2,700	1,136.00	3,067,200	貸付有価証券 200株
9324	安田倉庫	24,100	1,205.00	29,040,500	
9325	ファイズホールディングス	2,100	1,192.00	2,503,200	
9351	東洋埠頭	4,400	1,390.00	6,116,000	貸付有価証券 1,300株
9364	上組	163,300	3,389.00	553,423,700	貸付有価証券 6,400株
9366	サンリツ	3,600	768.00	2,764,800	
9368	キムラユニティー	7,100	1,562.00	11,090,200	
9369	キューソー流通システム	14,100	939.00	13,239,900	
9380	東海運	8,800	295.00	2,596,000	
9381	エーアイテイナー	22,200	1,817.00	40,337,400	
9384	内外トランスライン	14,200	2,448.00	34,761,600	貸付有価証券 2,000株
9386	日本コンセプト	12,900	1,739.00	22,433,100	
1973	N E C ネットズエスアイ	138,500	2,252.00	311,902,000	
2307	クロスキャット	22,500	1,156.00	26,010,000	貸付有価証券 2,200株
2317	システナ	537,500	302.00	162,325,000	貸付有価証券

					23,100株
2326	デジタルアーツ	22,500	5,040.00	113,400,000	
2327	日鉄ソリューションズ	60,600	4,835.00	293,001,000	
2335	キューブシステム	18,800	1,124.00	21,131,200	
2359	コア	15,700	1,817.00	28,526,900	
2477	手間いらず	6,000	2,920.00	17,520,000	貸付有価証券 700株
3031	ラクーンホールディングス	29,500	687.00	20,266,500	
3040	ソリトンシステムズ	18,300	1,408.00	25,766,400	
3371	ソフトクリエイトホールディングス	29,200	1,730.00	50,516,000	
3626	T I S	388,500	3,315.00	1,287,877,500	
3627	テクミラホールディングス	6,900	442.00	3,049,800	貸付有価証券 2,400株
3632	グリーン	95,200	594.00	56,548,800	貸付有価証券 2,300株
3633	GMOペパボ	4,300	1,187.00	5,104,100	貸付有価証券 500株
3635	コーエーテクモホールディングス	222,600	1,788.00	398,008,800	貸付有価証券 23,000株
3636	三菱総合研究所	17,400	4,810.00	83,694,000	
3639	ボルテージ	4,400	267.00	1,174,800	貸付有価証券 500株
3640	電算	1,800	1,509.00	2,716,200	貸付有価証券 500株
3648	A G S	6,200	848.00	5,257,600	
3649	ファインデックス	28,200	1,027.00	28,961,400	
3655	ブレインパッド	26,600	1,204.00	32,026,400	
3656	K L a b	65,300	366.00	23,899,800	貸付有価証券 10,900株
3657	ポールトゥウィンホールディングス	60,600	536.00	32,481,600	
3659	ネクソン	794,800	2,378.00	1,890,034,400	
3660	アイスタイル	105,400	428.00	45,111,200	貸付有価証券 11,100株
3661	エムアップホールディングス	43,500	1,008.00	43,848,000	貸付有価証券 100株
3662	エイチーム	21,000	579.00	12,159,000	
3665	エニグモ	45,200	364.00	16,452,800	貸付有価証券 3,900株
3666	テクノスジャパン	13,100	628.00	8,226,800	貸付有価証券 3,400株
3667	e n i s h	11,900	176.00	2,094,400	貸付有価証券 1,900株
3668	コロプラ	137,800	626.00	86,262,800	貸付有価証券 9,600株

3672	オルトプラス	12,100	146.00	1,766,600	貸付有価証券 2,400株
3673	ブロードリーフ	168,600	607.00	102,340,200	
3675	クロス・マーケティンググループ	6,400	581.00	3,718,400	貸付有価証券 700株
3676	デジタルハーツホールディングス	22,200	1,050.00	23,310,000	貸付有価証券 100株
3678	メディアドゥ	16,000	1,368.00	21,888,000	貸付有価証券 1,400株
3679	じげん	103,600	529.00	54,804,400	
3681	ブイキューブ	42,600	312.00	13,291,200	
3682	エンカレッジ・テクノロジー	3,600	604.00	2,174,400	貸付有価証券 700株
3683	サイバーリンクス	5,100	800.00	4,080,000	貸付有価証券 1,400株
3686	ディー・エル・イー	10,700	195.00	2,086,500	貸付有価証券 3,100株
3687	フィックスターズ	40,100	1,670.00	66,967,000	
3688	CARTA HOLDINGS	16,700	1,531.00	25,567,700	
3694	オプティム	36,500	945.00	34,492,500	貸付有価証券 1,100株
3696	セレス	14,300	1,128.00	16,130,400	
3697	SHIFT	23,600	26,600.00	627,760,000	貸付有価証券 1,700株
3738	ティーガイア	37,100	1,974.00	73,235,400	
3741	セック	3,800	5,280.00	20,064,000	
3762	テクマトリックス	64,900	1,664.00	107,993,600	
3763	プロシップ	17,100	1,390.00	23,769,000	貸付有価証券 1,200株
3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	92,500	2,478.00	229,215,000	貸付有価証券 10,500株
3769	GMOペイメントゲートウェイ	71,000	8,743.00	620,753,000	貸付有価証券 9,000株
3770	ザッパラス	4,200	444.00	1,864,800	貸付有価証券 2,200株
3771	システムリサーチ	12,200	2,961.00	36,124,200	
3774	インターネットイニシアティブ	169,800	2,950.00	500,910,000	貸付有価証券 21,900株
3778	さくらインターネット	39,900	3,855.00	153,814,500	貸付有価証券 4,700株
3788	GMOグローバルサイン・ホールディングス	10,800	2,848.00	30,758,400	
3817	SRAホールディングス	18,200	3,780.00	68,796,000	
3826	システムインテグレータ	4,400	429.00	1,887,600	貸付有価証券 1,300株

3834	朝日ネット	38,100	624.00	23,774,400	
3835	e B A S E	50,000	720.00	36,000,000	貸付有価証券 5,200株
3836	アバントグループ	44,900	1,449.00	65,060,100	
3837	アドソル日進	14,900	1,577.00	23,497,300	
3839	ODKソリューションズ	2,800	601.00	1,682,800	
3843	フリービット	18,600	1,519.00	28,253,400	貸付有価証券 2,600株
3844	コムチュア	51,200	1,848.00	94,617,600	
3853	アステリア	27,800	602.00	16,735,600	貸付有価証券 2,600株
3854	アイル	16,600	3,185.00	52,871,000	
3901	マークライnz	19,300	3,015.00	58,189,500	
3902	メディカル・データ・ビジョン	42,400	640.00	27,136,000	
3903	g u m i	52,400	405.00	21,222,000	貸付有価証券 5,500株
3909	ショーケース	3,500	324.00	1,134,000	貸付有価証券 1,000株
3912	モバイルファクトリー	3,200	652.00	2,086,400	貸付有価証券 1,000株
3915	テラスカイ	15,300	1,514.00	23,164,200	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	20,500	1,685.00	34,542,500	
3918	P C Iホールディングス	5,800	1,008.00	5,846,400	
3920	アイビーシー	2,300	493.00	1,133,900	
3921	ネオジャパン	11,900	1,048.00	12,471,200	
3922	P R T I M E S	7,100	2,145.00	15,229,500	
3923	ラクス	168,000	2,433.00	408,744,000	
3924	ランドコンピュータ	7,300	908.00	6,628,400	
3925	ダブルスタンダード	10,800	1,647.00	17,787,600	
3926	オーブンドア	20,700	871.00	18,029,700	貸付有価証券 3,100株
3928	マイネット	4,900	292.00	1,430,800	貸付有価証券 1,400株
3932	アカツキ	16,900	2,656.00	44,886,400	貸付有価証券 1,500株
3934	ベネフィットジャパン	900	1,230.00	1,107,000	貸付有価証券 300株
3937	U b i c o mホールディングス	11,000	1,501.00	16,511,000	貸付有価証券 1,000株
3939	カナミックネットワーク	38,300	418.00	16,009,400	
3940	ノムラシステムコーポレーション	14,700	114.00	1,675,800	貸付有価証券

					4,000株
3962	チェンジホールディングス	77,300	1,411.00	109,070,300	貸付有価証券 5,400株
3963	シンクロ・フード	8,500	669.00	5,686,500	
3964	オークネット	13,100	2,110.00	27,641,000	
3965	キャピタル・アセット・プランニング	2,800	763.00	2,136,400	貸付有価証券 1,200株
3968	セグエグループ	4,300	912.00	3,921,600	
3969	エイトレッド	2,200	1,395.00	3,069,000	貸付有価証券 500株
3978	マクロミル	69,700	800.00	55,760,000	
3981	ビーグリー	2,700	1,292.00	3,488,400	貸付有価証券 800株
3983	オロ	12,800	2,971.00	38,028,800	
3984	ユーザーローカル	12,800	2,091.00	26,764,800	貸付有価証券 1,400株
3985	テモナ	3,000	263.00	789,000	貸付有価証券 600株
3992	ニーズウェル	8,300	783.00	6,498,900	貸付有価証券 1,000株
3994	マネーフォワード	79,000	5,426.00	428,654,000	貸付有価証券 10,100株
3996	サインポスト	5,400	532.00	2,872,800	貸付有価証券 700株
4053	Sun Asterisk	25,200	992.00	24,998,400	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	21,000	2,632.00	55,272,000	
4072	電算システムホールディングス	15,700	2,920.00	45,844,000	貸付有価証券 200株
4180	Appier Group	121,400	1,797.00	218,155,800	貸付有価証券 1,500株
4194	ビジョナル	21,000	9,530.00	200,130,000	
4284	ソルクシーズ	12,300	404.00	4,969,200	貸付有価証券 3,800株
4295	フェイス	4,300	483.00	2,076,900	貸付有価証券 1,500株
4298	プロトコーポレーション	38,900	1,318.00	51,270,200	
4299	ハイマックス	11,100	1,411.00	15,662,100	
4307	野村総合研究所	787,000	4,337.00	3,413,219,000	貸付有価証券 27,300株
4320	CEホールディングス	7,700	624.00	4,804,800	
4323	日本システム技術	11,500	3,355.00	38,582,500	貸付有価証券 1,000株
4326	インテージホールディングス	40,200	1,744.00	70,108,800	
4333	東邦システムサイエンス	11,600	1,309.00	15,184,400	

4344	ソースネクスト	162,600	153.00	24,877,800	貸付有価証券 20,400株
4348	インフォコム	45,800	2,555.00	117,019,000	
4373	シンプレクス・ホールディングス	53,400	2,897.00	154,699,800	貸付有価証券 3,400株
4382	HEROZ	11,900	1,680.00	19,992,000	貸付有価証券 600株
4384	ラクスル	85,600	1,186.00	101,521,600	貸付有価証券 9,600株
4385	メルカリ	215,400	2,451.50	528,053,100	貸付有価証券 27,600株
4390	I P S	10,200	1,972.00	20,114,400	貸付有価証券 1,100株
4392	F I G	17,500	317.00	5,547,500	貸付有価証券 900株
4396	システムサポート	13,700	2,012.00	27,564,400	
4420	イーソル	25,600	585.00	14,976,000	貸付有価証券 2,400株
4430	東海ソフト	2,200	1,162.00	2,556,400	
4432	ウイングアーク1st	36,900	2,825.00	104,242,500	
4433	ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	9,500	1,200.00	11,400,000	
4434	サーバーワークス	7,300	3,930.00	28,689,000	貸付有価証券 500株
4439	東名	1,200	2,224.00	2,668,800	貸付有価証券 500株
4440	ヴィッツ	1,400	837.00	1,171,800	貸付有価証券 400株
4441	トビラシステムズ	3,900	887.00	3,459,300	貸付有価証券 900株
4443	S a n s a n	116,500	1,386.00	161,469,000	貸付有価証券 20,900株
4446	L i n k - U	3,000	664.00	1,992,000	貸付有価証券 1,100株
4449	ギフトィ	31,000	1,644.00	50,964,000	貸付有価証券 4,000株
4480	メドレー	47,700	4,540.00	216,558,000	貸付有価証券 1,800株
4481	ベース	12,300	3,355.00	41,266,500	貸付有価証券 1,600株
4483	J M D C	60,600	4,007.00	242,824,200	貸付有価証券 9,300株
4662	フォーカスシステムズ	23,700	1,052.00	24,932,400	
4674	クレスコ	29,100	1,903.00	55,377,300	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	341,200	1,727.00	589,252,400	貸付有価証券 13,200株
4684	オービック	118,700	22,765.00	2,702,205,500	

4686	ジャストシステム	51,000	3,200.00	163,200,000	貸付有価証券 200株
4687	TDCソフト	33,300	2,205.00	73,426,500	
4689	LINEヤフー	5,057,200	467.90	2,366,263,880	
4704	トレンドマイクロ	167,900	8,192.00	1,375,436,800	貸付有価証券 6,500株
4709	IDホールディングス	23,900	1,724.00	41,203,600	
4716	日本オラクル	68,000	11,685.00	794,580,000	貸付有価証券 2,700株
4719	アルファシステムズ	9,300	3,105.00	28,876,500	
4722	フューチャー	75,800	1,771.00	134,241,800	
4725	CAC Holdings	19,000	1,773.00	33,687,000	
4726	SBテクノロジー	15,100	2,473.00	37,342,300	
4728	トーセ	4,200	712.00	2,990,400	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	49,900	6,863.00	342,463,700	貸付有価証券 2,600株
4743	アイティフォー	45,500	1,211.00	55,100,500	
4746	東計電算	9,900	3,510.00	34,749,000	
4762	エクスネット	2,000	1,127.00	2,254,000	貸付有価証券 100株
4768	大塚商会	176,200	6,134.00	1,080,810,800	
4776	サイボウズ	48,900	2,138.00	104,548,200	貸付有価証券 7,000株
4812	電通総研	43,200	5,640.00	243,648,000	
4813	ACCESS	36,900	776.00	28,634,400	貸付有価証券 4,100株
4819	デジタルガレージ	56,800	3,595.00	204,196,000	貸付有価証券 7,900株
4820	EMシステムズ	59,200	686.00	40,611,200	貸付有価証券 800株
4825	ウェザーニューズ	11,000	5,450.00	59,950,000	貸付有価証券 1,200株
4826	C I J	59,000	672.00	39,648,000	貸付有価証券 2,300株
4828	ビジネスエンジニアリング	5,800	4,585.00	26,593,000	
4829	日本エンタープライズ	15,600	127.00	1,981,200	貸付有価証券 4,400株
4839	WOWOW	26,700	1,139.00	30,411,300	
4845	スカラ	32,900	759.00	24,971,100	
4847	インテリジェント ウェイブ	8,000	1,062.00	8,496,000	
5032	ANYCOLOR	12,500	3,770.00	47,125,000	
6879	IMAGICA GROUP	35,600	634.00	22,570,400	

7518	ネットワンシステムズ	143,400	2,374.00	340,431,600	
7527	システムソフト	123,600	61.00	7,539,600	貸付有価証券 10,300株
7595	アルゴグラフィックス	32,600	3,960.00	129,096,000	
7844	マーベラス	57,700	754.00	43,505,800	貸付有価証券 2,100株
7860	エイベックス	60,500	1,406.00	85,063,000	
8056	B I P R O G Y	116,200	4,330.00	503,146,000	
8157	都築電気	18,700	2,178.00	40,728,600	
9401	T B Sホールディングス	178,700	3,412.00	609,724,400	貸付有価証券 26,500株
9404	日本テレビホールディングス	314,500	1,701.50	535,121,750	
9405	朝日放送グループホールディングス	33,200	671.00	22,277,200	
9409	テレビ朝日ホールディングス	86,300	1,752.00	151,197,600	貸付有価証券 1,100株
9412	スカパー J S A Tホールディングス	275,900	757.00	208,856,300	
9413	テレビ東京ホールディングス	25,600	3,085.00	78,976,000	
9414	日本BS放送	5,400	902.00	4,870,800	
9416	ビジョン	53,500	1,182.00	63,237,000	
9417	スマートバリュー	3,600	404.00	1,454,400	貸付有価証券 1,400株
9418	USEN-NEXT HOLDING S	39,800	4,295.00	170,941,000	
9419	ワイヤレスゲート	6,600	285.00	1,881,000	貸付有価証券 2,400株
9424	日本通信	349,700	231.00	80,780,700	
9428	クロップス	2,000	1,126.00	2,252,000	
9432	日本電信電話	105,672,300	183.40	19,380,299,820	
9433	K D D I	2,745,100	4,859.00	13,338,440,900	
9434	ソフトバンク	5,716,500	1,933.50	11,052,852,750	貸付有価証券 219,900株
9435	光通信	35,800	25,320.00	906,456,000	
9438	エムティーアイ	24,300	594.00	14,434,200	貸付有価証券 1,000株
9449	GMOインターネットグループ	131,300	2,640.50	346,697,650	貸付有価証券 10,000株
9450	ファイバーゲート	19,100	954.00	18,221,400	
9466	アイドママーケティングコミュニケー ション	3,500	234.00	819,000	貸付有価証券 1,300株
9468	K A D O K A W A	187,800	3,143.00	590,255,400	貸付有価証券 30,700株
9470	学研ホールディングス	59,100	1,030.00	60,873,000	

9474	ゼンリン	60,700	881.00	53,476,700	
9475	昭文社ホールディングス	6,500	356.00	2,314,000	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	177.00	2,460,300	貸付有価証券 3,600株
9600	アイネット	21,500	1,988.00	42,742,000	
9601	松竹	18,500	10,035.00	185,647,500	貸付有価証券 2,900株
9602	東宝	197,600	4,789.00	946,306,400	
9605	東映	11,700	20,430.00	239,031,000	
9613	N T Tデータグループ	928,900	2,103.00	1,953,476,700	貸付有価証券 43,000株
9629	ピー・シー・エー	20,400	1,208.00	24,643,200	貸付有価証券 600株
9658	ビジネスブレイン太田昭和	13,900	2,204.00	30,635,600	
9682	D T S	74,900	3,625.00	271,512,500	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	162,300	5,837.00	947,345,100	貸付有価証券 18,600株
9692	シーイーシー	44,800	1,701.00	76,204,800	
9697	カプコン	317,700	5,505.00	1,748,938,500	貸付有価証券 13,500株
9702	アイ・エス・ビー	18,100	1,573.00	28,471,300	
9717	ジャステック	21,800	1,351.00	29,451,800	
9719	S C S K	248,600	2,852.50	709,131,500	貸付有価証券 30,300株
9739	N S W	15,800	2,850.00	45,030,000	
9742	アイネス	27,700	1,598.00	44,264,600	
9746	T K C	56,300	3,785.00	213,095,500	
9749	富士ソフト	71,400	6,380.00	455,532,000	
9759	N S D	126,800	2,760.00	349,968,000	
9766	コナミグループ	133,100	8,872.00	1,180,863,200	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	21,900	2,608.00	57,115,200	
9889	J B C Cホールディングス	23,500	4,075.00	95,762,500	
9928	ミロク情報サービス	32,300	1,822.00	58,850,600	
9984	ソフトバンクグループ	1,752,400	6,520.00	11,425,648,000	貸付有価証券 67,600株
2676	高千穂交易	10,400	4,135.00	43,004,000	貸付有価証券 900株
2689	オルバヘルスケアホールディングス	2,400	1,858.00	4,459,200	貸付有価証券 500株
2692	伊藤忠食品	8,400	7,390.00	62,076,000	

2715	エレマテック	33,600	1,855.00	62,328,000	
2733	あらた	57,300	3,200.00	183,360,000	
2737	トーメンデバイス	5,400	5,340.00	28,836,000	
2760	東京エレクトロニクスデバイス	37,400	5,890.00	220,286,000	貸付有価証券 4,800株
2767	円谷フィールズホールディングス	64,300	1,696.00	109,052,800	貸付有価証券 6,800株
2768	双日	417,200	3,418.00	1,425,989,600	
2784	アルフレッサホールディングス	376,200	2,402.50	903,820,500	
2874	横浜冷凍	102,100	1,081.00	110,370,100	貸付有価証券 12,200株
3004	神栄	2,300	1,806.00	4,153,800	貸付有価証券 600株
3023	ラサ商事	13,300	1,664.00	22,131,200	
3036	アルコニックス	49,300	1,393.00	68,674,900	
3038	神戸物産	289,900	3,830.00	1,110,317,000	貸付有価証券 11,100株
3054	ハイパー	3,100	308.00	954,800	貸付有価証券 600株
3076	あいホールディングス	60,000	2,509.00	150,540,000	
3079	ディーブイエックス	4,300	1,078.00	4,635,400	貸付有価証券 1,600株
3107	ダイワボウホールディングス	165,900	3,221.00	534,363,900	
3132	マクニカホールディングス	88,700	8,000.00	709,600,000	貸付有価証券 1,200株
3139	ラクト・ジャパン	14,500	2,160.00	31,320,000	
3150	グリムス	15,800	2,091.00	33,037,800	貸付有価証券 1,400株
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	56,700	1,141.00	64,694,700	
3153	八洲電機	30,300	1,319.00	39,965,700	
3154	メディアスホールディングス	24,000	761.00	18,264,000	
3156	レスターホールディングス	31,900	3,040.00	96,976,000	
3157	ジオリーブグループ	3,300	1,363.00	4,497,900	貸付有価証券 1,000株
3160	大光	6,800	628.00	4,270,400	貸付有価証券 2,300株
3166	OCHIホールディングス	3,500	1,569.00	5,491,500	
3167	TOKAIホールディングス	203,500	976.00	198,616,000	
3168	黒谷	4,300	606.00	2,605,800	貸付有価証券 1,400株
3173	Cominix	2,900	822.00	2,383,800	
3176	三洋貿易	42,300	1,250.00	52,875,000	貸付有価証券

					4,400株
3180	ビューティガレージ	11,800	2,226.00	26,266,800	
3183	ウイン・パートナーズ	24,200	1,223.00	29,596,600	
3321	ミタチ産業	4,000	1,150.00	4,600,000	貸付有価証券 900株
3360	シップヘルスケアホールディングス	134,700	2,307.50	310,820,250	
3388	明治電機工業	13,900	1,440.00	20,016,000	
3392	デリカフーズホールディングス	6,600	588.00	3,880,800	
3393	スターティアホールディングス	3,600	1,517.00	5,461,200	貸付有価証券 1,000株
3543	コメダホールディングス	91,800	2,781.00	255,295,800	
3559	ビーバンドットコム	1,900	385.00	731,500	貸付有価証券 800株
3565	アセンテック	14,300	587.00	8,394,100	貸付有価証券 600株
5009	富士興産	4,200	1,988.00	8,349,600	貸付有価証券 1,400株
6973	協栄産業	1,600	2,736.00	4,377,600	
7128	フルサト・マルカホールディングス	33,300	2,411.00	80,286,300	
7130	ヤマエグループホールディングス	21,200	3,235.00	68,582,000	貸付有価証券 4,100株
7414	小野建	36,800	1,805.00	66,424,000	
7417	南陽	3,200	2,184.00	6,988,800	
7420	佐鳥電機	18,300	2,380.00	43,554,000	
7427	エコートレーディング	3,000	1,209.00	3,627,000	貸付有価証券 1,000株
7433	伯東	21,500	6,010.00	129,215,000	貸付有価証券 2,700株
7438	コンドーテック	28,800	1,235.00	35,568,000	
7442	中山福	8,400	374.00	3,141,600	貸付有価証券 2,500株
7447	ナガイレーベン	47,300	2,315.00	109,499,500	
7451	三菱食品	34,600	4,925.00	170,405,000	貸付有価証券 2,300株
7456	松田産業	28,500	2,678.00	76,323,000	
7458	第一興商	145,000	2,062.50	299,062,500	貸付有価証券 7,800株
7459	メディパルホールディングス	387,900	2,292.50	889,260,750	
7466	S P K	16,600	1,988.00	33,000,800	
7467	萩原電気ホールディングス	16,100	4,975.00	80,097,500	貸付有価証券 500株
7476	アズワン	58,700	5,557.00	326,195,900	
7480	スズデン	13,100	2,432.00	31,859,200	貸付有価証券

					100株
7481	尾家産業	3,700	1,750.00	6,475,000	
7482	シモジマ	25,100	1,314.00	32,981,400	
7483	ドウシシャ	34,700	2,201.00	76,374,700	
7487	小津産業	3,600	1,643.00	5,914,800	
7504	高速	22,200	2,232.00	49,550,400	
7510	たけびし	14,300	2,010.00	28,743,000	
7525	リックス	6,600	3,685.00	24,321,000	
7537	丸文	33,400	1,695.00	56,613,000	
7552	ハピネット	31,900	2,841.00	90,627,900	貸付有価証券 700株
7570	橋本総業ホールディングス	14,800	1,298.00	19,210,400	
7575	日本ライフライン	109,800	1,311.00	143,947,800	
7590	タカショー	32,600	505.00	16,463,000	貸付有価証券 3,800株
7599	I DOM	99,100	859.00	85,126,900	
7607	進和	22,900	2,419.00	55,395,100	
7608	エスケイジャパン	3,800	702.00	2,667,600	貸付有価証券 1,000株
7609	ダイトロン	14,800	2,974.00	44,015,200	
7613	シークス	53,400	1,475.00	78,765,000	貸付有価証券 4,500株
7619	田中商事	4,400	783.00	3,445,200	
7628	オーハシテクニカ	19,600	1,754.00	34,378,400	
7637	白銅	10,500	2,433.00	25,546,500	
7673	ダイコー通産	1,600	1,201.00	1,921,600	貸付有価証券 400株
8001	伊藤忠商事	2,519,200	6,535.00	16,462,972,000	貸付有価証券 305,000株
8002	丸紅	3,124,600	2,459.50	7,684,953,700	
8007	高島	9,600	1,264.00	12,134,400	
8012	長瀬産業	171,800	2,380.50	408,969,900	
8014	蝶理	23,500	2,947.00	69,254,500	
8015	豊田通商	328,300	9,479.00	3,111,955,700	貸付有価証券 27,700株
8018	三共生興	51,900	740.00	38,406,000	
8020	兼松	156,700	2,223.00	348,344,100	貸付有価証券 5,700株
8025	ツカモトコーポレーション	2,200	1,212.00	2,666,400	
8031	三井物産	2,823,700	5,803.00	16,385,931,100	

8032	日本紙パルプ商事	17,900	5,030.00	90,037,000	
8037	カメイ	39,800	1,909.00	75,978,200	
8038	東都水産	800	7,020.00	5,616,000	貸付有価証券 400株
8041	OUGホールディングス	2,300	2,457.00	5,651,100	
8043	スターゼン	25,900	2,690.00	69,671,000	
8051	山善	113,600	1,251.00	142,113,600	
8052	椿本興業	7,700	6,780.00	52,206,000	貸付有価証券 200株
8053	住友商事	2,268,100	3,297.00	7,477,925,700	貸付有価証券 6,100株
8057	内田洋行	15,200	7,610.00	115,672,000	
8058	三菱商事	7,426,000	2,477.50	18,397,915,000	
8059	第一実業	35,200	1,869.00	65,788,800	
8060	キャノンマーケティングジャパン	86,800	4,362.00	378,621,600	
8061	西華産業	14,700	3,065.00	45,055,500	
8065	佐藤商事	26,000	1,558.00	40,508,000	貸付有価証券 3,600株
8068	菱洋エレクトロ	35,500	3,900.00	138,450,000	貸付有価証券 1,300株
8070	東京産業	34,200	743.00	25,410,600	貸付有価証券 1,400株
8074	ユアサ商事	29,300	4,855.00	142,251,500	
8075	神鋼商事	9,400	5,950.00	55,930,000	
8077	トルク	8,500	296.00	2,516,000	貸付有価証券 500株
8078	阪和興業	67,300	5,320.00	358,036,000	貸付有価証券 6,300株
8079	正栄食品工業	24,900	4,520.00	112,548,000	
8081	カナデン	28,100	1,538.00	43,217,800	
8084	RYODEN	30,200	2,703.00	81,630,600	
8088	岩谷産業	85,300	6,525.00	556,582,500	貸付有価証券 2,400株
8089	ナイス	5,000	1,562.00	7,810,000	
8091	ニチモウ	4,000	2,127.00	8,508,000	
8093	極東貿易	22,400	2,130.00	47,712,000	貸付有価証券 900株
8095	アステナホールディングス	70,400	481.00	33,862,400	貸付有価証券 2,800株
8097	三愛オブリ	90,100	1,667.00	150,196,700	貸付有価証券 5,800株
8098	稲畑産業	74,100	3,140.00	232,674,000	

8101	G S I クレオス	20,100	2,326.00	46,752,600	
8103	明和産業	44,300	666.00	29,503,800	
8104	クワザワホールディングス	5,700	686.00	3,910,200	貸付有価証券 1,600株
8125	ワキタ	62,000	1,535.00	95,170,000	
8129	東邦ホールディングス	103,700	3,192.00	331,010,400	
8130	サンゲツ	86,300	3,210.00	277,023,000	貸付有価証券 3,700株
8131	ミツウロコグループホールディングス	47,800	1,508.00	72,082,400	
8132	シナネンホールディングス	10,400	4,045.00	42,068,000	貸付有価証券 500株
8133	伊藤忠エネクス	92,900	1,579.00	146,689,100	
8136	サンリオ	106,200	6,102.00	648,032,400	貸付有価証券 12,300株
8137	サンワテクノス	19,100	2,293.00	43,796,300	
8140	リョーサン	26,500	5,050.00	133,825,000	貸付有価証券 1,300株
8141	新光商事	50,300	1,228.00	61,768,400	
8142	トーヨー	14,600	2,842.00	41,493,200	
8150	三信電気	15,100	2,425.00	36,617,500	
8151	東陽テクニカ	38,000	1,450.00	55,100,000	
8153	モスフードサービス	55,100	3,370.00	185,687,000	
8154	加賀電子	34,200	6,760.00	231,192,000	貸付有価証券 4,400株
8158	ソーダニッカ	27,700	1,232.00	34,126,400	
8159	立花エレテック	24,900	3,105.00	77,314,500	
8275	フォーバル	14,700	1,418.00	20,844,600	
8283	P A L T A C	50,500	4,556.00	230,078,000	
8285	三谷産業	65,500	363.00	23,776,500	
8835	太平洋興発	6,000	818.00	4,908,000	貸付有価証券 1,700株
9260	西本W i s m e t t a cホールディングス	9,500	6,080.00	57,760,000	貸付有価証券 800株
9265	ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	2,331.00	2,797,200	貸付有価証券 300株
9273	コア商事ホールディングス	21,000	757.00	15,897,000	
9274	K P Pグループホールディングス	97,000	725.00	70,325,000	貸付有価証券 10,300株
9305	ヤマタネ	16,500	2,543.00	41,959,500	
9763	丸紅建材リース	1,100	2,788.00	3,066,800	
9824	泉州電業	18,800	3,540.00	66,552,000	

9830	トラスコ中山	78,700	2,473.00	194,625,100	
9832	オートバックスセブン	130,400	1,573.00	205,119,200	
9837	モリト	26,800	1,425.00	38,190,000	
9869	加藤産業	46,400	4,685.00	217,384,000	
9872	北恵	3,700	863.00	3,193,100	貸付有価証券 800株
9882	イエローハット	59,500	1,804.00	107,338,000	
9896	J Kホールディングス	28,800	1,061.00	30,556,800	
9902	日伝	25,300	2,755.00	69,701,500	貸付有価証券 900株
9930	北沢産業	8,900	308.00	2,741,200	貸付有価証券 3,300株
9932	杉本商事	18,100	2,229.00	40,344,900	
9934	因幡電機産業	97,200	3,535.00	343,602,000	貸付有価証券 3,800株
9960	東テク	12,500	5,210.00	65,125,000	
9962	ミスミグループ本社	565,800	2,448.00	1,385,078,400	貸付有価証券 68,800株
9972	アルテック	8,400	249.00	2,091,600	貸付有価証券 3,000株
9982	タキヒヨー	3,700	1,112.00	4,114,400	貸付有価証券 1,300株
9986	蔵王産業	2,700	2,495.00	6,736,500	
9987	スズケン	142,600	4,592.00	654,819,200	
9991	ジェコス	22,400	1,092.00	24,460,800	
9995	グローセル	38,300	671.00	25,699,300	
2651	ローソン	79,700	8,285.00	660,314,500	
2659	サンエー	28,600	4,550.00	130,130,000	貸付有価証券 1,200株
2664	カワチ薬品	29,300	2,686.00	78,699,800	貸付有価証券 3,400株
2670	エービーシー・マート	164,000	2,614.50	428,778,000	
2674	ハードオフコーポレーション	11,600	1,842.00	21,367,200	
2678	アスクル	77,500	2,094.00	162,285,000	貸付有価証券 2,900株
2681	ゲオホールディングス	42,000	2,297.00	96,474,000	
2685	アダストリア	45,200	3,285.00	148,482,000	
2686	ジーフット	10,100	297.00	2,999,700	貸付有価証券 3,900株
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	740.00	1,480,000	貸付有価証券 600株
2695	くら寿司	43,900	3,785.00	166,161,500	貸付有価証券 2,000株

2698	キャンドウ	13,300	2,693.00	35,816,900	
2722	I Kホールディングス	5,100	368.00	1,876,800	貸付有価証券 1,300株
2726	パルグループホールディングス	73,600	2,295.00	168,912,000	
2730	エディオン	148,400	1,590.00	235,956,000	貸付有価証券 18,400株
2734	サーラコーポレーション	78,700	807.00	63,510,900	
2735	ワッツ	7,700	596.00	4,589,200	
2742	ハローズ	17,000	4,440.00	75,480,000	貸付有価証券 1,600株
2752	フジオフードグループ本社	42,000	1,442.00	60,564,000	
2753	あみやき亭	9,100	4,110.00	37,401,000	
2764	ひらまつ	35,800	253.00	9,057,400	貸付有価証券 8,600株
2791	大黒天物産	11,500	8,270.00	95,105,000	貸付有価証券 500株
2792	ハニーズホールディングス	29,600	1,627.00	48,159,200	
2796	ファーマライズホールディングス	3,500	681.00	2,383,500	貸付有価証券 100株
3028	アルペン	30,900	2,031.00	62,757,900	貸付有価証券 2,400株
3030	ハブ	5,100	743.00	3,789,300	貸付有価証券 1,300株
3034	クオールホールディングス	51,500	1,782.00	91,773,000	
3046	ジンズホールディングス	22,200	4,195.00	93,129,000	
3048	ビックカメラ	199,400	1,345.00	268,193,000	貸付有価証券 51,100株
3050	DCMホールディングス	198,000	1,350.00	267,300,000	
3053	ペッパーフードサービス	87,000	97.00	8,439,000	貸付有価証券 7,000株
3064	Monotaro	531,300	1,439.50	764,806,350	貸付有価証券 73,600株
3067	東京一番フーズ	3,600	518.00	1,864,800	
3073	DDグループ	8,900	1,519.00	13,519,100	貸付有価証券 1,700株
3082	きちりホールディングス	3,700	1,030.00	3,811,000	貸付有価証券 1,100株
3086	J. フロント リテイリング	430,100	1,338.00	575,473,800	貸付有価証券 52,300株
3087	ドトール・日レスホールディングス	66,500	2,160.00	143,640,000	貸付有価証券 7,000株
3088	マツキヨココカラ&カンパニー	681,700	2,663.00	1,815,367,100	貸付有価証券 77,400株
3091	ブロンコビリー	22,000	3,370.00	74,140,000	
3092	ZOZO	238,800	3,258.00	778,010,400	貸付有価証券

					9,600株
3093	トレジャー・ファクトリー	18,100	1,286.00	23,276,600	貸付有価証券 2,600株
3097	物語コーポレーション	62,600	5,100.00	319,260,000	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	631,100	1,675.00	1,057,092,500	
3134	H a m e e	12,900	1,129.00	14,564,100	
3135	マーケットエンタープライズ	1,600	992.00	1,587,200	貸付有価証券 100株
3141	ウエルシアホールディングス	194,400	2,403.00	467,143,200	貸付有価証券 25,800株
3148	クリエイトSDホールディングス	62,000	3,175.00	196,850,000	貸付有価証券 500株
3159	丸善CHIホールディングス	18,700	328.00	6,133,600	貸付有価証券 5,500株
3169	ミサワ	3,300	715.00	2,359,500	
3172	ティーライフ	2,100	1,429.00	3,000,900	
3175	エー・ピーホールディングス	3,300	961.00	3,171,300	貸付有価証券 1,100株
3178	チムニー	4,900	1,441.00	7,060,900	貸付有価証券 1,300株
3179	シュッピン	33,800	1,046.00	35,354,800	
3182	オイシックス・ラ・大地	50,400	1,383.00	69,703,200	貸付有価証券 4,400株
3186	ネクステージ	85,600	2,266.00	193,969,600	貸付有価証券 9,900株
3191	ジョイフル本田	109,000	1,927.00	210,043,000	貸付有価証券 4,200株
3193	鳥貴族ホールディングス	13,900	3,755.00	52,194,500	貸付有価証券 1,800株
3196	ホットランド	28,700	1,933.00	55,477,100	
3197	すかいらくホールディングス	512,300	2,363.00	1,210,564,900	貸付有価証券 19,700株
3198	SFPホールディングス	20,500	2,104.00	43,132,000	貸付有価証券 1,900株
3199	綿半ホールディングス	29,000	1,442.00	41,818,000	
3221	ヨシックスホールディングス	6,700	2,974.00	19,925,800	
3222	ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	104,700	1,013.00	106,061,100	貸付有価証券 12,700株
3319	ゴルフダイジェスト・オンライン	16,900	621.00	10,494,900	
3328	B E E N O S	15,400	1,512.00	23,284,800	
3333	あさひ	34,800	1,292.00	44,961,600	貸付有価証券 3,200株
3341	日本調剤	25,500	1,408.00	35,904,000	
3349	コスモス薬品	37,100	15,665.00	581,171,500	貸付有価証券 3,800株

3361	トーエル	7,000	789.00	5,523,000	貸付有価証券 300株
3382	セブン&アイ・ホールディングス	1,291,600	5,803.00	7,495,154,800	
3387	クリエイト・レストランツ・ホールディング	253,700	1,098.00	278,562,600	貸付有価証券 23,400株
3391	ツルハホールディングス	78,700	12,465.00	980,995,500	
3395	サンマルクホールディングス	30,200	2,224.00	67,164,800	
3396	フェリシモ	3,500	922.00	3,227,000	
3397	トリドールホールディングス	105,000	4,355.00	457,275,000	
3415	TOKYO BASE	45,000	326.00	14,670,000	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	貸付有価証券 100株
3539	JMホールディングス	28,300	2,250.00	63,675,000	
3544	サツドラホールディングス	7,200	767.00	5,522,400	
3546	アレンザホールディングス	28,000	1,083.00	30,324,000	
3547	串カツ田中ホールディングス	10,000	1,860.00	18,600,000	貸付有価証券 1,200株
3548	バロックジャパンリミテッド	29,100	819.00	23,832,900	貸付有価証券 800株
3549	クスリのアオキホールディングス	100,200	3,250.00	325,650,000	貸付有価証券 3,900株
3561	力の源ホールディングス	16,800	1,396.00	23,452,800	貸付有価証券 1,900株
3563	FOOD & LIFE COMPANIE	199,900	2,927.00	585,107,300	
4350	メディカルシステムネットワーク	40,600	604.00	24,522,400	
7127	一家ホールディングス	3,500	699.00	2,446,500	貸付有価証券 1,300株
7135	ジャパクラフトホールディングス	9,200	166.00	1,527,200	貸付有価証券 1,700株
7416	はるやまホールディングス	7,600	590.00	4,484,000	
7419	ノジマ	108,700	1,856.00	201,747,200	
7421	カップ・クリエイト	58,900	1,722.00	101,425,800	貸付有価証券 1,400株
7445	ライトオン	12,000	415.00	4,980,000	貸付有価証券 5,800株
7453	良品計画	409,100	2,282.00	933,566,200	
7455	パリミキホールディングス	19,900	520.00	10,348,000	貸付有価証券 4,700株
7463	アドヴァングループ	35,600	1,055.00	37,558,000	
7475	アルビス	12,300	2,647.00	32,558,100	貸付有価証券 700株
7494	コナカ	17,300	412.00	7,127,600	貸付有価証券 5,100株

7506	ハウス オブ ローゼ	2,000	1,610.00	3,220,000	
7508	G-7ホールディングス	40,900	1,252.00	51,206,800	
7512	イオン北海道	110,800	946.00	104,816,800	貸付有価証券 5,200株
7513	コジマ	61,900	745.00	46,115,500	
7514	ヒマラヤ	5,100	936.00	4,773,600	貸付有価証券 100株
7516	コーナン商事	45,900	3,880.00	178,092,000	貸付有価証券 1,600株
7520	エコス	13,900	2,434.00	33,832,600	
7522	ワタミ	39,600	1,032.00	40,867,200	
7524	マルシェ	5,500	246.00	1,353,000	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	756,800	3,171.00	2,399,812,800	
7545	西松屋チェーン	73,700	2,089.00	153,959,300	
7550	ゼンショーホールディングス	190,800	7,127.00	1,359,831,600	貸付有価証券 5,700株
7554	幸楽苑ホールディングス	27,700	1,218.00	33,738,600	貸付有価証券 2,700株
7561	ハークスレイ	5,600	915.00	5,124,000	
7581	サイゼリヤ	55,400	5,040.00	279,216,000	
7593	V Tホールディングス	142,300	526.00	74,849,800	
7596	魚力	13,100	2,316.00	30,339,600	
7601	ポプラ	3,600	207.00	745,200	貸付有価証券 1,100株
7605	フジ・コーポレーション	17,800	1,720.00	30,616,000	
7606	ユナイテッドアローズ	44,000	1,899.00	83,556,000	
7611	ハイデイ日高	55,600	2,885.00	160,406,000	貸付有価証券 10,500株
7615	YU-WA Creation Holdi	8,900	145.00	1,290,500	貸付有価証券 3,100株
7616	コロワイド	161,200	2,286.50	368,583,800	貸付有価証券 19,700株
7630	壱番屋	29,600	6,120.00	181,152,000	貸付有価証券 3,300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	P L A N T	3,600	1,705.00	6,138,000	貸付有価証券 1,100株
7649	スギホールディングス	75,500	6,929.00	523,139,500	
7679	薬王堂ホールディングス	18,300	2,614.00	47,836,200	
7918	ヴィア・ホールディングス	22,200	154.00	3,418,800	貸付有価証券 6,400株

8005	スクロール	55,800	1,012.00	56,469,600	
8008	ヨンドシーホールディングス	35,500	1,999.00	70,964,500	貸付有価証券 4,400株
8160	木曽路	56,700	2,617.00	148,383,900	
8163	S R Sホールディングス	61,800	1,181.00	72,985,800	
8165	千趣会	69,000	317.00	21,873,000	貸付有価証券 7,800株
8166	タカキュー	11,200	69.00	772,800	貸付有価証券 3,300株
8167	リテールパートナーズ	55,600	1,756.00	97,633,600	貸付有価証券 8,000株
8173	上新電機	37,100	2,433.00	90,264,300	
8174	日本瓦斯	198,600	2,340.50	464,823,300	
8179	ロイヤルホールディングス	66,000	2,579.00	170,214,000	
8181	東天紅	1,200	895.00	1,074,000	
8182	いなげや	36,400	1,275.00	46,410,000	
8185	チヨダ	35,800	892.00	31,933,600	
8194	ライフコーポレーション	39,300	3,720.00	146,196,000	
8200	リンガーハット	48,300	2,415.00	116,644,500	
8203	M r M a x HD	47,200	618.00	29,169,600	
8207	テンアライド	17,000	310.00	5,270,000	貸付有価証券 8,300株
8214	A O K Iホールディングス	80,300	1,160.00	93,148,000	貸付有価証券 6,100株
8217	オークワ	53,900	881.00	47,485,900	
8218	コメリ	57,700	3,305.00	190,698,500	貸付有価証券 2,300株
8219	青山商事	80,100	1,761.00	141,056,100	貸付有価証券 3,100株
8227	しまむら	44,000	16,325.00	718,300,000	
8230	はせがわ	7,500	368.00	2,760,000	
8233	高島屋	259,000	2,008.00	520,072,000	貸付有価証券 10,900株
8237	松屋	63,500	928.00	58,928,000	貸付有価証券 9,100株
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	165,800	1,578.00	261,632,400	貸付有価証券 27,800株
8244	近鉄百貨店	16,100	2,517.00	40,523,700	貸付有価証券 1,700株
8252	丸井グループ	248,800	2,449.50	609,435,600	貸付有価証券 10,700株
8255	アクシアル リテイリング	25,600	4,090.00	104,704,000	
8260	井筒屋	7,500	355.00	2,662,500	貸付有価証券

					2,300株
8267	イオン	1,270,400	3,463.00	4,399,395,200	貸付有価証券 49,000株
8273	イズミ	66,400	3,426.00	227,486,400	貸付有価証券 2,200株
8276	平和堂	62,600	2,173.00	136,029,800	貸付有価証券 8,900株
8278	フジ	57,500	1,955.00	112,412,500	貸付有価証券 7,500株
8279	ヤオコー	42,400	8,404.00	356,329,600	貸付有価証券 2,600株
8281	ゼビオホールディングス	50,800	965.00	49,022,000	
8282	ケーズホールディングス	264,700	1,319.00	349,139,300	貸付有価証券 51,600株
8289	O l y m p i cグループ	6,900	552.00	3,808,800	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	460.00	10,856,000	貸付有価証券 6,400株
9262	シルバーライフ	7,200	878.00	6,321,600	貸付有価証券 400株
9267	G e n k y D r u g S t o r e s	16,400	6,250.00	102,500,000	貸付有価証券 700株
9275	ナルミヤ・インターナショナル	2,600	1,221.00	3,174,600	
9278	ブックオフグループホールディングス	19,100	1,291.00	24,658,100	
9279	ギフトホールディングス	15,900	2,727.00	43,359,300	
9627	アインホールディングス	51,600	4,669.00	240,920,400	
9828	元気寿司	21,200	3,550.00	75,260,000	
9831	ヤマダホールディングス	1,152,600	448.10	516,480,060	
9842	アークランズ	111,500	1,686.00	187,989,000	貸付有価証券 12,900株
9843	ニトリホールディングス	136,400	18,995.00	2,590,918,000	貸付有価証券 5,800株
9850	グルメ杵屋	30,300	1,073.00	32,511,900	
9854	愛眼	11,700	185.00	2,164,500	貸付有価証券 1,100株
9856	ケーユーホールディングス	17,500	1,164.00	20,370,000	
9861	吉野家ホールディングス	138,000	3,210.00	442,980,000	貸付有価証券 8,500株
9887	松屋フーズホールディングス	17,700	5,770.00	102,129,000	貸付有価証券 700株
9900	サガミホールディングス	56,200	1,515.00	85,143,000	
9919	関西フードマーケット	25,400	1,448.00	36,779,200	
9936	王将フードサービス	27,800	8,000.00	222,400,000	
9946	ミニストップ	27,200	1,524.00	41,452,800	

9948	アークス	68,700	2,897.00	199,023,900	貸付有価証券 11,600株
9956	パローホールディングス	71,500	2,470.00	176,605,000	貸付有価証券 9,600株
9974	ベルク	18,700	6,320.00	118,184,000	
9979	大庄	15,700	1,329.00	20,865,300	
9983	ファーストリテイリング	168,600	38,870.00	6,553,482,000	貸付有価証券 23,900株
9989	サンドラッグ	126,500	4,541.00	574,436,500	
9990	サックスパーホールディングス	31,600	840.00	26,544,000	
9993	ヤマザワ	3,400	1,268.00	4,311,200	貸付有価証券 900株
9994	やまや	3,300	3,080.00	10,164,000	
9997	ベルーナ	90,200	625.00	56,375,000	
5830	いよぎんホールディングス	415,100	989.40	410,699,940	
5831	しずおかフィナンシャルグループ	775,100	1,321.00	1,023,907,100	貸付有価証券 108,100株
5832	ちゅうぎんフィナンシャルグループ	293,700	1,028.50	302,070,450	
5838	楽天銀行	121,300	2,297.00	278,626,100	
5844	京都フィナンシャルグループ	442,000	2,369.00	1,047,098,000	
7150	島根銀行	4,300	530.00	2,279,000	
7161	じもとホールディングス	11,200	551.00	6,171,200	貸付有価証券 2,900株
7167	めぶきフィナンシャルグループ	1,731,100	438.70	759,433,570	
7173	東京きらぼしフィナンシャルグループ	44,700	4,200.00	187,740,000	
7180	九州フィナンシャルグループ	675,200	881.80	595,391,360	貸付有価証券 111,200株
7182	ゆうちょ銀行	3,833,500	1,531.00	5,869,088,500	貸付有価証券 160,700株
7184	富山第一銀行	110,700	809.00	89,556,300	
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,871,800	691.70	1,294,724,060	貸付有価証券 72,200株
7189	西日本フィナンシャルホールディングス	196,800	1,671.00	328,852,800	
7322	三十三フィナンシャルグループ	31,200	1,900.00	59,280,000	
7327	第四北越フィナンシャルグループ	54,800	4,020.00	220,296,000	
7337	ひろぎんホールディングス	496,500	979.10	486,123,150	
7350	おきなわフィナンシャルグループ	29,700	2,479.00	73,626,300	
7380	十六フィナンシャルグループ	45,200	3,955.00	178,766,000	
7381	北國フィナンシャルホールディングス	36,700	4,355.00	159,828,500	
7384	プロクレアホールディングス	39,900	1,890.00	75,411,000	貸付有価証券 4,600株

7389	あいちフィナンシャルグループ	53,700	2,555.00	137,203,500	貸付有価証券 4,100株
8304	あおぞら銀行	250,700	3,207.00	803,994,900	貸付有価証券 9,700株
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	21,245,200	1,341.00	28,489,813,200	
8308	りそなホールディングス	4,067,800	798.00	3,246,104,400	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	1,253,700	2,936.50	3,681,490,050	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	2,480,400	7,440.00	18,454,176,000	
8331	千葉銀行	972,200	1,069.00	1,039,281,800	貸付有価証券 37,500株
8334	群馬銀行	677,000	718.50	486,424,500	
8336	武蔵野銀行	48,700	2,760.00	134,412,000	貸付有価証券 1,400株
8337	千葉興業銀行	57,700	856.00	49,391,200	
8338	筑波銀行	153,100	255.00	39,040,500	貸付有価証券 8,100株
8341	七十七銀行	101,500	3,560.00	361,340,000	
8343	秋田銀行	23,400	2,000.00	46,800,000	
8344	山形銀行	38,700	1,110.00	42,957,000	貸付有価証券 1,000株
8345	岩手銀行	22,100	2,570.00	56,797,000	
8346	東邦銀行	275,900	306.00	84,425,400	貸付有価証券 49,800株
8349	東北銀行	7,200	1,180.00	8,496,000	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	303,800	3,497.00	1,062,388,600	
8358	スルガ銀行	307,500	847.00	260,452,500	貸付有価証券 74,700株
8359	八十二銀行	748,600	802.30	600,601,780	
8360	山梨中央銀行	39,100	1,735.00	67,838,500	
8361	大垣共立銀行	66,500	1,951.00	129,741,500	
8362	福井銀行	31,200	1,706.00	53,227,200	
8364	清水銀行	13,900	1,600.00	22,240,000	
8365	富山銀行	2,500	1,735.00	4,337,500	貸付有価証券 800株
8366	滋賀銀行	58,000	3,470.00	201,260,000	
8367	南都銀行	52,500	2,629.00	138,022,500	
8368	百五銀行	328,200	571.00	187,402,200	
8370	紀陽銀行	124,800	1,667.00	208,041,600	貸付有価証券 14,900株
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	215,900	1,555.00	335,724,500	貸付有価証券 500株
8381	山陰合同銀行	218,300	1,039.00	226,813,700	

8383	鳥取銀行	5,200	1,446.00	7,519,200	
8386	百十四銀行	34,300	2,450.00	84,035,000	貸付有価証券 4,600株
8387	四国銀行	51,100	1,012.00	51,713,200	
8388	阿波銀行	48,900	2,451.00	119,853,900	
8392	大分銀行	21,000	2,660.00	55,860,000	
8393	宮崎銀行	21,000	2,722.00	57,162,000	
8395	佐賀銀行	20,400	1,945.00	39,678,000	
8399	琉球銀行	74,200	1,142.00	84,736,400	貸付有価証券 10,100株
8410	セブン銀行	1,093,500	304.70	333,189,450	貸付有価証券 48,200株
8411	みずほフィナンシャルグループ	4,708,900	2,610.00	12,290,229,000	
8416	高知銀行	5,100	973.00	4,962,300	
8418	山口フィナンシャルグループ	342,100	1,370.00	468,677,000	
8522	名古屋銀行	22,600	5,360.00	121,136,000	貸付有価証券 3,500株
8524	北洋銀行	528,600	376.00	198,753,600	
8537	大光銀行	4,800	1,498.00	7,190,400	
8541	愛媛銀行	47,000	1,060.00	49,820,000	
8542	トマト銀行	5,200	1,218.00	6,333,600	
8544	京葉銀行	146,400	718.00	105,115,200	
8550	栃木銀行	174,200	312.00	54,350,400	
8551	北日本銀行	11,400	2,246.00	25,604,400	
8558	東和銀行	64,000	632.00	40,448,000	
8562	福島銀行	15,500	239.00	3,704,500	貸付有価証券 4,100株
8563	大東銀行	6,500	760.00	4,940,000	貸付有価証券 2,200株
8600	トモニホールディングス	330,100	401.00	132,370,100	貸付有価証券 33,800株
8713	フィデアホールディングス	36,000	1,608.00	57,888,000	
8714	池田泉州ホールディングス	483,900	334.00	161,622,600	
7148	F P G	118,000	1,672.00	197,296,000	
7172	ジャパンインベストメントアドバイザー	56,800	881.00	50,040,800	貸付有価証券 1,100株
7347	マーキュリアホールディングス	7,500	722.00	5,415,000	
8473	S B Iホールディングス	510,900	3,568.00	1,822,891,200	貸付有価証券 19,400株
8518	日本アジア投資	10,800	279.00	3,013,200	貸付有価証券 3,700株

8595	ジャフコ グループ	104,000	1,712.00	178,048,000	
8601	大和証券グループ本社	2,702,400	1,037.00	2,802,388,800	
8604	野村ホールディングス	5,866,600	743.20	4,360,057,120	
8609	岡三証券グループ	306,300	737.00	225,743,100	貸付有価証券 9,100株
8613	丸三証券	116,100	879.00	102,051,900	貸付有価証券 17,500株
8614	東洋証券	92,600	319.00	29,539,400	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	414,200	546.00	226,153,200	
8617	光世証券	3,400	583.00	1,982,200	貸付有価証券 1,300株
8622	水戸証券	103,000	464.00	47,792,000	
8624	いちよし証券	65,300	771.00	50,346,300	
8628	松井証券	171,700	821.00	140,965,700	
8698	マネックスグループ	341,700	748.00	255,591,600	
8706	極東証券	47,800	1,024.00	48,947,200	貸付有価証券 5,100株
8707	岩井コスモホールディングス	39,800	2,098.00	83,500,400	
8708	アイザワ証券グループ	50,400	1,201.00	60,530,400	
8732	マネーパートナーズグループ	15,500	310.00	4,805,000	貸付有価証券 4,600株
8739	スパークス・グループ	38,900	1,781.00	69,280,900	
8742	小林洋行	5,900	249.00	1,469,100	貸付有価証券 100株
7181	かんぽ生命保険	355,300	2,668.50	948,118,050	
7388	F P パートナー	6,900	5,920.00	40,848,000	
8630	SOMPOホールディングス	524,800	7,491.00	3,931,276,800	
8715	アニコム ホールディングス	118,500	582.00	68,967,000	貸付有価証券 14,400株
8725	MS & ADインシュアランスグループ ホール	781,100	5,953.00	4,649,888,300	貸付有価証券 114,100株
8750	第一生命ホールディングス	1,704,600	3,148.00	5,366,080,800	貸付有価証券 8,400株
8766	東京海上ホールディングス	3,448,300	3,733.00	12,872,503,900	貸付有価証券 61,100株
8795	T & Dホールディングス	936,800	2,356.50	2,207,569,200	貸付有価証券 90,600株
8798	アドバンスクリエイト	20,200	1,043.00	21,068,600	
7164	全国保証	91,200	5,450.00	497,040,000	貸付有価証券 3,600株
7183	あんしん保証	6,400	242.00	1,548,800	貸付有価証券 1,600株

7187	ジェイリース	9,100	2,356.00	21,439,600	
7191	イントラスト	5,700	844.00	4,810,800	貸付有価証券 1,500株
7192	日本モーゲージサービス	8,300	523.00	4,340,900	貸付有価証券 1,800株
7196	C a s a	5,800	911.00	5,283,800	貸付有価証券 600株
7198	S B I アルヒ	33,500	857.00	28,709,500	
7199	プレミアグループ	58,800	1,789.00	105,193,200	貸付有価証券 7,000株
7383	ネットプロテクションズホールディングス	115,500	183.00	21,136,500	
8253	クレディセゾン	221,100	2,760.00	610,236,000	貸付有価証券 39,200株
8424	芙蓉総合リース	32,100	12,985.00	416,818,500	
8425	みずほリース	58,400	5,280.00	308,352,000	
8439	東京センチュリー	260,700	1,609.00	419,466,300	貸付有価証券 19,000株
8511	日本証券金融	128,200	1,557.00	199,607,400	貸付有価証券 3,500株
8515	アイフル	513,500	373.00	191,535,500	貸付有価証券 66,600株
8566	リコーリース	33,100	5,050.00	167,155,000	
8570	イオンフィナンシャルサービス	200,300	1,316.00	263,594,800	
8572	アコム	622,300	369.90	230,188,770	
8584	ジャックス	37,200	5,720.00	212,784,000	
8585	オリエントコーポレーション	113,800	1,114.00	126,773,200	貸付有価証券 15,300株
8591	オリックス	2,126,400	2,820.00	5,996,448,000	
8593	三菱HCキャピタル	1,554,500	1,017.50	1,581,703,750	
8596	九州リースサービス	6,000	1,150.00	6,900,000	
8697	日本取引所グループ	910,200	3,164.00	2,879,872,800	貸付有価証券 28,000株
8771	イー・ギャランティ	56,700	2,012.00	114,080,400	貸付有価証券 2,100株
8772	アサックス	6,800	737.00	5,011,600	貸付有価証券 2,200株
8793	NECキャピタルソリューション	17,100	3,650.00	62,415,000	
1435	R o b o t H o m e	96,600	172.00	16,615,200	貸付有価証券 12,200株
1878	大東建託	127,800	16,150.00	2,063,970,000	
2337	いちご	401,700	376.00	151,039,200	
2353	日本駐車場開発	369,200	189.00	69,778,800	貸付有価証券 47,900株

2975	スター・マイカ・ホールディングス	40,500	600.00	24,300,000	
2980	S R Eホールディングス	15,000	2,746.00	41,190,000	貸付有価証券 1,300株
2982	A Dワークスグループ	37,400	230.00	8,602,000	貸付有価証券 8,000株
3003	ヒューリック	813,700	1,544.50	1,256,759,650	貸付有価証券 31,400株
3231	野村不動産ホールディングス	194,100	3,933.00	763,395,300	貸付有価証券 35,100株
3232	三重交通グループホールディングス	74,600	624.00	46,550,400	
3244	サムティ	55,500	2,497.00	138,583,500	
3245	ディア・ライフ	59,500	1,003.00	59,678,500	
3246	コーセーアールイー	4,700	1,126.00	5,292,200	貸付有価証券 2,000株
3252	地主	26,600	2,291.00	60,940,600	
3254	プレサンスコーポレーション	55,300	1,644.00	90,913,200	貸付有価証券 3,000株
3271	T H Eグローバル社	8,600	397.00	3,414,200	貸付有価証券 2,400株
3275	ハウスコム	2,400	915.00	2,196,000	
3276	J P M C	20,200	1,160.00	23,432,000	
3277	サンセイランディック	4,400	1,039.00	4,571,600	
3280	エストラスト	1,500	642.00	963,000	
3284	フージャースホールディングス	53,800	1,137.00	61,170,600	
3288	オープンハウスグループ	127,800	4,490.00	573,822,000	貸付有価証券 12,600株
3289	東急不動産ホールディングス	1,048,800	981.30	1,029,187,440	貸付有価証券 40,500株
3291	飯田グループホールディングス	334,300	2,242.00	749,500,600	貸付有価証券 40,100株
3294	イーグラント	2,200	1,563.00	3,438,600	
3299	ムゲンエステート	9,900	1,103.00	10,919,700	貸付有価証券 3,000株
3452	ビーロット	10,100	1,017.00	10,271,700	
3454	ファーストブラザーズ	2,900	1,264.00	3,665,600	
3457	A n d D oホールディングス	21,100	1,103.00	23,273,300	
3458	シーアールイー	19,400	1,435.00	27,839,000	
3465	ケイアイスター不動産	16,800	3,490.00	58,632,000	貸付有価証券 600株
3467	アグレ都市デザイン	2,700	1,626.00	4,390,200	
3475	グッドコムアセット	32,400	750.00	24,300,000	貸付有価証券 4,000株
3480	ジェイ・エス・ビー	17,300	2,610.00	45,153,000	貸付有価証券

					1,900株
3482	ロードスターキャピタル	22,700	1,967.00	44,650,900	
3484	テンポイノベーション	4,400	1,015.00	4,466,000	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	2,491.00	6,725,700	
3489	フェイスネットワーク	4,000	1,593.00	6,372,000	貸付有価証券 800株
3498	霞ヶ関キャピタル	9,500	11,650.00	110,675,000	
4666	パーク24	226,600	1,865.50	422,722,300	貸付有価証券 32,200株
4809	バラカ	12,300	1,911.00	23,505,300	
5535	ミガロホールディングス	2,900	1,420.00	4,118,000	
6620	宮越ホールディングス	15,900	1,143.00	18,173,700	貸付有価証券 1,600株
8801	三井不動産	1,613,300	3,642.00	5,875,638,600	
8802	三菱地所	2,280,400	2,026.50	4,621,230,600	貸付有価証券 295,800株
8803	平和不動産	56,600	3,905.00	221,023,000	
8804	東京建物	304,800	2,212.50	674,370,000	
8818	京阪神ビルディング	65,200	1,450.00	94,540,000	貸付有価証券 2,300株
8830	住友不動産	504,500	4,548.00	2,294,466,000	貸付有価証券 24,300株
8841	テーオーシー	62,200	688.00	42,793,600	
8842	東京楽天地	5,700	6,700.00	38,190,000	
8848	レオパレス21	349,000	405.00	141,345,000	
8850	スターツコーポレーション	50,100	3,010.00	150,801,000	
8860	フジ住宅	43,900	709.00	31,125,100	
8864	空港施設	49,100	622.00	30,540,200	
8869	明和地所	17,400	1,333.00	23,194,200	
8871	ゴールドクレスト	28,400	2,375.00	67,450,000	
8877	エスリード	16,400	3,510.00	57,564,000	貸付有価証券 1,100株
8881	日神グループホールディングス	56,000	521.00	29,176,000	
8892	日本エスコン	65,300	965.00	63,014,500	貸付有価証券 7,900株
8897	MIRARTHホールディングス	160,300	493.00	79,027,900	
8904	AVANTIA	7,900	896.00	7,078,400	
8905	イオンモール	180,900	1,791.00	323,991,900	貸付有価証券 21,900株
8908	毎日コムネット	5,400	777.00	4,195,800	貸付有価証券 1,000株

8917	ファースト住建	5,900	1,109.00	6,543,100	貸付有価証券 800株
8918	ランド	1,908,700	7.00	13,360,900	
8919	カチタス	93,800	1,919.00	180,002,200	
8923	トーセイ	58,000	2,145.00	124,410,000	
8928	穴吹興産	2,800	2,115.00	5,922,000	
8934	サンフロンティア不動産	51,700	1,754.00	90,681,800	
8935	F Jネクストホールディングス	36,700	1,202.00	44,113,400	
8940	インテリックス	3,500	575.00	2,012,500	貸付有価証券 1,300株
8944	ランドビジネス	5,400	271.00	1,463,400	
8945	サンネクスタグループ	4,300	958.00	4,119,400	
8999	グランディハウス	22,900	657.00	15,045,300	
9706	日本空港ビルデング	123,400	5,804.00	716,213,600	
1717	明豊ファシリティワークス	7,500	877.00	6,577,500	
2120	L I F U L L	124,500	201.00	25,024,500	
2121	M I X I	78,100	2,543.00	198,608,300	
2124	ジェイエイシーリクルートメント	131,600	674.00	88,698,400	
2127	日本M&Aセンターホールディングス	580,200	755.20	438,167,040	貸付有価証券 64,000株
2130	メンバーズ	12,400	998.00	12,375,200	
2139	中広	2,500	417.00	1,042,500	
2146	U Tグループ	46,900	2,381.00	111,668,900	
2148	アイティメディア	13,800	1,058.00	14,600,400	
2150	ケアネット	55,900	821.00	45,893,900	
2153	E・Jホールディングス	21,300	1,725.00	36,742,500	
2154	オープンアップグループ	109,200	2,233.00	243,843,600	貸付有価証券 200株
2157	コシダカホールディングス	109,000	1,001.00	109,109,000	
2163	アルトナー	3,900	2,270.00	8,853,000	
2168	パソナグループ	44,200	2,739.00	121,063,800	
2169	C D S	3,800	1,700.00	6,460,000	貸付有価証券 1,100株
2170	リンクアンドモチベーション	104,800	566.00	59,316,800	貸付有価証券 5,000株
2175	エス・エム・エス	127,600	2,657.00	339,033,200	
2180	サニーサイドアップグループ	4,600	586.00	2,695,600	
2181	パーソルホールディングス	3,706,800	235.20	871,839,360	
2183	リニカル	9,100	523.00	4,759,300	

2193	クックパッド	99,600	117.00	11,653,200	貸付有価証券 2,300株
2196	エスクリ	6,300	294.00	1,852,200	貸付有価証券 1,300株
2198	アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,500	723.00	5,422,500	
2301	学情	18,500	1,769.00	32,726,500	貸付有価証券 1,500株
2305	スタジオアリス	18,200	2,103.00	38,274,600	貸付有価証券 2,100株
2309	シミックホールディングス	17,500	2,643.00	46,252,500	
2311	エプロコ	3,500	959.00	3,356,500	
2325	N J S	8,000	2,767.00	22,136,000	
2331	総合警備保障	608,200	795.70	483,944,740	貸付有価証券 24,700株
2371	カカクコム	240,500	1,694.00	407,407,000	貸付有価証券 10,300株
2372	アイロムグループ	14,700	2,056.00	30,223,200	
2374	セントケア・ホールディング	26,500	957.00	25,360,500	
2376	サイネックス	2,700	842.00	2,273,400	貸付有価証券 700株
2378	ルネサンス	28,300	919.00	26,007,700	
2379	ディップ	55,800	2,603.00	145,247,400	
2389	デジタルホールディングス	18,900	1,262.00	23,851,800	
2395	新日本科学	33,100	1,748.00	57,858,800	貸付有価証券 4,600株
2410	キャリアデザインセンター	3,200	2,056.00	6,579,200	
2412	ベネフィット・ワン	126,500	2,130.00	269,445,000	
2413	エムスリー	719,600	2,379.00	1,711,928,400	貸付有価証券 120,900株
2418	ツカダ・グローバルホールディング	10,000	389.00	3,890,000	貸付有価証券 2,700株
2424	プラス	1,800	762.00	1,371,600	貸付有価証券 500株
2427	アウトソーシング	233,700	1,743.50	407,455,950	
2428	ウェルネット	11,800	570.00	6,726,000	
2429	ワールドホールディングス	16,400	2,969.00	48,691,600	
2432	ディー・エヌ・エー	129,400	1,519.50	196,623,300	貸付有価証券 20,900株
2433	博報堂D Yホールディングス	464,400	1,136.50	527,790,600	
2440	ぐるなび	67,800	275.00	18,645,000	貸付有価証券 7,300株
2445	タカミヤ	49,400	484.00	23,909,600	
2453	ジャパンベストレスキューシステム	18,100	997.00	18,045,700	

2461	ファンコミュニケーションズ	51,000	402.00	20,502,000	貸付有価証券 2,000株
2462	ライク	13,600	1,519.00	20,658,400	貸付有価証券 900株
2464	A o b a - B B T	5,800	411.00	2,383,800	
2471	エスプール	104,700	318.00	33,294,600	
2475	WDBホールディングス	18,600	2,315.00	43,059,000	
2485	ティア	9,200	466.00	4,287,200	
2487	CDG	1,700	1,225.00	2,082,500	
2489	アドウェイズ	50,100	511.00	25,601,100	貸付有価証券 7,400株
2491	バリューコマース	32,000	1,562.00	49,984,000	貸付有価証券 100株
2492	インフォマート	378,000	414.00	156,492,000	
2749	J Pホールディングス	93,100	456.00	42,453,600	
3521	エコナックホールディングス	13,400	134.00	1,795,600	貸付有価証券 3,800株
4286	CLホールディングス	8,600	926.00	7,963,600	
4290	プレステージ・インターナショナル	170,400	599.00	102,069,600	貸付有価証券 19,600株
4301	アミューズ	22,200	1,550.00	34,410,000	
4310	ドリームインキュベータ	12,500	3,315.00	41,437,500	
4318	クイック	25,300	2,520.00	63,756,000	
4319	T A C	7,600	198.00	1,504,800	貸付有価証券 2,500株
4324	電通グループ	357,900	3,972.00	1,421,578,800	貸付有価証券 45,300株
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	12,200	1,215.00	14,823,000	
4337	びあ	12,400	3,340.00	41,416,000	貸付有価証券 1,200株
4343	イオンファンタジー	13,100	2,515.00	32,946,500	貸付有価証券 1,600株
4345	シーティーエス	46,000	686.00	31,556,000	貸付有価証券 1,600株
4346	N E X Y Z . G r o u p	4,800	723.00	3,470,400	貸付有価証券 1,500株
4544	H. U. グループホールディングス	106,600	2,704.50	288,299,700	貸付有価証券 15,600株
4641	アルプス技研	34,600	2,884.00	99,786,400	貸付有価証券 100株
4651	サニックス	58,300	300.00	17,490,000	
4658	日本空調サービス	39,100	837.00	32,726,700	
4661	オリエンタルランド	1,927,000	5,448.00	10,498,296,000	貸付有価証券 74,300株

4665	ダスキン	81,100	3,400.00	275,740,000	貸付有価証券 100株
4668	明光ネットワークジャパン	44,200	723.00	31,956,600	
4671	ファルコホールディングス	16,400	2,190.00	35,916,000	
4678	秀英予備校	3,500	301.00	1,053,500	
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	342,600	644.00	220,634,400	
4681	リゾートトラスト	158,100	2,506.50	396,277,650	
4694	ビー・エム・エル	44,800	2,844.00	127,411,200	
4714	リゾー教育	186,200	243.00	45,246,600	貸付有価証券 19,400株
4718	早稲田アカデミー	20,100	1,687.00	33,908,700	
4732	ユー・エス・エス	408,500	2,816.50	1,150,540,250	貸付有価証券 43,400株
4745	東京個別指導学院	43,100	446.00	19,222,600	
4751	サイバーエージェント	804,600	951.30	765,415,980	貸付有価証券 31,000株
4755	楽天グループ	3,120,500	684.70	2,136,606,350	貸付有価証券 423,600株
4763	クリーク・アンド・リバー社	18,300	1,955.00	35,776,500	
4765	SBIグローバルアセットマネジメン ト	71,300	640.00	45,632,000	貸付有価証券 2,500株
4767	テー・オー・ダブリュー	71,400	332.00	23,704,800	
4792	山田コンサルティンググループ	15,800	1,768.00	27,934,400	
4801	セントラルスポーツ	13,700	2,488.00	34,085,600	
4848	フルキャストホールディングス	34,800	1,808.00	62,918,400	
4849	エン・ジャパン	59,300	2,678.00	158,805,400	
5261	リゾルホールディングス	1,300	5,970.00	7,761,000	貸付有価証券 300株
6028	テクノプロ・ホールディングス	213,200	3,505.00	747,266,000	
6029	アトラグループ	3,600	184.00	662,400	貸付有価証券 1,300株
6035	アイ・アールジャパンホールディング ス	18,900	1,555.00	29,389,500	
6036	Ke e P e r 技研	22,500	6,380.00	143,550,000	貸付有価証券 3,500株
6037	ファーストロジック	3,500	518.00	1,813,000	
6044	三機サービス	2,300	1,428.00	3,284,400	
6047	G u n o s y	28,900	694.00	20,056,600	貸付有価証券 1,800株
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	1,593.00	21,983,400	
6054	リブセンス	7,100	248.00	1,760,800	貸付有価証券 2,700株
6055	ジャパンマテリアル	111,400	2,500.00	278,500,000	貸付有価証券 4,200株
6058	ベクトル	44,700	1,200.00	53,640,000	
6059	ウチヤマホールディングス	6,600	381.00	2,514,600	貸付有価証券 2,100株
6062	チャーム・ケア・コーポレーション	30,300	1,199.00	36,329,700	
6070	キャリアリンク	13,300	2,566.00	34,127,800	
6071	I B J	27,800	706.00	19,626,800	貸付有価証券 2,900株
6073	アサンテ	18,000	1,685.00	30,330,000	
6078	バリューHR	31,800	1,454.00	46,237,200	貸付有価証券 1,600株
6080	M&Aキャピタルパートナーズ	29,400	2,411.00	70,883,400	貸付有価証券 3,400株
6082	ライドオンエクスプレスホールディングス	14,400	1,028.00	14,803,200	
6083	E R Iホールディングス	3,900	1,782.00	6,949,800	
6087	アビスト	2,400	3,100.00	7,440,000	貸付有価証券 600株
6088	シグマクシス・ホールディングス	49,100	1,368.00	67,168,800	
6089	ウィルグループ	30,400	1,193.00	36,267,200	貸付有価証券 2,800株
6093	エスクロー・エージェント・ジャパン	17,100	140.00	2,394,000	
6095	メドピア	32,000	702.00	22,464,000	
6096	レアジョブ	2,900	909.00	2,636,100	貸付有価証券 1,000株
6098	リクルートホールディングス	2,695,800	5,896.00	15,894,436,800	
6099	エラン	48,200	1,021.00	49,212,200	貸付有価証券 1,800株
6171	土木管理総合試験所	6,700	327.00	2,190,900	
6178	日本郵政	4,278,900	1,396.00	5,973,344,400	貸付有価証券 168,700株
6183	ベルシステム24ホールディングス	39,100	1,772.00	69,285,200	
6184	鎌倉新書	31,000	613.00	19,003,000	貸付有価証券 5,200株
6185	SMN	2,900	293.00	849,700	
6186	一蔵	2,000	616.00	1,232,000	貸付有価証券 400株
6189	グローバルキッズCOMPANY	2,500	658.00	1,645,000	
6191	エアトリ	26,700	1,805.00	48,193,500	貸付有価証券 1,900株

6194	アトラエ	21,500	700.00	15,050,000	
6196	ストライク	15,400	4,550.00	70,070,000	貸付有価証券 1,600株
6197	ソラスト	100,400	590.00	59,236,000	
6199	セラク	11,100	1,183.00	13,131,300	
6200	インソース	79,000	836.00	66,044,000	
6532	ベイカレント・コンサルティング	267,600	3,465.00	927,234,000	貸付有価証券 26,000株
6533	Orchestra Holdings	7,800	1,012.00	7,893,600	
6535	アイモバイル	48,600	456.00	22,161,600	
6538	キャリアインデックス	5,200	210.00	1,092,000	
6539	MS-Japan	11,600	1,221.00	14,163,600	貸付有価証券 300株
6540	船場	2,700	863.00	2,330,100	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	118,000	2,230.00	263,140,000	
6546	フルテック	2,100	1,151.00	2,417,100	貸付有価証券 300株
6547	グリーンズ	5,600	1,964.00	10,998,400	
6551	ツナググループ・ホールディングス	4,300	898.00	3,861,400	
6552	GameWith	4,600	339.00	1,559,400	貸付有価証券 900株
6555	MS&Consulting	2,000	610.00	1,220,000	貸付有価証券 300株
6556	ウェルビー	18,300	848.00	15,518,400	貸付有価証券 1,000株
6560	エル・ティー・エス	4,200	2,954.00	12,406,800	
6564	ミダックホールディングス	22,100	1,885.00	41,658,500	貸付有価証券 1,000株
6571	キュービーネットホールディングス	17,400	1,523.00	26,500,200	
6572	RPAホールディングス	49,300	258.00	12,719,400	
7030	スプリックス	4,400	822.00	3,616,800	貸付有価証券 600株
7033	マネジメントソリューションズ	15,600	3,025.00	47,190,000	
7034	プロレド・パートナーズ	8,900	357.00	3,177,300	
7035	and factory	4,500	330.00	1,485,000	貸付有価証券 1,000株
7037	テノ.ホールディングス	2,000	509.00	1,018,000	貸付有価証券 600株
7038	フロンティア・マネジメント	9,100	1,553.00	14,132,300	貸付有価証券 1,700株
7044	ピアラ	2,700	297.00	801,900	貸付有価証券 700株

7059	コプロ・ホールディングス	5,100	1,615.00	8,236,500	貸付有価証券 1,400株
7060	ギークス	2,000	501.00	1,002,000	
7071	アンビスホールディングス	39,000	2,706.00	105,534,000	貸付有価証券 400株
7085	カーブスホールディングス	99,500	698.00	69,451,000	
7088	フォーラムエンジニアリング	49,500	805.00	39,847,500	貸付有価証券 4,400株
7092	Fast Fitness Japan	12,400	1,100.00	13,640,000	貸付有価証券 1,500株
7354	ダイレクトマーケティングミックス	37,500	447.00	16,762,500	
7358	ポピンズ	5,400	1,145.00	6,183,000	貸付有価証券 1,000株
7366	LITALICO	28,400	1,869.00	53,079,600	貸付有価証券 1,300株
7374	コンフィデンス・インターワークス	1,800	1,625.00	2,925,000	貸付有価証券 100株
8769	アドバンテッジリスクマネジメント	7,900	462.00	3,649,800	貸付有価証券 2,100株
8876	リログループ	182,400	1,560.50	284,635,200	貸付有価証券 16,500株
8920	東祥	25,400	919.00	23,342,600	貸付有価証券 2,700株
9161	ID&Eホールディングス	22,000	3,510.00	77,220,000	
9216	ビーウィズ	9,200	1,931.00	17,765,200	貸付有価証券 400株
9247	TREホールディングス	69,700	1,276.00	88,937,200	
9248	人・夢・技術グループ	13,700	1,865.00	25,550,500	
9332	NISSOホールディングス	31,500	843.00	26,554,500	貸付有価証券 2,000株
9336	大栄環境	66,200	2,584.00	171,060,800	貸付有価証券 800株
9347	日本管財ホールディングス	38,200	2,615.00	99,893,000	
9552	M&A総研ホールディングス	17,500	4,700.00	82,250,000	
9603	エイチ・アイ・エス	105,800	1,775.00	187,795,000	貸付有価証券 6,600株
9612	ラックランド	16,500	2,601.00	42,916,500	貸付有価証券 800株
9616	共立メンテナンス	57,100	5,966.00	340,658,600	貸付有価証券 2,500株
9619	イチネンホールディングス	38,600	1,551.00	59,868,600	
9621	建設技術研究所	18,800	5,900.00	110,920,000	
9622	スペース	23,800	940.00	22,372,000	
9628	燦ホールディングス	34,100	1,119.00	38,157,900	
9632	スバル興業	2,000	15,530.00	31,060,000	貸付有価証券

					100株
9633	東京テアトル	5,700	1,120.00	6,384,000	
9644	タナベコンサルティンググループ	11,000	1,049.00	11,539,000	
9663	ナガワ	11,400	7,330.00	83,562,000	貸付有価証券 1,500株
9672	東京都競馬	30,500	4,605.00	140,452,500	貸付有価証券 2,700株
9675	常磐興産	5,700	1,232.00	7,022,400	貸付有価証券 1,700株
9678	カナモト	56,400	2,860.00	161,304,000	貸付有価証券 2,200株
9699	ニシオホールディングス	33,800	4,005.00	135,369,000	貸付有価証券 1,400株
9704	アゴーラ ホスピタリティー グループ	90,100	23.00	2,072,300	貸付有価証券 27,100株
9715	トランス・コスモス	45,200	3,125.00	141,250,000	
9716	乃村工藝社	158,800	867.00	137,679,600	貸付有価証券 6,200株
9722	藤田観光	14,600	6,300.00	91,980,000	貸付有価証券 1,800株
9726	KNT-CTホールディングス	21,700	1,346.00	29,208,200	貸付有価証券 800株
9729	トーカイ	32,200	2,095.00	67,459,000	
9731	白洋舎	1,500	2,734.00	4,101,000	貸付有価証券 500株
9735	セコム	370,800	10,625.00	3,939,750,000	貸付有価証券 59,200株
9740	セントラル警備保障	19,600	2,511.00	49,215,600	
9743	丹青社	70,600	864.00	60,998,400	
9744	メイテックグループホールディングス	131,100	2,892.00	379,141,200	
9755	応用地質	34,000	2,211.00	75,174,000	
9757	船井総研ホールディングス	75,800	2,611.00	197,913,800	
9760	進学会ホールディングス	4,100	255.00	1,045,500	
9765	オオバ	9,600	1,001.00	9,609,600	
9768	いであ	3,500	1,796.00	6,286,000	貸付有価証券 100株
9769	学究社	14,500	2,040.00	29,580,000	
9783	ベネッセホールディングス	122,400	2,604.00	318,729,600	
9787	イオンディライト	39,100	3,700.00	144,670,000	
9788	ナック	15,400	1,061.00	16,339,400	貸付有価証券 1,700株
9793	ダイセキ	74,300	4,200.00	312,060,000	貸付有価証券 200株
9795	ステップ	13,200	1,987.00	26,228,400	

合 計	547,528,400	1,255,140,150,820
-----	-------------	-------------------

(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1月26日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	53,562,175,962
コール・ローン	7,942,118,152
株式	3,915,150,753,773
投資証券	78,801,918,919
派生商品評価勘定	2,144,928,159
未収入金	7,309,679
未収配当金	2,490,415,177
差入委託証拠金	57,271,124,409
流動資産合計	4,117,370,744,230
資産合計	4,117,370,744,230
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	44,762,205
未払金	179,160,593
未払解約金	1,097,566,801
未払利息	2,030
流動負債合計	1,321,491,629
負債合計	1,321,491,629
純資産の部	
元本等	
元本	660,378,109,832
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	3,455,671,142,769
元本等合計	4,116,049,252,601
純資産合計	4,116,049,252,601
負債純資産合計	4,117,370,744,230

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1月26日現在]
1. 期首	2023年1月27日
期首元本額	447,735,229,199円
期中追加設定元本額	293,510,844,137円
期中一部解約元本額	80,867,963,504円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	191,895,316円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	939,715,115円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	872,534,140円
MAXIS 海外株式(MSCIコクサイ)上場投信	2,959,119,871円
MAXIS 全世界株式(オール・カントリー)上場投信	5,100,071,838円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,450,762,967円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	8,883,083,533円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	10,243,754,855円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	45,881,980円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	122,384,441円
ファンド・マネジャー(海外株式)	778,347円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,812,111,330円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	994,880,868円
eMAXIS バランス(波乗り型)	96,518,422円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,737,894,819円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	212,817,433円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	280,469,416円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	255,806,046円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	99,273,511,131円
海外株式セレクション(ラップ向け)	2,579,280,739円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	5,005,695,492円
つみたて先進国株式	30,935,804,994円
つみたて8資産均等バランス	2,461,844,106円
つみたて4資産均等バランス	874,380,430円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,959,065円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,474,054円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	5,862,823円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	176,196,547円

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	223,385,181円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	157,257,323円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	67,814,693円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	515,771,135円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	1,387,983,171円
eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本)	55,936,340,668円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	584,338,848円
三菱UFJ DC年金インデックス (先進国株式)	4,408,475,757円
eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カントリー)	301,763,188,540円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	146,265,580円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	44,678,341円
つみたて全世界株式	1,051,120,913円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	66,211,301円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	2,632,159,984円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	48,873,996円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	3,487,397,371円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	73,103,642円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	405,764円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	32,492,624,774円
eMAXIS 全世界株式インデックス	5,613,745,500円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	548,312,043円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	1,314,160,034円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	216,755,117円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	684,521,732円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	163,404,478円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	347,901,774円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	79,736,746円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	111,555,236円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	470,474,739円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	385,029,925円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	751,709,815円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA (適格機関投資家限定)	1,258,273,659円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型) VA (適格機関投資家限定)	152円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	4,790,818円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,188,453,595円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	34,699,107円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	638,902,835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)	8,652,283,913円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	64,889円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	508,021,364円
MUAM 全世界株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)	5,043,815,593円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	9,265,241円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	58,809,658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)	1,693,982,924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）	530,108,430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）	176,899,287円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	53,264,324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）	1,664,951,960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）	88,203,913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）	2,291,981,933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）	112,119,822円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	8,553,149,276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）	46,879,277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）	225,828円
外国株式インデックスファンドV（適格機関投資家限定）	2,934,838,875円
海外株式インデックスファンドS	6,306,259,282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）	109,841,511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）	56,203,509円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,864,901,659円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	681,516円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	1,721,302円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	424,751円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	1,889,113円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	20,762,215円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	763,333円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	6,288,227円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	713,836円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	7,279,105円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	6,947,302,773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）	81,649,487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）	350,627,224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）	387,880,035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）	395,740,042円
合計	660,378,109,832円
2. 受益権の総数	660,378,109,832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 1 月 27 日 至 2024 年 1 月 26 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和 26 年法律第 198 号）第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、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。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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>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 1月 26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 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 1月 26日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	429,659,191,149
投資証券	2,387,515,857
合計	432,046,707,006

(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 1月 26日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	133,192,596,964	—	135,301,790,306	2,109,193,342
合計		133,192,596,964	—	135,301,790,306	2,109,193,342

(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1月26日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	15,202,477,890	—	15,197,212,591	△5,265,299
	カナダドル	598,122,006	—	598,761,281	639,275
	オーストラリアドル	512,602,646	—	512,455,262	△147,384
	イギリスポンド	833,575,372	—	833,138,607	△436,765
	スイスフラン	554,870,036	—	554,018,966	△851,070
	香港ドル	151,730,363	—	151,659,199	△71,164
	シンガポールドル	67,315,953	—	67,284,849	△31,104
	スウェーデンクローネ	180,218,771	—	180,137,878	△80,893
	ノルウェークローネ	31,929,168	—	31,927,588	△1,580
	デンマーククローネ	194,391,128	—	194,146,653	△244,475
ユーロ	1,782,856,640	—	1,780,319,711	△2,536,929	
合計		20,110,089,973	—	20,101,062,585	△9,027,388

(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1月26日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	6.2329円 (62,329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	129,903	32.04	4,162,092.12	
	BAKER HUGHES CO	468,653	30.30	14,200,185.90	
	CHENIERE ENERGY INC	112,190	164.24	18,426,085.60	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	58,377	77.35	4,515,460.95	
	CHEVRON CORP	858,123	148.57	127,491,334.11	
	CONOCOPHILLIPS	569,000	112.05	63,756,450.00	
	COTERRA ENERGY INC	360,467	25.26	9,105,396.42	
	DEVON ENERGY CORP	301,043	42.49	12,791,317.07	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	79,274	156.32	12,392,111.68	
	EOG RESOURCES INC	279,785	114.85	32,133,307.25	
	EQT CORP	170,428	36.06	6,145,633.68	
	EXXON MOBIL CORP	1,893,734	102.13	193,407,053.42	
	HALLIBURTON CO	419,092	37.00	15,506,404.00	
	HESS CORP	129,005	144.03	18,580,590.15	
	HF SINCLAIR CORP	77,822	53.72	4,180,597.84	
	KINDER MORGAN INC	921,714	17.33	15,973,303.62	
	MARATHON OIL CORP	273,045	23.13	6,315,530.85	
	MARATHON PETROLEUM CORP	185,199	157.27	29,126,246.73	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	307,139	58.01	17,817,133.39	
	ONEOK INC	269,279	70.29	18,927,620.91	
	OVINTIV INC	113,361	42.88	4,860,919.68	
	PHILLIPS 66	205,968	137.65	28,351,495.20	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	108,031	228.27	24,660,236.37	
	SCHLUMBERGER LTD	681,579	52.47	35,762,450.13	
TARGA RESOURCES CORP	115,380	85.99	9,921,526.20		
TEXAS PACIFIC LAND CORP	2,458	1,494.42	3,673,284.36		
VALERO ENERGY CORP	163,915	134.46	22,040,010.90		

WILLIAMS COS INC	562,162	34.44	19,360,859.28
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	102,901	263.65	27,129,848.65
ALBEMARLE CORP	56,123	118.45	6,647,769.35
AMCOR PLC	709,256	9.47	6,716,654.32
AVERY DENNISON CORP	35,066	200.41	7,027,577.06
BALL CORP	149,564	56.87	8,505,704.68
CELANESE CORP	46,361	145.37	6,739,498.57
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	101,273	76.95	7,792,957.35
CLEVELAND-CLIFFS INC	275,888	18.41	5,079,098.08
CORTEVA INC	336,921	45.24	15,242,306.04
CROWN HOLDINGS INC	50,366	90.51	4,558,626.66
DOW INC	327,275	54.94	17,980,488.50
DUPONT DE NEMOURS INC	213,273	64.11	13,672,932.03
EASTMAN CHEMICAL CO	59,297	84.62	5,017,712.14
ECOLAB INC	118,537	198.62	23,543,818.94
FMC CORP	66,809	57.47	3,839,513.23
FREEMONT-MCMORAN INC	670,214	39.44	26,433,240.16
INTERNATIONAL PAPER CO	159,887	37.65	6,019,745.55
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	121,459	82.37	10,004,577.83
LINDE PLC	230,976	403.47	93,191,886.72
LYONDELLBASELL INDU-CL A	120,993	95.39	11,541,522.27
MARTIN MARIETTA MATERIALS	29,074	504.82	14,677,136.68
MOSAIC CO/THE	145,017	32.05	4,647,794.85
NEWMONT CORP	536,739	34.49	18,512,128.11
NUCOR CORP	117,630	174.70	20,549,961.00
PACKAGING CORP OF AMERICA	39,261	171.68	6,740,328.48
PPG INDUSTRIES INC	109,500	142.79	15,635,505.00
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	26,220	280.41	7,352,350.20
RPM INTERNATIONAL INC	57,533	107.52	6,185,948.16
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	116,862	303.91	35,515,530.42
STEEL DYNAMICS INC	78,999	115.90	9,155,984.10
VULCAN MATERIALS CO	62,541	223.41	13,972,284.81
WESTLAKE CORP	17,817	138.38	2,465,516.46
WESTROCK CO	125,922	42.43	5,342,870.46
3M CO	255,830	95.98	24,554,563.40
AECOM	58,145	88.75	5,160,368.75

AERCAP HOLDINGS NV	88,868	77.62	6,897,934.16
ALLEGION PLC	47,118	125.76	5,925,559.68
AMETEK INC	107,243	164.12	17,600,721.16
AXON ENTERPRISE INC	35,700	252.70	9,021,390.00
BOEING CO/THE	272,491	201.88	55,010,483.08
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	59,216	169.80	10,054,876.80
CARLISLE COS INC	25,792	310.21	8,000,936.32
CARRIER GLOBAL CORP	389,084	56.31	21,909,320.04
CATERPILLAR INC	242,433	300.77	72,916,573.41
CNH INDUSTRIAL NV	438,944	11.94	5,240,991.36
CUMMINS INC	66,361	238.85	15,850,324.85
DEERE & CO	130,113	393.01	51,135,710.13
DOVER CORP	67,630	149.96	10,141,794.80
EATON CORP PLC	190,902	245.82	46,927,529.64
EMERSON ELECTRIC CO	265,443	96.24	25,546,234.32
FASTENAL CO	265,499	69.21	18,375,185.79
FERGUSON PLC	95,088	188.81	17,953,565.28
FORTIVE CORP	166,508	74.29	12,369,879.32
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	59,589	78.83	4,697,400.87
GENERAL DYNAMICS CORP	107,291	265.86	28,524,385.26
GENERAL ELECTRIC CO	516,998	129.93	67,173,550.14
GRACO INC	88,867	84.57	7,515,482.19
HEICO CORP	18,379	184.73	3,395,152.67
HEICO CORP-CLASS A	34,856	144.46	5,035,297.76
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	314,217	202.56	63,647,795.52
HOWMET AEROSPACE INC	185,591	55.27	10,257,614.57
HUBBELL INC	25,853	333.82	8,630,248.46
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	20,277	254.40	5,158,468.80
IDEX CORP	34,302	207.78	7,127,269.56
ILLINOIS TOOL WORKS	144,560	262.18	37,900,740.80
INGERSOLL-RAND INC	191,346	79.25	15,164,170.50
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	62,100	40.65	2,524,365.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	315,657	55.70	17,582,094.90
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	88,994	204.64	18,211,732.16
LENNOX INTERNATIONAL INC	15,354	439.48	6,747,775.92
LOCKHEED MARTIN CORP	106,710	431.04	45,996,278.40

MASCO CORP	116,358	67.18	7,816,930.44
NORDSON CORP	23,401	254.05	5,945,024.05
NORTHROP GRUMMAN CORP	66,755	434.55	29,008,385.25
OTIS WORLDWIDE CORP	190,773	88.98	16,974,981.54
OWENS CORNING	40,184	149.72	6,016,348.48
PACCAR INC	242,575	102.01	24,745,075.75
PARKER HANNIFIN CORP	62,598	471.80	29,533,736.40
PENTAIR PLC	73,174	72.16	5,280,235.84
QUANTA SERVICES INC	68,033	197.99	13,469,853.67
ROCKWELL AUTOMATION INC	53,811	304.24	16,371,458.64
RTX CORP	695,934	90.94	63,288,237.96
SMITH (A. O.) CORP	60,973	81.27	4,955,275.71
SNAP-ON INC	23,090	288.55	6,662,619.50
STANLEY BLACK & DECKER INC	73,888	95.05	7,023,054.40
TEXTRON INC	87,158	86.16	7,509,533.28
TORO CO	51,819	93.77	4,859,067.63
TRANE TECHNOLOGIES PLC	105,526	252.12	26,605,215.12
TRANSDIGM GROUP INC	25,655	1,078.87	27,678,409.85
UNITED RENTALS INC	32,025	651.64	20,868,771.00
VERTIV HOLDINGS CO-A	150,485	53.31	8,022,355.35
WABTEC CORP	85,505	129.82	11,100,259.10
WATSCO INC	15,087	388.37	5,859,338.19
WW GRAINGER INC	20,934	881.45	18,452,274.30
XYLEM INC	118,330	112.98	13,368,923.40
AUTOMATIC DATA PROCESSING	196,166	236.72	46,436,415.52
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	66,512	128.88	8,572,066.56
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	55,598	208.25	11,578,283.50
CERIDIAN HCM HOLDING INC	63,385	68.60	4,348,211.00
CINTAS CORP	42,190	598.51	25,251,136.90
COPART INC	401,600	48.99	19,674,384.00
EQUIFAX INC	57,597	248.43	14,308,822.71
JACOBS SOLUTIONS INC	60,243	135.71	8,175,577.53
LEIDOS HOLDINGS INC	57,281	110.73	6,342,725.13
PAYCHEX INC	150,266	121.01	18,183,688.66
PAYCOM SOFTWARE INC	27,679	192.78	5,335,957.62
PAYLOCITY HOLDING CORP	19,837	158.56	3,145,354.72

REPUBLIC SERVICES INC	101,991	170.28	17,367,027.48
ROBERT HALF INC	46,823	81.13	3,798,749.99
ROLLINS INC	124,555	43.01	5,357,110.55
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	109,026	61.13	6,664,759.38
TRANSUNION	93,628	69.45	6,502,464.60
VERALTO CORP	104,122	76.70	7,986,157.40
VERISK ANALYTICS INC	67,386	243.48	16,407,143.28
WASTE CONNECTIONS INC	119,965	153.43	18,406,229.95
WASTE MANAGEMENT INC	186,270	185.10	34,478,577.00
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	56,990	86.92	4,953,570.80
CSX CORP	923,002	35.00	32,305,070.00
DELTA AIR LINES INC	63,959	40.18	2,569,872.62
EXPEDITORS INTL WASH INC	74,240	129.98	9,649,715.20
FEDEX CORP	110,520	253.13	27,975,927.60
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	833,326	3.16	2,633,310.16
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	42,716	206.26	8,810,602.16
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	70,638	57.90	4,089,940.20
NORFOLK SOUTHERN CORP	105,227	237.85	25,028,241.95
OLD DOMINION FREIGHT LINE	45,766	395.44	18,097,707.04
SOUTHWEST AIRLINES CO	70,510	30.39	2,142,798.90
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	55,698	65.20	3,631,509.60
UBER TECHNOLOGIES INC	874,176	66.00	57,695,616.00
UNION PACIFIC CORP	289,173	241.57	69,855,521.61
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	344,500	159.71	55,020,095.00
APTIV PLC	134,381	84.52	11,357,882.12
BORGWARNER INC	121,246	33.79	4,096,902.34
FORD MOTOR CO	1,830,738	11.34	20,760,568.92
GENERAL MOTORS CO	640,209	35.16	22,509,748.44
LEAR CORP	36,593	132.33	4,842,351.69
LUCID GROUP INC	324,874	2.66	864,164.84
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	276,586	15.00	4,148,790.00
TESLA INC	1,350,282	182.63	246,602,001.66
DECKERS OUTDOOR CORP	11,616	761.01	8,839,892.16
DR HORTON INC	141,977	141.57	20,099,683.89
GARMIN LTD	77,502	125.04	9,690,850.08
HASBRO INC	51,810	50.08	2,594,644.80

LENNAR CORP-A	117,158	149.12	17,470,600.96
LULULEMON ATHLETICA INC	53,453	474.30	25,352,757.90
NIKE INC -CL B	582,418	100.77	58,690,261.86
NVR INC	1,554	7,019.11	10,907,696.94
PULTEGROUP INC	105,057	105.13	11,044,642.41
VF CORP	191,608	17.05	3,266,916.40
AIRBNB INC-CLASS A	197,486	142.11	28,064,735.46
BOOKING HOLDINGS INC	16,969	3,503.25	59,446,649.25
CAESARS ENTERTAINMENT INC	96,290	44.90	4,323,421.00
CARNIVAL CORP	478,591	16.47	7,882,393.77
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	12,770	2,311.77	29,521,302.90
DARDEN RESTAURANTS INC	57,227	162.12	9,277,641.24
DOMINO'S PIZZA INC	16,546	418.08	6,917,551.68
DOORDASH INC - A	126,356	107.52	13,585,797.12
DRAFTKINGS INC-CL A	180,722	38.69	6,992,134.18
EXPEDIA GROUP INC	65,362	152.30	9,954,632.60
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	121,717	191.77	23,341,669.09
HYATT HOTELS CORP - CL A	24,388	131.14	3,198,242.32
LAS VEGAS SANDS CORP	179,569	50.15	9,005,385.35
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	117,345	242.52	28,458,509.40
MCDONALD'S CORP	344,373	297.21	102,351,099.33
MGM RESORTS INTERNATIONAL	154,928	43.62	6,757,959.36
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	113,941	127.71	14,551,405.11
STARBUCKS CORP	545,479	92.61	50,516,810.19
VAIL RESORTS INC	15,472	225.93	3,495,588.96
WYNN RESORTS LTD	45,962	96.41	4,431,196.42
YUM! BRANDS INC	129,818	130.22	16,904,899.96
ALPHABET INC-CL A	3,501,102	151.87	531,712,360.74
ALPHABET INC-CL C	1,769,297	153.64	271,834,791.08
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	45,578	369.07	16,821,472.46
COMCAST CORP-CLASS A	1,949,760	45.27	88,265,635.20
ELECTRONIC ARTS INC	119,837	138.94	16,650,152.78
FOX CORP - CLASS A	120,205	32.13	3,862,186.65
FOX CORP - CLASS B	50,847	29.71	1,510,664.37
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	200,600	32.92	6,603,752.00
LIBERTY BROADBAND-C	64,383	78.34	5,043,764.22

LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	96,984	68.22	6,616,248.48
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	66,027	30.94	2,042,875.38
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	70,934	89.78	6,368,454.52
MATCH GROUP INC	134,711	38.05	5,125,753.55
META PLATFORMS INC-CLASS A	1,049,767	393.18	412,747,389.06
NETFLIX INC	209,772	562.00	117,891,864.00
NEWS CORP - CLASS A	205,514	24.70	5,076,195.80
OMNICOM GROUP	85,179	90.98	7,749,585.42
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	226,588	13.96	3,163,168.48
PINTEREST INC- CLASS A	275,110	36.99	10,176,318.90
ROBLOX CORP -CLASS A	211,776	41.32	8,750,584.32
ROKU INC	59,908	88.83	5,321,627.64
SEA LTD-ADR	157,094	39.40	6,189,503.60
SIRIUS XM HOLDINGS INC	334,269	5.37	1,795,024.53
SNAP INC - A	457,200	16.29	7,447,788.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	80,240	168.50	13,520,440.00
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	209,742	69.12	14,497,367.04
WALT DISNEY CO/THE	868,428	94.86	82,379,080.08
WARNER BROS DISCOVERY INC	1,104,254	10.58	11,683,007.32
AMAZON.COM INC	4,384,223	157.75	691,611,178.25
AUTOZONE INC	8,322	2,748.61	22,873,932.42
BATH & BODY WORKS INC	105,296	41.66	4,386,631.36
BEST BUY CO INC	102,296	75.21	7,693,682.16
BURLINGTON STORES INC	31,307	197.05	6,169,044.35
CARMAX INC	67,362	69.08	4,653,366.96
DICK'S SPORTING GOODS INC	25,400	153.15	3,890,010.00
EBAY INC	252,373	42.16	10,640,045.68
ETSY INC	60,720	69.56	4,223,683.20
GENUINE PARTS CO	68,207	142.52	9,720,861.64
GLOBAL-E ONLINE LTD	34,400	37.30	1,283,120.00
HOME DEPOT INC	473,511	350.97	166,188,155.67
LKQ CORP	132,517	47.51	6,295,882.67
LOWE'S COS INC	274,755	212.08	58,270,040.40
MERCADOLIBRE INC	20,908	1,738.80	36,354,830.40
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	27,976	1,024.04	28,648,543.04
POOL CORP	19,048	378.56	7,210,810.88

ROSS STORES INC	157,794	140.81	22,218,973.14
TJX COMPANIES INC	544,222	95.51	51,978,643.22
TRACTOR SUPPLY COMPANY	54,243	226.33	12,276,818.19
ULTA BEAUTY INC	24,363	493.22	12,016,318.86
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	129,336	21.81	2,820,818.16
COSTCO WHOLESALE CORP	209,445	679.90	142,401,655.50
DOLLAR GENERAL CORP	102,960	132.88	13,681,324.80
DOLLAR TREE INC	97,610	132.23	12,906,970.30
KROGER CO	318,193	46.43	14,773,700.99
SYSCO CORP	234,054	75.27	17,617,244.58
TARGET CORP	214,074	142.18	30,437,041.32
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	350,405	23.11	8,097,859.55
WALMART INC	699,788	162.84	113,953,477.92
ALTRIA GROUP INC	816,141	40.21	32,817,029.61
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	249,543	51.38	12,821,519.34
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	159,753	55.71	8,899,839.63
BUNGE GLOBAL SA	71,945	88.45	6,363,535.25
CAMPBELL SOUP CO	79,341	44.24	3,510,045.84
CELSIUS HOLDINGS INC	66,588	53.30	3,549,140.40
COCA-COLA CO/THE	1,939,177	59.16	114,721,711.32
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	100,867	68.22	6,881,146.74
CONAGRA BRANDS INC	235,853	29.68	7,000,117.04
CONSTELLATION BRANDS INC-A	76,807	250.21	19,217,879.47
DARLING INGREDIENTS INC	61,326	43.83	2,687,918.58
GENERAL MILLS INC	272,350	64.47	17,558,404.50
HERSHEY CO/THE	70,637	189.36	13,375,822.32
HORMEL FOODS CORP	152,101	30.42	4,626,912.42
JM SMUCKER CO/THE	47,902	131.55	6,301,508.10
KELLANOVA	134,376	54.63	7,340,960.88
KEURIG DR PEPPER INC	488,593	31.59	15,434,652.87
KRAFT HEINZ CO/THE	400,266	37.26	14,913,911.16
LAMB WESTON HOLDINGS INC	69,547	105.04	7,305,216.88
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	120,387	68.60	8,258,548.20
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	81,614	62.88	5,131,888.32
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	646,336	74.50	48,152,032.00
MONSTER BEVERAGE CORP	364,459	55.14	20,096,269.26

PEPSICO INC	649,426	166.56	108,168,394.56
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	734,167	91.21	66,963,372.07
TYSON FOODS INC-CL A	144,659	54.04	7,817,372.36
CHURCH & DWIGHT CO INC	116,953	98.07	11,469,580.71
CLOROX COMPANY	62,251	144.15	8,973,481.65
COLGATE-PALMOLIVE CO	361,455	81.22	29,357,375.10
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	109,823	128.66	14,129,827.18
KENVUE INC	809,317	20.75	16,793,327.75
KIMBERLY-CLARK CORP	157,123	120.49	18,931,750.27
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,113,158	155.62	173,229,647.96
ABBOTT LABORATORIES	820,999	112.45	92,321,337.55
ALIGN TECHNOLOGY INC	36,172	262.11	9,481,042.92
BAXTER INTERNATIONAL INC	251,287	38.99	9,797,680.13
BECTON DICKINSON AND CO	134,157	236.57	31,737,521.49
BOSTON SCIENTIFIC CORP	698,399	60.83	42,483,611.17
CARDINAL HEALTH INC	116,021	105.71	12,264,579.91
CENCORA INC	79,861	218.84	17,476,781.24
CENTENE CORP	252,779	73.55	18,591,895.45
COOPER COS INC/THE	23,886	379.29	9,059,720.94
CVS HEALTH CORP	610,950	71.99	43,982,290.50
DAVITA INC	22,235	107.43	2,388,706.05
DEXCOM INC	180,833	126.50	22,876,278.66
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	285,205	73.55	20,976,827.75
ELEVANCE HEALTH INC	111,967	480.31	53,778,869.77
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	191,178	72.87	13,931,140.86
HCA HEALTHCARE INC	94,247	286.02	26,956,526.94
HENRY SCHEIN INC	55,674	74.04	4,122,102.96
HOLOGIC INC	108,472	74.14	8,042,114.08
HUMANA INC	57,461	355.36	20,419,340.96
IDEXX LABORATORIES INC	38,629	522.44	20,181,334.76
INSULET CORP	33,794	198.67	6,713,853.98
INTUITIVE SURGICAL INC	167,451	374.97	62,789,101.47
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	38,741	226.65	8,780,647.65
MCKESSON CORP	62,517	486.33	30,403,892.61
MEDTRONIC PLC	631,690	85.79	54,192,685.10
MOLINA HEALTHCARE INC	29,135	350.07	10,199,289.45

QUEST DIAGNOSTICS INC	53,597	130.15	6,975,649.55
RESMED INC	70,379	186.35	13,115,126.65
STERIS PLC	46,847	216.68	10,150,807.96
STRYKER CORP	162,493	311.91	50,683,191.63
TELEFLEX INC	21,664	244.88	5,305,080.32
THE CIGNA GROUP	141,762	298.57	42,325,880.34
UNITEDHEALTH GROUP INC	437,657	493.40	215,939,963.80
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	24,352	156.98	3,822,776.96
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	71,343	208.20	14,853,612.60
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	99,295	121.96	12,110,018.20
ABBVIE INC	833,355	165.13	137,611,911.15
AGILENT TECHNOLOGIES INC	136,910	129.88	17,781,870.80
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	58,878	183.93	10,829,430.54
AMGEN INC	252,730	310.26	78,412,009.80
AVANTOR INC	338,278	21.94	7,421,819.32
BIO-RAD LABORATORIES-A	9,607	316.30	3,038,694.10
BIO-TECHNE CORP	73,060	71.12	5,196,027.20
BIOGEN INC	67,078	246.21	16,515,274.38
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	89,283	91.25	8,147,073.75
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	992,455	49.61	49,235,692.55
CATALENT INC	70,521	50.41	3,554,963.61
CHARLES RIVER LABORATORIES	25,059	213.03	5,338,318.77
DANAHER CORP	332,522	227.39	75,612,177.58
ELI LILLY & CO	381,237	627.62	239,271,965.94
EXACT SCIENCES CORP	85,934	64.26	5,522,118.84
GILEAD SCIENCES INC	588,457	80.23	47,211,905.11
ILLUMINA INC	75,364	142.76	10,758,964.64
INCYTE CORP	92,287	60.92	5,622,124.04
IQVIA HOLDINGS INC	85,523	215.50	18,430,206.50
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	24,964	122.82	3,066,078.48
JOHNSON & JOHNSON	1,135,612	159.56	181,198,250.72
MERCK & CO. INC.	1,197,192	120.13	143,818,674.96
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	10,428	1,202.45	12,539,148.60
MODERNA INC	151,325	102.81	15,557,723.25
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	46,801	141.01	6,599,409.01
PFIZER INC	2,676,489	27.47	73,523,152.83

REGENERON PHARMACEUTICALS	50,452	948.87	47,872,389.24
REPLIGEN CORP	27,634	185.51	5,126,383.34
REVVITY INC	64,189	108.69	6,976,702.41
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	163,958	29.11	4,772,817.38
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	537,553	11.83	6,359,251.99
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	182,783	538.21	98,375,638.43
UNITED THERAPEUTICS CORP	20,488	219.32	4,493,428.16
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	122,352	429.96	52,606,465.92
VIATRIS INC	571,447	11.74	6,708,787.78
WATERS CORP	28,250	312.00	8,814,000.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	34,752	354.22	12,309,853.44
ZOETIS INC	218,455	187.32	40,920,990.60
BANK OF AMERICA CORP	3,395,483	33.39	113,375,177.37
CITIGROUP INC	918,277	53.73	49,339,023.21
CITIZENS FINANCIAL GROUP	215,044	33.60	7,225,478.40
FIFTH THIRD BANCORP	323,273	34.90	11,282,227.70
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	4,692	1,412.41	6,627,027.72
HUNTINGTON BANCSHARES INC	784,804	12.94	10,155,363.76
JPMORGAN CHASE & CO	1,372,815	172.94	237,414,626.10
KEYCORP	425,764	14.54	6,190,608.56
M & T BANK CORP	77,940	142.04	11,070,597.60
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	184,875	151.25	27,962,343.75
REGIONS FINANCIAL CORP	451,758	19.13	8,642,130.54
TRUIST FINANCIAL CORP	617,004	37.51	23,143,820.04
US BANCORP	738,867	42.81	31,630,896.27
WELLS FARGO & CO	1,736,643	49.88	86,623,752.84
ALLY FINANCIAL INC	150,075	36.90	5,537,767.50
AMERICAN EXPRESS CO	297,670	188.07	55,982,796.90
AMERIPRISE FINANCIAL INC	47,423	391.38	18,560,413.74
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	221,134	19.64	4,343,071.76
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	185,785	99.98	18,574,784.30
ARES MANAGEMENT CORP - A	78,272	120.67	9,445,082.24
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	359,883	55.34	19,915,925.22
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	617,271	380.85	235,087,660.35
BLACKROCK INC	71,039	790.46	56,153,487.94
BLACKSTONE INC	340,601	123.49	42,060,817.49

BLOCK INC	257,486	62.71	16,146,947.06
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	177,252	132.55	23,494,752.60
CARLYLE GROUP INC/THE	100,944	40.96	4,134,666.24
CBOE GLOBAL MARKETS INC	50,535	188.69	9,535,449.15
CME GROUP INC	165,902	205.61	34,111,110.22
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	80,152	121.01	9,699,193.52
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	125,220	103.74	12,990,322.80
EQUITABLE HOLDINGS INC	161,103	33.32	5,367,951.96
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	16,770	471.08	7,900,011.60
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	277,419	62.25	17,269,332.75
FISERV INC	290,471	140.66	40,857,650.86
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	33,282	293.80	9,778,251.60
FRANKLIN RESOURCES INC	152,703	27.48	4,196,278.44
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	20,000	49.02	980,400.00
GLOBAL PAYMENTS INC	121,284	131.38	15,934,291.92
GOLDMAN SACHS GROUP INC	156,808	382.70	60,010,421.60
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	273,218	127.29	34,777,919.22
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	32,205	168.29	5,419,779.45
KKR & CO INC	267,580	85.35	22,837,953.00
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	37,429	240.68	9,008,411.72
MARKETAXESS HOLDINGS INC	18,161	273.37	4,964,672.57
MASTERCARD INC - A	397,104	436.80	173,455,027.20
MOODY'S CORP	76,058	392.60	29,860,370.80
MORGAN STANLEY	593,456	88.02	52,235,997.12
MSCI INC	36,664	554.77	20,340,087.28
NASDAQ INC	162,267	58.37	9,471,524.79
NORTHERN TRUST CORP	106,892	81.79	8,742,696.68
PAYPAL HOLDINGS INC	483,824	60.71	29,372,955.04
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	94,006	113.85	10,702,583.10
ROBINHOOD MARKETS INC - A	164,032	10.70	1,755,142.40
S&P GLOBAL INC	154,852	449.34	69,581,197.68
SCHWAB (CHARLES) CORP	716,696	63.71	45,660,702.16
SEI INVESTMENTS COMPANY	49,468	63.92	3,161,994.56
STATE STREET CORP	141,914	74.68	10,598,137.52
SYNCHRONY FINANCIAL	202,115	38.46	7,773,342.90
T ROWE PRICE GROUP INC	106,409	111.38	11,851,834.42

TOAST INC-CLASS A	133,334	16.60	2,213,344.40
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	44,347	98.28	4,358,423.16
VISA INC-CLASS A SHARES	758,046	272.61	206,650,920.06
AFLAC INC	258,788	84.89	21,968,513.32
ALLSTATE CORP	121,559	159.06	19,335,174.54
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	36,267	120.27	4,361,832.09
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	328,535	68.98	22,662,344.30
AON PLC-CLASS A	93,695	299.71	28,081,328.45
ARCH CAPITAL GROUP LTD	175,032	79.60	13,932,547.20
ARTHUR J GALLAGHER & CO	99,987	237.75	23,771,909.25
ASSURANT INC	21,769	171.33	3,729,682.77
BROWN & BROWN INC	115,015	77.19	8,878,007.85
CHUBB LTD	195,240	241.21	47,093,840.40
CINCINNATI FINANCIAL CORP	69,403	112.30	7,793,956.90
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	12,973	337.54	4,378,906.42
EVEREST GROUP LTD	20,718	376.56	7,801,570.08
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	125,557	49.77	6,248,971.89
GLOBE LIFE INC	42,612	123.50	5,262,582.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	152,913	87.12	13,321,780.56
LOEWS CORP	91,815	72.98	6,700,658.70
MARKEL GROUP INC	6,496	1,471.93	9,561,657.28
MARSH & MCLENNAN COS	235,195	191.09	44,943,412.55
METLIFE INC	295,036	70.39	20,767,584.04
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	114,836	80.16	9,205,253.76
PROGRESSIVE CORP	278,569	178.01	49,588,067.69
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	168,031	105.77	17,772,638.87
TRAVELERS COS INC/THE	105,266	211.52	22,265,864.32
WILLIS TOWERS WATSON PLC	49,085	250.72	12,306,591.20
WR BERKLEY CORP	90,046	83.27	7,498,130.42
ACCENTURE PLC-CL A	297,278	371.94	110,569,579.32
ADOBE INC	215,651	622.58	134,259,999.58
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	67,049	123.66	8,291,279.34
ANSYS INC	41,166	339.42	13,972,563.72
ASPEN TECHNOLOGY INC	10,737	202.05	2,169,410.85
ATLASSIAN CORP-CL A	72,442	244.35	17,701,202.70
AUTODESK INC	99,848	251.75	25,136,734.00

BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	115,702	50.05	5,790,885.10
BILL HOLDINGS INC	41,762	73.97	3,089,135.14
CADENCE DESIGN SYS INC	126,200	291.19	36,748,178.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	45,465	158.89	7,223,933.85
CLOUDFLARE INC - CLASS A	131,715	81.86	10,782,189.90
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	234,999	78.30	18,400,421.70
CONFLUENT INC-CLASS A	64,138	22.53	1,445,029.14
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	105,632	293.46	30,998,766.72
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	18,427	231.34	4,262,902.18
DATADOG INC - CLASS A	120,112	122.19	14,676,485.28
DOCUSIGN INC	99,141	62.47	6,193,338.27
DROPBOX INC-CLASS A	143,057	32.38	4,632,185.66
DYNATRACE INC	122,316	58.19	7,117,568.04
EPAM SYSTEMS INC	25,272	285.13	7,205,805.36
FAIR ISAAC CORP	11,675	1,284.27	14,993,852.25
FORTINET INC	312,243	65.55	20,467,528.65
GARTNER INC	36,967	461.19	17,048,810.73
GEN DIGITAL INC	292,070	23.84	6,962,948.80
GODADDY INC - CLASS A	71,554	107.45	7,688,477.30
HUBSPOT INC	22,670	585.73	13,278,499.10
INTL BUSINESS MACHINES CORP	430,927	190.43	82,061,428.61
INTUIT INC	133,340	641.49	85,536,276.60
MANHATTAN ASSOCIATES INC	27,717	218.28	6,050,066.76
MICROSOFT CORP	3,331,712	404.87	1,348,910,237.44
MONDAY.COM LTD	10,500	208.00	2,184,000.00
MONGODB INC	33,633	400.30	13,463,289.90
OKTA INC	67,338	84.51	5,690,734.38
ORACLE CORP	779,704	115.00	89,665,960.00
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	868,060	16.46	14,288,267.60
PALO ALTO NETWORKS INC	147,110	340.19	50,045,350.90
PTC INC	59,696	180.03	10,747,070.88
ROPER TECHNOLOGIES INC	49,247	551.70	27,169,569.90
SALESFORCE INC	461,365	279.03	128,734,675.95
SERVICENOW INC	97,420	766.69	74,690,939.80
SNOWFLAKE INC-CLASS A	130,503	206.01	26,884,923.03
SPLUNK INC	78,731	153.30	12,069,462.30

SYNOPSYS INC	70,546	536.68	37,860,627.28
TWILIO INC - A	83,044	72.50	6,020,690.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	21,498	429.25	9,228,016.50
UIPATH INC - CLASS A	163,403	22.83	3,730,490.49
UNITY SOFTWARE INC	98,085	32.88	3,225,034.80
VERISIGN INC	44,067	203.04	8,947,363.68
WIX.COM LTD	21,919	126.89	2,781,301.91
WORKDAY INC-CLASS A	96,589	292.36	28,238,760.04
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	121,952	67.42	8,222,003.84
ZSCALER INC	42,277	238.30	10,074,609.10
AMPHENOL CORP-CL A	275,050	100.81	27,727,790.50
APPLE INC	7,378,330	194.17	1,432,650,336.10
ARISTA NETWORKS INC	122,073	264.42	32,278,542.66
CDW CORP/DE	62,792	228.99	14,378,740.08
CISCO SYSTEMS INC	1,921,822	52.33	100,568,945.26
CORNING INC	402,780	30.82	12,413,679.60
DELL TECHNOLOGIES -C	120,098	83.04	9,972,937.92
F5 INC	28,851	184.64	5,327,048.64
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	607,105	15.92	9,665,111.60
HP INC	415,071	29.71	12,331,759.41
JABIL INC	66,575	124.18	8,267,283.50
JUNIPER NETWORKS INC	146,230	37.23	5,444,142.90
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	83,926	155.60	13,058,885.60
MOTOROLA SOLUTIONS INC	77,096	328.59	25,332,974.64
NETAPP INC	99,621	89.24	8,890,178.04
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	93,900	90.99	8,543,961.00
SUPER MICRO COMPUTER INC	20,822	475.58	9,902,526.76
TE CONNECTIVITY LTD	146,164	144.26	21,085,618.64
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	22,495	424.91	9,558,350.45
TRIMBLE INC	130,417	51.69	6,741,254.73
WESTERN DIGITAL CORP	154,930	60.33	9,346,926.90
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	23,205	256.99	5,963,452.95
AT&T INC	3,397,864	17.18	58,375,303.52
LIBERTY GLOBAL LTD-C	110,741	20.83	2,306,735.03
T-MOBILE US INC	252,540	162.56	41,052,902.40
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,990,703	42.29	84,186,829.87

AES CORP	301,072	17.13	5,157,363.36
ALLIANT ENERGY CORP	111,263	48.75	5,424,071.25
AMEREN CORPORATION	126,787	69.68	8,834,518.16
AMERICAN ELECTRIC POWER	237,861	78.09	18,574,565.49
AMERICAN WATER WORKS CO INC	97,628	123.98	12,103,919.44
ATMOS ENERGY CORP	70,614	113.92	8,044,346.88
CENTERPOINT ENERGY INC	304,623	27.52	8,383,224.96
CMS ENERGY CORP	149,917	56.46	8,464,313.82
CONSOLIDATED EDISON INC	159,223	89.67	14,277,526.41
CONSTELLATION ENERGY	149,416	120.55	18,012,098.80
DOMINION ENERGY INC	390,210	45.19	17,633,589.90
DTE ENERGY COMPANY	97,464	103.80	10,116,763.20
DUKE ENERGY CORP	366,352	95.73	35,070,876.96
EDISON INTERNATIONAL	179,463	67.04	12,031,199.52
ENTERGY CORP	105,812	99.08	10,483,852.96
ESSENTIAL UTILITIES INC	117,465	36.37	4,272,202.05
EVERGY INC	112,565	50.08	5,637,255.20
EVERSOURCE ENERGY	168,362	54.86	9,236,339.32
EXELON CORP	462,658	34.90	16,146,764.20
FIRSTENERGY CORP	258,340	36.50	9,429,410.00
NEXTERA ENERGY INC	973,941	57.98	56,469,099.18
NISOURCE INC	183,411	25.56	4,687,985.16
NRG ENERGY INC	109,791	53.69	5,894,678.79
P G & E CORP	943,499	16.76	15,813,043.24
PPL CORP	371,135	25.83	9,586,417.05
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	231,120	57.47	13,282,466.40
SEMPRA	289,474	70.73	20,474,496.02
SOUTHERN CO/THE	518,699	69.24	35,914,718.76
VISTRA CORP	168,052	40.43	6,794,342.36
WEC ENERGY GROUP INC	148,259	80.01	11,862,202.59
XCEL ENERGY INC	255,738	58.89	15,060,410.82
ADVANCED MICRO DEVICES	765,356	180.33	138,016,647.48
ANALOG DEVICES INC	236,722	197.30	46,705,250.60
APPLIED MATERIALS INC	395,578	172.63	68,288,630.14
BROADCOM INC	209,674	1,230.00	257,899,020.00
ENPHASE ENERGY INC	58,680	106.83	6,268,784.40

	ENTEGRIS INC	75,432	123.43	9,310,571.76	
	FIRST SOLAR INC	47,986	149.23	7,160,950.78	
	INTEL CORP	1,982,305	49.55	98,223,212.75	
	KLA CORP	63,066	641.69	40,468,821.54	
	LAM RESEARCH CORP	62,630	865.60	54,212,528.00	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	71,939	66.89	4,811,999.71	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	400,898	70.00	28,062,860.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	251,780	89.65	22,572,077.00	
	MICRON TECHNOLOGY INC	521,616	89.20	46,528,147.20	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	21,208	615.68	13,057,341.44	
	NVIDIA CORP	1,166,200	616.17	718,577,454.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	119,135	219.41	26,139,410.35	
	ON SEMICONDUCTOR	201,205	72.69	14,625,591.45	
	QORVO INC	47,965	106.44	5,105,394.60	
	QUALCOMM INC	527,728	154.47	81,518,144.16	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	75,631	107.03	8,094,785.93	
	TERADYNE INC	75,180	109.95	8,266,041.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	428,713	167.42	71,775,130.46	
	CBRE GROUP INC - A	154,213	86.75	13,377,977.75	
	COSTAR GROUP INC	191,216	84.61	16,178,785.76	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	487,100	3.17	1,544,107.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	61,585	55.09	3,392,717.65	
	アメリカドル 小計	160,135,345		19,947,684,412.13 (2,946,272,987,671)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	312,000	21.66	6,757,920.00	
	CAMECO CORP	206,900	61.97	12,821,593.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	527,400	86.81	45,783,594.00	
	CENOVUS ENERGY INC	680,600	21.37	14,544,422.00	
	ENBRIDGE INC	1,022,300	48.00	49,070,400.00	
	IMPERIAL OIL LTD	86,400	76.49	6,608,736.00	
	KEYERA CORP	96,900	33.23	3,219,987.00	
	MEG ENERGY CORP	137,000	25.65	3,514,050.00	
	PARKLAND CORP	59,200	46.21	2,735,632.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	293,932	46.50	13,667,838.00	
	SUNCOR ENERGY INC	606,600	43.52	26,399,232.00	
	TC ENERGY CORP	477,900	52.41	25,046,739.00	

TOURMALINE OIL CORP	156,500	59.28	9,277,320.00	
AGNICO EAGLE MINES LTD	250,940	67.08	16,833,055.20	
BARRICK GOLD CORP	835,800	21.03	17,576,874.00	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	62,000	58.15	3,605,300.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	254,400	12.46	3,169,824.00	
FRANCO-NEVADA CORP	84,800	147.22	12,484,256.00	
IVANHOE MINES LTD-CL A	247,000	14.91	3,682,770.00	
KINROSS GOLD CORP	502,500	7.48	3,758,700.00	
LUNDIN MINING CORP	278,300	10.99	3,058,517.00	
NUTRIEN LTD	235,759	68.08	16,050,472.72	
PAN AMERICAN SILVER CORP	166,900	18.85	3,146,065.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	203,400	54.50	11,085,300.00	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	26,600	109.86	2,922,276.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	219,800	63.04	13,856,192.00	
CAE INC	166,100	26.95	4,476,395.00	
STANTEC INC	52,200	108.72	5,675,184.00	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	34,700	116.29	4,035,263.00	
WSP GLOBAL INC	60,900	193.33	11,773,797.00	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	158,500	22.77	3,609,045.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	120,300	45.03	5,417,109.00	
RB GLOBAL INC	77,500	83.61	6,479,775.00	
THOMSON REUTERS CORP	75,232	200.66	15,096,053.12	
AIR CANADA	62,200	18.83	1,171,226.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	256,600	166.67	42,767,522.00	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	432,700	106.14	45,926,778.00	
TFI INTERNATIONAL INC	36,700	181.36	6,655,912.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	134,500	74.60	10,033,700.00	
BRP INC/CA- SUB VOTING	15,700	89.24	1,401,068.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	74,300	43.91	3,262,513.00	
RESTAURANT BRANDS INTERN	143,710	103.51	14,875,422.10	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	25,300	147.89	3,741,617.00	
DOLLARAMA INC	137,800	99.99	13,778,622.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	359,800	80.59	28,996,282.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	55,300	35.00	1,935,500.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	70,200	134.17	9,418,734.00	
METRO INC/CN	119,000	70.96	8,444,240.00	

WESTON (GEORGE) LTD	36,011	173.33	6,241,786.63	
SAPUTO INC	95,600	28.43	2,717,908.00	
BANK OF MONTREAL	348,000	130.29	45,340,920.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	586,600	61.86	36,287,076.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	431,300	61.87	26,684,531.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	160,900	102.29	16,458,461.00	
ROYAL BANK OF CANADA	661,700	132.34	87,569,378.00	
TORONTO-DOMINION BANK	867,200	82.52	71,561,344.00	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	157,388	54.27	8,541,446.76	
BROOKFIELD CORP	651,050	55.12	35,885,876.00	
IGM FINANCIAL INC	39,400	36.24	1,427,856.00	
ONEX CORPORATION	41,700	105.39	4,394,763.00	
TMX GROUP LTD	127,600	33.70	4,300,120.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	10,700	1,337.03	14,306,221.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	133,600	44.10	5,891,760.00	
IA FINANCIAL CORP INC	41,300	91.83	3,792,579.00	
INTACT FINANCIAL CORP	85,200	208.29	17,746,308.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	835,600	29.53	24,675,268.00	
POWER CORP OF CANADA	259,900	39.41	10,242,659.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	272,500	69.11	18,832,475.00	
CGI INC	101,200	147.13	14,889,556.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	9,400	3,661.86	34,421,484.00	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	35,400	121.00	4,283,400.00	
OPEN TEXT CORP	122,700	58.10	7,128,870.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	574,500	108.49	62,327,505.00	
BCE INC	22,600	54.58	1,233,508.00	
QUEBECOR INC -CL B	55,600	32.85	1,826,460.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	175,400	63.63	11,160,702.00	
TELUS CORP	231,200	24.45	5,652,840.00	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	241,500	8.21	1,982,715.00	
ALTAGAS LTD	126,100	28.48	3,591,328.00	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	54,950	38.13	2,095,243.50	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	58,500	31.07	1,817,595.00	
EMERA INC	124,600	48.94	6,097,924.00	
FORTIS INC	246,200	53.64	13,206,168.00	
HYDRO ONE LTD	169,900	39.71	6,746,729.00	

	NORTHLAND POWER INC	103,200	24.92	2,571,744.00
	FIRSTSERVICE CORP	18,100	223.72	4,049,332.00
	カナダドル 小計	19,015,372		1,207,630,662.03 (132,356,320,558)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	111,261	35.92	3,996,495.12
	SANTOS LTD	1,632,935	7.67	12,524,611.45
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	884,097	31.18	27,566,144.46
	BHP GROUP LTD	2,410,339	47.54	114,587,516.06
	BLUESCOPE STEEL LTD	195,782	23.33	4,567,594.06
	FORTESCUE LTD	810,336	28.97	23,475,433.92
	IGO LTD	302,734	7.47	2,261,422.98
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	196,297	55.56	10,906,261.32
	MINERAL RESOURCES LTD	76,336	59.39	4,533,595.04
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	568,880	12.90	7,338,552.00
	ORICA LTD	225,412	16.02	3,611,100.24
	PILBARA MINERALS LTD	1,540,998	3.53	5,439,722.94
	RIO TINTO LTD	173,289	132.63	22,983,320.07
	SOUTH32 LTD	2,068,849	3.35	6,930,644.15
	REECE LTD	81,800	22.40	1,832,320.00
	BRAMBLES LTD	723,076	14.70	10,629,217.20
	COMPUTERSHARE LTD	288,146	25.55	7,362,130.30
	AURIZON HOLDINGS LTD	799,349	3.72	2,973,578.28
	QANTAS AIRWAYS LTD	318,258	5.48	1,744,053.84
	TRANSURBAN GROUP	1,478,983	13.19	19,507,785.77
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	283,649	43.59	12,364,259.91
	IDP EDUCATION LTD	98,033	19.67	1,928,309.11
	LOTTERY CORP LTD/THE	1,165,622	4.88	5,688,235.36
	CAR GROUP LTD	174,947	32.82	5,741,760.54
	REA GROUP LTD	22,035	184.15	4,057,745.25
	SEEK LTD	146,470	25.56	3,743,773.20
	WESFARMERS LTD	530,618	58.45	31,014,622.10
	COLES GROUP LTD	583,356	15.58	9,088,686.48
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	584,671	5.52	3,227,383.92
	WOOLWORTHS GROUP LTD	573,470	36.20	20,759,614.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	311,138	10.29	3,201,610.02	
COCHLEAR LTD	32,214	299.50	9,648,093.00	

	RAMSAY HEALTH CARE LTD	89,028	51.08	4,547,550.24
	SONIC HEALTHCARE LTD	195,410	31.56	6,167,139.60
	CSL LTD	229,497	293.00	67,242,621.00
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	1,389,796	26.67	37,065,859.32
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	795,482	114.86	91,369,062.52
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,448,173	31.79	46,037,419.67
	WESTPAC BANKING CORP	1,621,244	23.70	38,423,482.80
	ASX LTD	89,482	66.17	5,921,023.94
	MACQUARIE GROUP LTD	171,380	186.60	31,979,508.00
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	138,803	33.30	4,622,139.90
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,221,541	5.99	7,317,030.59
	MEDIBANK PRIVATE LTD	1,155,175	3.74	4,320,354.50
	QBE INSURANCE GROUP LTD	722,295	15.79	11,405,038.05
	SUNCORP GROUP LTD	581,731	14.27	8,301,301.37
	WISETECH GLOBAL LTD	85,300	73.21	6,244,813.00
	XERO LTD	63,997	112.54	7,202,222.38
	TELSTRA GROUP LTD	1,847,864	4.00	7,391,456.00
	APA GROUP	737,148	8.20	6,044,613.60
	ORIGIN ENERGY LTD	844,040	8.28	6,988,651.20
	オーストラリアドル 小計	32,820,766		803,826,879.77 (78,156,087,520)
イギリスポンド	BP PLC	8,113,208	4.55	36,967,832.25
	SHELL PLC	3,135,090	23.91	74,960,001.90
	ANGLO AMERICAN PLC	604,877	18.25	11,040,215.00
	ANTOFAGASTA PLC	229,746	16.72	3,841,353.12
	CRH PLC	329,524	55.20	18,189,724.80
	CRODA INTERNATIONAL PLC	61,968	45.17	2,799,094.56
	ENDEAVOUR MINING PLC	64,300	14.33	921,419.00
	GLENCORE PLC	4,862,584	4.16	20,235,643.31
	MONDI PLC	263,786	14.60	3,851,275.60
	RIO TINTO PLC	521,901	54.81	28,605,393.81
	ASHTREAD GROUP PLC	207,593	51.96	10,786,532.28
	BAE SYSTEMS PLC	1,425,756	11.82	16,852,435.92
	BUNZL PLC	171,510	31.47	5,397,419.70
	DCC PLC	56,482	57.10	3,225,122.20
	MELROSE INDUSTRIES PLC	662,878	5.81	3,851,321.18

ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	3,949,490	3.06	12,105,186.85
SMITHS GROUP PLC	140,644	16.50	2,320,626.00
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	35,331	96.22	3,399,548.82
EXPERIAN PLC	430,087	32.41	13,939,119.67
INTERTEK GROUP PLC	82,511	43.84	3,617,282.24
RELX PLC	903,378	32.57	29,423,021.46
RENTOKIL INITIAL PLC	1,238,732	3.92	4,862,023.10
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	519,922	5.34	2,780,542.85
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	65,065	48.05	3,126,373.25
BURBERRY GROUP PLC	144,568	12.78	1,848,301.88
PERSIMMON PLC	151,061	14.61	2,207,756.51
TAYLOR WIMPEY PLC	1,572,933	1.45	2,280,752.85
COMPASS GROUP PLC	796,308	21.44	17,072,843.52
ENTAIN PLC	318,737	9.52	3,035,651.18
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	84,165	160.10	13,474,816.50
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	75,690	74.88	5,667,667.20
PEARSON PLC	322,789	9.60	3,098,774.40
WHITBREAD PLC	109,945	36.01	3,959,119.45
AUTO TRADER GROUP PLC	416,016	7.30	3,036,916.80
INFORMA PLC	633,403	7.67	4,859,467.81
WPP PLC	481,002	7.66	3,684,475.32
JD SPORTS FASHION PLC	969,434	1.16	1,129,390.61
KINGFISHER PLC	1,064,697	2.21	2,361,497.94
NEXT PLC	54,333	84.94	4,615,045.02
OCADO GROUP PLC	232,705	5.68	1,322,229.81
SAINSBURY (J) PLC	864,017	2.81	2,431,343.83
TESCO PLC	3,342,831	2.98	9,988,379.02
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	178,973	23.54	4,213,024.42
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	982,145	22.92	22,515,674.12
COCA-COLA HBC AG-DI	102,274	23.20	2,372,756.80
DIAGEO PLC	1,076,140	27.10	29,163,394.00
IMPERIAL BRANDS PLC	423,171	19.12	8,093,145.37
HALEON PLC	2,594,616	3.12	8,096,499.22
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	333,356	55.28	18,427,919.68
UNILEVER PLC	1,182,265	37.28	44,074,839.20
SMITH & NEPHEW PLC	437,711	10.88	4,762,295.68

	ASTRAZENECA PLC	733,468	104.48	76,632,736.64
	GSK PLC	1,890,903	15.21	28,764,416.43
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	72,292	18.65	1,348,607.26
	BARCLAYS PLC	7,086,269	1.45	10,302,017.87
	HSBC HOLDINGS PLC	9,247,274	6.04	55,936,760.42
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	29,697,870	0.41	12,332,040.51
	NATWEST GROUP PLC	2,737,015	2.17	5,963,955.68
	STANDARD CHARTERED PLC	1,015,012	5.92	6,014,961.11
	3I GROUP PLC	456,215	23.74	10,830,544.10
	ABRDN PLC	805,516	1.71	1,383,070.97
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	123,322	7.43	916,282.46
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	193,266	90.86	17,560,148.76
	M&G PLC	928,249	2.25	2,094,129.74
	SCHRODERS PLC	321,906	4.17	1,342,348.02
	ST JAMES' S PLACE PLC	312,234	6.46	2,018,280.57
	WISE PLC - A	304,193	8.41	2,559,479.90
	ADMIRAL GROUP PLC	117,270	25.10	2,943,477.00
	AVIVA PLC	1,237,039	4.34	5,368,749.26
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,891,619	2.52	7,307,121.21
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	293,906	5.09	1,497,157.16
	PRUDENTIAL PLC	1,293,532	8.34	10,790,643.94
	SAGE GROUP PLC/THE	461,867	11.69	5,401,534.56
	HALMA PLC	162,680	21.65	3,522,022.00
	BT GROUP PLC	2,832,338	1.15	3,265,685.71
	VODAFONE GROUP PLC	11,060,566	0.68	7,534,457.55
	CENTRICA PLC	2,355,857	1.44	3,398,323.72
	NATIONAL GRID PLC	1,699,858	10.26	17,440,543.08
	SEVERN TRENT PLC	124,470	24.98	3,109,260.60
	SSE PLC	513,218	17.39	8,924,861.02
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	366,180	10.26	3,757,006.80
	イギリスポンド 小計	128,357,052		865,153,111.06 (162,320,026,697)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	99,007	11.11	1,099,967.77
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	3,236	647.50	2,095,310.00
	GIVAUDAN-REG	4,314	3,593.00	15,500,202.00
	HOLCIM LTD	241,980	64.24	15,544,795.20

SIG GROUP AG	122,800	18.52	2,274,256.00
SIKA AG-REG	71,276	237.60	16,935,177.60
ABB LTD-REG	777,543	36.58	28,442,522.94
GEBERIT AG-REG	16,014	501.20	8,026,216.80
SCHINDLER HOLDING AG-REG	9,410	203.00	1,910,230.00
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	18,836	211.20	3,978,163.20
VAT GROUP AG	11,903	412.90	4,914,748.70
ADECCO GROUP AG-REG	67,953	36.73	2,495,913.69
SGS SA-REG	79,187	75.06	5,943,776.22
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	25,931	290.10	7,522,583.10
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	252,575	121.00	30,561,575.00
SWATCH GROUP AG/THE-BR	15,105	195.80	2,957,559.00
SWATCH GROUP AG/THE-REG	14,795	37.80	559,251.00
AVOLTA AG	36,100	31.96	1,153,756.00
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1,816	1,245.00	2,260,920.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	401	11,050.00	4,431,050.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	61	110,200.00	6,722,200.00
NESTLE SA-REG	1,261,390	96.20	121,345,718.00
ALCON INC	234,148	66.30	15,524,012.40
SONOVA HOLDING AG-REG	22,022	276.40	6,086,880.80
STRAUMANN HOLDING AG-REG	49,846	130.65	6,512,379.90
BACHEM HOLDING AG	12,632	55.75	704,234.00
LONZA GROUP AG-REG	35,188	370.30	13,030,116.40
NOVARTIS AG-REG	967,334	92.75	89,720,228.50
ROCHE HOLDING AG-BR	17,136	258.40	4,427,942.40
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	329,150	242.00	79,654,300.00
SANDOZ GROUP AG	196,209	28.77	5,644,932.93
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	14,828	109.80	1,628,114.40
JULIUS BAER GROUP LTD	101,083	46.11	4,660,937.13
PARTNERS GROUP HOLDING AG	10,659	1,141.00	12,161,919.00
UBS GROUP AG-REG	1,570,773	25.71	40,384,573.83
BALOISE HOLDING AG - REG	19,933	136.70	2,724,841.10
HELVETIA HOLDING AG-REG	20,883	123.90	2,587,403.70
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	14,049	606.40	8,519,313.60
SWISS RE AG	141,186	98.84	13,954,824.24
ZURICH INSURANCE GROUP AG	69,917	441.80	30,889,330.60

	TEMENOS AG - REG	22,921	86.70	1,987,250.70	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	78,349	74.28	5,819,763.72	
	SWISSCOM AG-REG	12,427	516.00	6,412,332.00	
	BKW AG	9,300	136.30	1,267,590.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	41,126	87.85	3,612,919.10	
	スイスフラン 小計	7,122,732		644,592,032.67 (109,735,347,641)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,304,368	40.20	52,435,593.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	696,000	89.00	61,944,000.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	656,000	7.17	4,703,520.00	
	MTR CORP	706,500	26.20	18,510,300.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	622,000	12.48	7,762,560.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,031,000	40.60	41,858,600.00	
	SANDS CHINA LTD	1,265,600	21.50	27,210,400.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	894,300	11.92	10,660,056.00	
	WH GROUP LTD	3,953,000	4.85	19,172,050.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,548,000	19.22	29,752,560.00	
	HANG SENG BANK LTD	379,500	82.95	31,479,525.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	569,900	245.00	139,625,500.00	
	AIA GROUP LTD	5,538,000	65.05	360,246,900.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	1,589,000	9.45	15,016,050.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	253,000	46.00	11,638,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	706,000	61.95	43,736,700.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	5,821,348	5.62	32,715,975.76	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	675,500	46.00	31,073,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	978,868	35.75	34,994,531.00	
	ESR GROUP LTD	1,052,000	10.28	10,814,560.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	724,000	9.84	7,124,160.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	559,641	21.10	11,808,425.10	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	552,250	10.50	5,798,625.00	
	SINO LAND CO	1,247,400	8.13	10,141,362.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	663,500	76.05	50,459,175.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	221,500	61.80	13,688,700.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	500,800	15.50	7,762,400.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	527,000	23.55	12,410,850.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	639,000	23.00	14,697,000.00	

	香港ドル 小計	35,874,975		1,119,241,078.46 (21,142,463,972)
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	30,200	27.15	819,930.00
	KEPPEL LTD	801,600	6.90	5,531,040.00
	SEATRUM LTD	15,794,803	0.10	1,658,454.31
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	754,200	3.86	2,911,212.00
	SINGAPORE AIRLINES LTD	860,940	6.64	5,716,641.60
	GENTING SINGAPORE LTD	2,772,500	0.97	2,703,187.50
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	897,000	3.32	2,978,040.00
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	839,600	31.92	26,800,032.00
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,669,900	12.90	21,541,710.00
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	593,000	28.15	16,692,950.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	409,000	9.65	3,946,850.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,586,960	2.40	8,608,704.00
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	348,700	5.47	1,907,389.00
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	1,026,100	2.92	2,996,212.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	224,100	6.19	1,387,179.00
UOL GROUP LTD	194,000	6.20	1,202,800.00	
	シンガポールドル 小計	30,802,603		107,402,331.41 (11,832,514,851)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	743,217	8.52	6,332,208.84
	EBOS GROUP LTD	54,700	37.00	2,023,900.00
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	253,197	23.70	6,000,768.90
	SPARK NEW ZEALAND LTD	788,533	5.34	4,214,708.88
	MERCURY NZ LTD	288,052	6.54	1,883,860.08
	MERIDIAN ENERGY LTD	765,945	5.75	4,404,183.75
	ニュージーランドドル 小計	2,893,644		24,859,630.45 (2,242,338,666)
スウェーデンクローネ	BOLIDEN AB	142,133	279.20	39,683,533.60
	HOLMEN AB-B SHARES	33,017	408.10	13,474,237.70
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	304,602	135.50	41,273,571.00
	ALFA LAVAL AB	125,173	372.90	46,677,011.70
	ASSA ABLOY AB-B	472,179	286.80	135,420,937.20
	ATLAS COPCO AB-A SHS	1,246,081	163.90	204,232,675.90
	ATLAS COPCO AB-B SHS	728,300	143.50	104,511,050.00
	BEIJER REF AB	158,800	126.10	20,024,680.00

EPIROC AB-A	337,627	183.75	62,038,961.25	
EPIROC AB-B	163,208	164.50	26,847,716.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	159,232	80.54	12,824,545.28	
INDUTRADE AB	117,500	249.00	29,257,500.00	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	58,459	262.40	15,339,641.60	
LIFCO AB-B SHS	96,300	254.20	24,479,460.00	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	745,899	61.62	45,962,296.38	
SAAB AB-B	28,000	678.80	19,006,400.00	
SANDVIK AB	513,330	220.00	112,932,600.00	
SKANSKA AB-B SHS	145,633	172.95	25,187,227.35	
SKF AB-B SHARES	141,090	200.90	28,344,981.00	
VOLVO AB-A SHS	93,930	257.00	24,140,010.00	
VOLVO AB-B SHS	701,377	250.95	176,010,558.15	
SECURITAS AB-B SHS	235,929	100.95	23,817,032.55	
VOLVO CAR AB-B	207,500	26.76	5,552,700.00	
EVOLUTION AB	92,625	1,217.80	112,798,725.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	296,852	165.76	49,206,187.52	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	262,793	236.80	62,229,382.40	
GETINGE AB-B SHS	85,916	222.80	19,142,084.80	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	93,763	289.20	27,116,259.60	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	801,012	151.85	121,633,672.20	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	699,118	115.60	80,818,040.80	
SWEDBANK AB - A SHARES	427,225	212.60	90,828,035.00	
EQT AB	179,352	277.00	49,680,504.00	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	44,871	327.00	14,672,817.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	89,196	327.20	29,184,931.20	
INVESTOR AB-B SHS	804,042	242.50	194,980,185.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	43,685	536.20	23,423,897.00	
ERICSSON LM-B SHS	1,391,963	60.72	84,519,993.36	
HEXAGON AB-B SHS	1,050,335	115.10	120,893,558.50	
TELE2 AB-B SHS	198,238	87.18	17,282,388.84	
TELIA CO AB	1,284,253	27.00	34,674,831.00	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	296,348	66.96	19,843,462.08	
SAGAX AB-B	105,140	251.00	26,390,140.00	
スウェーデンクローネ 小計	15,202,026		2,416,358,421.96 (34,143,144,502)	

ノルウェークローネ	AKER BP ASA	166,028	277.90	46,139,181.20
	EQUINOR ASA	448,379	298.85	133,998,064.15
	NORSK HYDRO ASA	701,222	61.92	43,419,666.24
	YARA INTERNATIONAL ASA	83,488	344.60	28,769,964.80
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	32,500	533.50	17,338,750.00
	ADEVINTA ASA	106,857	113.00	12,074,841.00
	MOWI ASA	204,936	186.25	38,169,330.00
	ORKLA ASA	312,992	82.82	25,921,997.44
	SALMAR ASA	25,891	580.00	15,016,780.00
	DNB BANK ASA	455,082	214.70	97,706,105.40
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	69,251	172.70	11,959,647.70
	TELENOR ASA	333,379	121.35	40,455,541.65
ノルウェークローネ 小計		2,940,005		510,969,869.58 (7,235,333,353)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	52,601	556.00	29,246,156.00
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	104,436	365.90	38,213,132.40
	ROCKWOOL A/S-B SHS	3,501	1,844.00	6,455,844.00
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	476,792	195.18	93,060,262.56
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	2,050	12,820.00	26,281,000.00
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,814	13,120.00	23,799,680.00
	DSV A/S	87,928	1,240.50	109,074,684.00
	PANDORA A/S	36,319	1,004.00	36,464,276.00
	CARLSBERG AS-B	43,500	875.80	38,097,300.00
	COLOPLAST-B	70,770	770.80	54,549,516.00
	DEMANT A/S	34,228	319.30	10,929,000.40
	GENMAB A/S	31,588	1,925.50	60,822,694.00
	NOVO NORDISK A/S-B	1,543,411	723.90	1,117,275,222.90
	DANSKE BANK A/S	330,101	190.25	62,801,715.25
	TRYG A/S	186,282	148.40	27,644,248.80
ORSTED A/S	94,899	378.90	35,957,231.10	
デンマーククローネ 小計		3,100,220		1,770,671,963.41 (38,034,033,774)
イスラエルシェケル	ICL GROUP LTD	299,785	17.25	5,171,291.25
	ELBIT SYSTEMS LTD	10,169	756.00	7,687,764.00
	BANK HAPOALIM BM	615,641	30.68	18,887,865.88
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	662,777	27.00	17,894,979.00

	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	759,946	17.02	12,934,280.92
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	63,104	130.40	8,228,761.60
	NICE LTD	28,581	814.60	23,282,082.60
	AZRIELI GROUP LTD	14,806	238.70	3,534,192.20
	イスラエルシェケル 小計	2,454,809		97,621,217.45 (3,890,674,097)
ユーロ	ENI SPA	1,100,840	14.56	16,034,835.44
	GALP ENERGIA SGPS SA	199,355	14.08	2,806,918.40
	NESTE OYJ	202,883	31.91	6,473,996.53
	OMV AG	76,362	39.23	2,995,681.26
	REPSOL SA	612,515	13.20	8,085,198.00
	TENARIS SA	206,256	14.97	3,088,683.60
	TOTALENERGIES SE	1,082,543	58.94	63,805,084.42
	AIR LIQUIDE SA	248,333	171.84	42,673,542.72
	AKZO NOBEL N. V.	78,085	70.36	5,494,060.60
	ARCELORMITTAL	211,797	25.32	5,362,700.04
	ARKEMA	35,633	100.85	3,593,588.05
	BASF SE	418,747	44.95	18,824,771.38
	COVESTRO AG	86,995	47.84	4,161,840.80
	DSM-FIRMENICH AG	88,644	95.11	8,430,930.84
	EVONIK INDUSTRIES AG	123,314	17.17	2,117,917.95
	HEIDELBERG MATERIALS AG	64,181	83.66	5,369,382.46
	OCI NV	34,955	25.10	877,370.50
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	112,656	36.25	4,083,780.00
	STORA ENSO OYJ-R SHS	298,391	11.84	3,532,949.44
	SYENSCO SA	42,756	82.16	3,512,832.96
	SYMRISE AG	58,459	95.26	5,568,804.34
	UMICORE	118,677	21.50	2,551,555.50
	UPM-KYMMENE OYJ	271,685	33.51	9,104,164.35
	VOESTALPINE AG	62,408	27.80	1,734,942.40
	WACKER CHEMIE AG	6,600	99.74	658,284.00
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	99,597	39.50	3,934,081.50
	AIRBUS SE	283,106	148.48	42,035,578.88
	ALSTOM	108,862	11.36	1,236,672.32
	BOUYGUES SA	83,366	35.12	2,927,813.92
	BRENTAG SE	71,852	79.20	5,690,678.40

COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	212,659	63.44	13,491,086.96
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	234,394	32.78	7,683,435.32
DASSAULT AVIATION SA	9,266	172.10	1,594,678.60
EIFFAGE	38,587	98.40	3,796,960.80
FERROVIAL SE	265,630	35.08	9,318,300.40
GEA GROUP AG	66,562	36.08	2,401,556.96
IMCD NV	29,880	141.45	4,226,526.00
KINGSPAN GROUP PLC	69,503	74.66	5,189,093.98
KNORR-BREMSE AG	40,814	56.92	2,323,132.88
KONE OYJ-B	163,769	44.73	7,325,387.37
LEGRAND SA	126,050	90.30	11,382,315.00
LEONARDO SPA	188,516	16.40	3,091,662.40
METSO CORP	279,500	9.25	2,586,493.00
MTU AERO ENGINES AG	22,956	218.90	5,025,068.40
PRYSMIAN SPA	139,842	40.55	5,670,593.10
RATIONAL AG	2,060	725.00	1,493,500.00
RHEINMETALL AG	18,567	327.80	6,086,262.60
SAFRAN SA	158,925	171.92	27,322,386.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	260,058	182.70	47,512,596.60
SIEMENS AG-REG	361,904	167.20	60,510,348.80
SIEMENS ENERGY AG	300,754	13.48	4,054,163.92
THALES SA	52,989	135.20	7,164,112.80
VINCI SA	232,766	117.80	27,419,834.80
WARTSILA OYJ ABP	210,609	13.35	2,812,683.19
BUREAU VERITAS SA	155,284	24.40	3,788,929.60
RANDSTAD NV	52,875	52.10	2,754,787.50
TELEPERFORMANCE	29,501	143.75	4,240,768.75
WOLTERS KLUWER	116,141	139.10	16,155,213.10
ADP	17,115	124.00	2,122,260.00
AENA SME SA	33,377	163.05	5,442,119.85
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	227,150	7.77	1,765,864.10
DHL GROUP	460,969	45.27	20,870,371.47
GETLINK SE	172,576	16.21	2,798,319.84
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	149,908	93.69	14,044,880.52
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	27,087	87.75	2,376,884.25
CONTINENTAL AG	51,684	73.10	3,778,100.40

DR ING HC F PORSCHE AG	48,570	73.98	3,593,208.60
FERRARI NV	59,116	306.30	18,107,230.80
MERCEDES-BENZ GROUP AG	373,608	59.75	22,323,078.00
MICHELIN (CGDE)	320,149	31.14	9,969,439.86
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	65,951	45.24	2,983,623.24
RENAULT SA	87,484	34.21	2,992,827.64
STELLANTIS NV	1,035,189	19.42	20,105,440.75
VOLKSWAGEN AG	12,382	124.90	1,546,511.80
VOLKSWAGEN AG-PREF	106,660	114.84	12,248,834.40
ADIDAS AG	76,347	175.68	13,412,640.96
HERMES INTERNATIONAL	15,244	1,844.00	28,109,936.00
KERING	35,172	361.00	12,697,092.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	131,366	685.30	90,025,119.80
MONCLER SPA	104,582	51.86	5,423,622.52
PUMA SE	43,656	37.70	1,645,831.20
SEB SA	9,694	107.40	1,041,135.60
ACCOR SA	103,418	36.77	3,802,679.86
AMADEUS IT GROUP SA	213,500	65.54	13,992,790.00
DELIVERY HERO SE	67,819	23.35	1,583,912.74
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	37,870	37.50	1,420,125.00
SODEXO SA	38,147	100.40	3,829,958.80
BOLLORE SE	416,392	5.90	2,456,712.80
PUBLICIS GROUPE	108,739	91.96	9,999,638.44
SCOUT24 SE	41,543	66.98	2,782,550.14
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	387,646	27.80	10,776,558.80
VIVENDI SE	296,979	10.05	2,984,638.95
D'IETTEREN GROUP	8,226	185.50	1,525,923.00
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	509,506	39.14	19,942,064.84
PROSUS NV	681,830	28.10	19,162,832.15
ZALANDO SE	89,391	18.48	1,651,945.68
CARREFOUR SA	266,829	15.99	4,267,929.85
HELLOFRESH SE	67,988	12.95	880,784.54
JERONIMO MARTINS	116,013	20.78	2,410,750.14
KESKO OYJ-B SHS	133,348	17.08	2,278,250.58
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	473,580	25.79	12,215,996.10
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	402,757	57.20	23,037,700.40

DANONE	299,604	61.10	18,305,804.40
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	367,895	8.98	3,303,697.10
HEINEKEN HOLDING NV	65,661	75.60	4,963,971.60
HEINEKEN NV	135,072	90.72	12,253,731.84
JDE PEET'S NV	53,600	22.26	1,193,136.00
KERRY GROUP PLC-A	67,171	80.40	5,400,548.40
LOTUS BAKERIES	163	7,800.00	1,271,400.00
PERNOD RICARD SA	96,309	145.15	13,979,251.35
REMY COINTREAU	9,646	87.92	848,076.32
BEIERSDORF AG	49,302	133.15	6,564,561.30
HENKEL AG & CO KGAA	57,972	63.52	3,682,381.44
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	74,805	71.50	5,348,557.50
L'OREAL	114,320	432.40	49,431,968.00
AMPLIFON SPA	42,891	29.85	1,280,296.35
BIOMERIEUX	22,555	104.20	2,350,231.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	15,246	98.48	1,501,426.08
DIASORIN SPA	9,103	84.64	770,477.92
ESSILORLUXOTTICA	136,282	178.34	24,304,531.88
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	102,446	36.33	3,721,863.18
FRESENIUS SE & CO KGAA	203,543	26.60	5,414,243.80
KONINKLIJKE PHILIPS NV	348,313	21.19	7,382,494.03
SIEMENS HEALTHINEERS AG	135,148	51.38	6,943,904.24
ARGENX SE	29,300	346.90	10,164,170.00
BAYER AG-REG	462,145	32.62	15,077,480.62
EUROFINS SCIENTIFIC	69,815	56.34	3,933,377.10
GRIFOLS SA	126,564	9.40	1,189,701.60
IPSEN	13,860	107.00	1,483,020.00
MERCK KGAA	63,907	147.10	9,400,719.70
ORION OYJ-CLASS B	50,154	43.78	2,195,742.12
QIAGEN N. V.	109,292	40.58	4,435,069.36
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	42,431	49.98	2,120,701.38
SANOFI	539,583	91.68	49,468,969.44
SARTORIUS AG-VORZUG	12,941	301.90	3,906,887.90
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	13,983	227.50	3,181,132.50
UCB SA	56,484	85.60	4,835,030.40
ABN AMRO BANK NV-CVA	220,601	13.69	3,021,130.69

AIB GROUP PLC	598,464	3.99	2,392,659.07
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,773,197	8.09	22,435,163.73
BANCO BPM SPA	558,757	4.86	2,715,559.02
BANCO SANTANDER SA	7,500,284	3.63	27,226,030.92
BANK OF IRELAND GROUP PLC	523,076	8.20	4,290,269.35
BNP PARIBAS	507,121	61.69	31,284,294.49
CAIXABANK SA	1,977,800	3.83	7,592,774.20
COMMERZBANK AG	473,485	10.54	4,992,899.32
CREDIT AGRICOLE SA	530,480	13.42	7,119,041.60
ERSTE GROUP BANK AG	176,125	39.97	7,039,716.25
FINECOBANK SPA	345,273	13.77	4,754,409.21
ING GROEP NV	1,675,175	13.00	21,783,975.70
INTESA SANPAOLO	7,250,838	2.80	20,360,353.10
KBC GROUP NV	121,247	59.94	7,267,545.18
MEDIOBANCA SPA	227,881	12.07	2,750,523.67
NORDEA BANK ABP	1,484,195	11.47	17,035,590.21
SOCIETE GENERALE SA	349,442	23.57	8,236,347.94
UNICREDIT SPA	748,981	26.52	19,862,976.12
ADYEN NV	10,255	1,147.60	11,768,638.00
AMUNDI SA	42,569	64.15	2,730,801.35
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	914,013	12.08	11,041,277.04
DEUTSCHE BOERSE AG	89,168	185.35	16,527,288.80
EDENRED	121,828	56.62	6,897,901.36
EURAZEO SE	19,619	76.65	1,503,796.35
EURONEXT NV	35,304	81.50	2,877,276.00
EXOR NV	41,814	86.28	3,607,711.92
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	40,261	69.58	2,801,360.38
NEXI SPA	224,714	7.25	1,629,625.92
SOFINA	5,291	222.20	1,175,660.20
WORLDLINE SA	93,323	13.78	1,285,990.94
AEGON LTD	703,492	5.55	3,905,787.58
AGEAS	64,112	39.47	2,530,500.64
ALLIANZ SE-REG	192,387	246.85	47,490,730.95
ASR NEDERLAND NV	90,641	43.45	3,938,351.45
ASSICURAZIONI GENERALI	510,440	20.35	10,387,454.00
AXA SA	825,398	30.75	25,380,988.50

HANNOVER RUECK SE	29,464	223.20	6,576,364.80
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	63,381	396.00	25,098,876.00
NN GROUP NV	133,570	37.69	5,034,253.30
POSTE ITALIANE SPA	269,406	10.27	2,766,799.62
SAMPO OYJ-A SHS	216,081	38.35	8,287,786.75
TALANX AG	40,850	66.35	2,710,397.50
BECHTLE AG	39,938	48.61	1,941,386.18
CAPGEMINI SE	76,299	206.00	15,717,594.00
DASSAULT SYSTEMES SE	314,049	47.75	14,997,409.99
NEMETSCHEK SE	20,683	86.52	1,789,493.16
SAP SE	496,370	160.76	79,796,441.20
NOKIA OYJ	2,388,442	3.50	8,365,518.10
CELLNEX TELECOM SA	270,592	35.15	9,511,308.80
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,496,387	23.24	34,783,515.81
ELISA OYJ	64,406	43.66	2,811,965.96
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	180,053	11.19	2,014,793.07
KONINKLIJKE KPN NV	1,430,285	3.15	4,515,409.74
ORANGE	885,440	11.22	9,939,949.44
TELECOM ITALIA SPA	3,630,827	0.28	1,025,708.62
TELEFONICA SA	2,489,293	3.79	9,446,866.93
ACCIONA SA	13,178	120.60	1,589,266.80
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	19,200	24.14	463,488.00
E.ON SE	1,059,449	12.42	13,158,356.58
EDP RENOVAVEIS SA	131,444	15.39	2,023,580.38
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,417,284	4.20	5,961,096.50
ELIA GROUP SA/NV	10,658	109.00	1,161,722.00
ENAGAS SA	120,868	15.11	1,826,315.48
ENDESA SA	138,773	18.65	2,588,116.45
ENEL SPA	3,753,747	6.29	23,633,591.11
ENGIE	849,060	15.16	12,875,145.84
FORTUM OYJ	180,538	12.61	2,277,486.87
IBERDROLA SA	2,920,996	11.07	32,335,425.72
NATURGY ENERGY GROUP SA	45,200	25.32	1,144,464.00
REDEIA CORP SA	164,909	14.86	2,451,372.28
RWE AG	297,867	36.63	10,910,868.21
SNAM SPA	1,023,585	4.49	4,602,038.16

	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	620,192	7.67	4,759,353.40	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	322,215	29.29	9,437,677.35	
	VERBUND AG	28,497	75.50	2,151,523.50	
	ASM INTERNATIONAL NV	22,765	532.10	12,113,256.50	
	ASML HOLDING NV	190,528	811.80	154,670,630.40	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	37,508	148.85	5,583,065.80	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	608,411	34.64	21,078,399.09	
	STMICROELECTRONICS NV	318,885	42.40	13,522,318.42	
	LEG IMMOBILIEN SE	30,299	74.64	2,261,517.36	
	VONOVIA SE	351,637	27.48	9,662,984.76	
	ユーロ 小計	83,734,837		2,296,244,493.17 (367,789,480,471)	
	合 計	524,454,386		3,915,150,753,773 (3,915,150,753,773)	

(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	79,058	9,757,338.36	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	145,112	5,055,702.08	
		AMERICAN TOWER CORP	222,042	44,455,028.82	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	65,840	11,595,740.80	
		BOSTON PROPERTIES INC	73,566	5,259,969.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	53,715	5,149,119.90	
		CROWN CASTLE INC	200,910	22,262,837.10	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	140,398	19,963,191.62	
		EQUINIX INC	44,658	36,410,113.98	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	76,761	5,093,092.35	
		EQUITY RESIDENTIAL	167,784	9,875,766.24	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	32,716	7,652,926.72	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	98,497	14,659,308.51	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	109,823	5,057,349.15	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	255,134	4,939,394.24	
HOST HOTELS & RESORTS INC	308,081	6,029,145.17			

		INVITATION HOMES INC	287,206	9,552,471.56	
		IRON MOUNTAIN INC	147,169	10,070,774.67	
		KIMCO REALTY CORP	326,157	6,806,896.59	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	56,210	7,418,595.80	
		PROLOGIS INC	441,468	55,713,261.60	
		PUBLIC STORAGE	73,090	21,318,891.20	
		REALTY INCOME CORP	392,395	21,746,530.90	
		REGENCY CENTERS CORP	73,940	4,729,941.80	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	50,841	11,823,074.55	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	150,503	21,496,343.49	
		SUN COMMUNITIES INC	64,459	8,048,350.74	
		UDR INC	153,355	5,602,058.15	
		VENTAS INC	188,835	8,958,332.40	
		VICI PROPERTIES INC	466,185	14,227,966.20	
		WELLTOWER INC	239,095	20,853,865.90	
		WEYERHAEUSER CO	342,960	11,427,427.20	
		WP CAREY INC	102,063	6,477,938.61	
アメリカドル合計			5,630,026	459,488,745.40 (67,866,487,695)	
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	36,100	1,685,148.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	58,600	1,075,310.00	
カナダドル合計			94,700	2,760,458.00 (302,546,196)	
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS/AU	603,939	4,457,069.82	
		GOODMAN GROUP	846,882	21,104,299.44	
		GPT GROUP	891,183	3,930,117.03	
		MIRVAC GROUP	2,214,980	4,629,308.20	
		SCENTRE GROUP	2,622,903	7,606,418.70	
		STOCKLAND	1,030,265	4,461,047.45	
		VICINITY CENTRES	1,843,215	3,594,269.25	
オーストラリアドル合計			10,053,367	49,782,529.89 (4,840,355,381)	
イギリスポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	352,124	2,302,890.96	
		SEGRO PLC	575,702	4,900,375.42	
イギリスポンド合計			927,826	7,203,266.38 (1,351,476,838)	

香港ドル	投資証券	LINK REIT	1,142,000	44,766,400.00	
香港ドル合計			1,142,000	44,766,400.00 (845,637,296)	
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,488,200	4,330,662.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	2,977,171	5,835,255.16	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,470,700	2,294,292.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	1,782,700	2,549,261.00	
シンガポールドル合計			7,718,771	15,009,470.16 (1,653,593,327)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	26,523	1,199,900.52	
		GECINA SA	24,517	2,544,864.60	
		KLEPIERRE	90,686	2,143,817.04	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	64,908	4,367,010.24	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	70,808	1,867,915.04	
ユーロ合計			277,442	12,123,507.44 (1,941,822,186)	
合計				78,801,918,919 (78,801,918,919)	

(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 589 銘柄	97.75%	—	73.77%
	投資証券 33 銘柄	—	2.25%	1.70%
カナダドル	株式 86 銘柄	99.77%	—	3.31%
	投資証券 2 銘柄	—	0.23%	0.01%
オーストラリアドル	株式 51 銘柄	94.17%	—	1.96%
	投資証券 7 銘柄	—	5.83%	0.12%
イギリスポンド	株式 81 銘柄	99.17%	—	4.06%
	投資証券 2 銘柄	—	0.83%	0.03%
スイスフラン	株式 45 銘柄	100.00%	—	2.75%
香港ドル	株式 29 銘柄	96.15%	—	0.53%
	投資証券 1 銘柄	—	3.85%	0.02%
シンガポールドル	株式 16 銘柄	87.74%	—	0.30%
	投資証券 4 銘柄	—	12.26%	0.04%
ニュージーランドドル	株式 6 銘柄	100.00%	—	0.06%

スウェーデンクローネ	株式	42 銘柄	100.00%	—	0.85%
ノルウェークローネ	株式	12 銘柄	100.00%	—	0.18%
デンマーククローネ	株式	16 銘柄	100.00%	—	0.95%
イスラエルシェケル	株式	8 銘柄	100.00%	—	0.10%
ユーロ	株式	220 銘柄	99.47%	—	9.21%
	投資証券	5 銘柄	—	0.53%	0.05%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

新興国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年1月26日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	19,396,038,261
コール・ローン	1,630,072,450
株式	593,681,414,280
投資証券	816,157,511
派生商品評価勘定	99,489,243
未収配当金	698,863,967
差入委託証拠金	4,024,357,627
流動資産合計	620,346,393,339
資産合計	620,346,393,339
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	216,898,654
未払金	1,458,218,177
未払解約金	225,594,314
未払利息	416
流動負債合計	1,900,711,561
負債合計	1,900,711,561
純資産の部	
元本等	
元本	179,683,584,344
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	438,762,097,434
元本等合計	618,445,681,778
純資産合計	618,445,681,778
負債純資産合計	620,346,393,339

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 S W I F T からの除外による取引後の受渡が行えない状況となり、市場でのロシア関連資産の取引が成立しない状況となりました。このため、組入株式の時価については金融商品取引所等における最終相場で評価していますが、当該株式の取引停止等に伴い、取引停止日以降の最終相場の価格が入手できない状況となりました。当該株式のロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引についても、実現が困難な状況となっております。

時価の算定に関する会計基準に基づきますと、組入有価証券に係る時価は秩序ある取引が行われると想定した場合の出口価格である必要があり、上記状況を総合的に勘案した結果、当ファンドが組み入れている当該株式において、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 1 月 26 日現在]
1. 期首	2023 年 1 月 27 日
期首元本額	126,395,162,676 円
期中追加設定元本額	75,059,257,681 円
期中一部解約元本額	21,770,836,013 円
元本の内訳※	
MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信	1,100,156,670 円
eMAXIS 新興国株式インデックス	10,506,528,385 円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,767,483,527 円
eMAXIS バランス（波乗り型）	54,786,673 円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	601,956,890 円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	8,884,890,161 円
eMAXIS Slim 新興国株式インデックス	38,273,046,058 円
つみたて新興国株式	8,304,027,934 円

つみたて8資産均等バランス	4,348,198,825円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	597,226円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,746,946円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	7,336,977円
eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本)	12,070,632,706円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	1,069,741,242円
eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カントリー)	65,102,683,575円
新興国株式インデックス・オープン (ラップ向け)	2,949,018,252円
つみたて全世界株式	226,786,084円
ラップ向けインデックスf 新興国株式	943,928,101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)	1,257,630,099円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	1,000,310,649円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	16,601,657,230円
新興国株式インデックスオープン	434,421,412円
eMAXIS 全世界株式インデックス	1,211,403,025円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	140,834,201円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	35,478,076円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	209,703,466円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	225,272,658円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	933,195,358円
MUAM 全世界株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)	1,086,853,447円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	18,449,234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)	12,122,599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)	47,116,272円
合計	179,683,584,344円
2. 受益権の総数	179,683,584,344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1月27日 至 2024年1月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有してお</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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 1月 26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 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 1月 26日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	12,186,759,164	
投資証券	82,683,756	
合計	12,269,442,920	

(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 1月 26日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	24,932,305,752	—	24,816,223,152	△116,082,600
合計		24,932,305,752	—	24,816,223,152	△116,082,600

(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。

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1月26日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカドル	2,253,155,749	—	2,251,828,938	△1,326,811
合計		2,253,155,749	—	2,251,828,938	△1,326,811

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[2024年1月26日現在]
1口当たり純資産額	3,4419円
(1万口当たり純資産額)	(34,419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	1.71	917,868.00	
	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	14.86	1,936,599.78
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	44,613	83.82	3,739,461.66
UNITED CO RUSAL INTERNATIONAL	1,071,810	—	—
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	257,421	17.24	4,437,938.04
NIO INC - ADR	840,560	6.04	5,076,982.40
H WORLD GROUP LTD-ADR	113,799	33.77	3,842,992.23
TAL EDUCATION GROUP- ADR	267,204	11.94	3,190,415.76
YUM CHINA HOLDINGS INC	247,154	35.64	8,808,568.56
AUTOHOME INC-ADR	38,791	25.00	969,775.00
IQIYI INC-ADR	241,668	3.58	865,171.44
JOYY INC-ADR	22,862	31.59	722,210.58
KANZHUN LTD - ADR	114,579	14.13	1,619,001.27
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	454,971	8.91	4,053,791.61
WEIBO CORP-SPON ADR	33,274	8.52	283,494.48
YANDEX NV-A	92,564	—	—
OZON HOLDINGS PLC - ADR	20,405	—	—
PDD HOLDINGS INC	352,077	144.43	50,850,481.11
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	210,499	15.95	3,357,459.05
MAGNIT PJSC	23,556	—	—
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	34,286	—	—
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	39,400	58.13	2,290,322.00
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	2,642,213	1.09	2,880,012.17
CREDICORP LTD	41,945	148.93	6,246,868.85
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	796,628	—	—
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	38,258	—	—
VTB BANK PJSC	1,305,990,000	—	—
LUFAX HOLDING LTD-ADR	112,919	2.52	284,555.88
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	425,170	—	—

	QIFU TECHNOLOGY INC	54,200	14.84	804,328.00
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	320,772	2.05	659,507.23
	VK IPJSC	34,689	—	—
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	172,850	—	—
	INTER RAO UES PJSC	12,239,000	—	—
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	30,320	19.66	596,091.20
	KE HOLDINGS INC-ADR	393,483	14.43	5,677,959.69
	アメリカドル 小計	1,339,365,397		114,111,855.99 (16,854,321,129)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	1,149,000	8.57	9,846,930.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	1,104,000	7.28	8,037,120.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	14,700,000	4.14	60,858,000.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1,996,000	29.55	58,981,800.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	628,000	7.98	5,011,440.00
	PETROCHINA CO LTD-H	14,125,000	5.67	80,088,750.00
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	1,301,000	16.36	21,284,360.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	2,018,000	3.85	7,769,300.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	628,000	16.24	10,198,720.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1,420,500	5.90	8,380,950.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	2,036,000	2.95	6,006,200.00
	CMOC GROUP LTD-H	2,154,000	4.41	9,499,140.00
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H	185,120	24.60	4,553,952.00
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	679,000	11.36	7,713,440.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	722,000	3.08	2,223,760.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	465,250	11.84	5,508,560.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	660,000	8.04	5,306,400.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	3,256,000	12.36	40,244,160.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	1,247,000	3.06	3,815,820.00
	BOC AVIATION LTD	97,300	59.40	5,779,620.00
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	1,132,000	3.24	3,667,680.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	2,285,000	3.67	8,385,950.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	570,000	8.60	4,902,000.00
	CITIC LTD	3,377,000	7.46	25,192,420.00
	CRRC CORP LTD - H	2,519,000	3.65	9,194,350.00
	FOSUN INTERNATIONAL LTD	1,324,500	4.42	5,854,290.00
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	339,000	17.22	5,837,580.00

SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	537,000	5.61	3,012,570.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	316,000	17.24	5,447,840.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	982,800	14.10	13,857,480.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	268,300	20.70	5,553,810.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	1,958,111	2.77	5,423,967.47
AIR CHINA LTD-H	1,220,000	4.71	5,746,200.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	788,000	10.28	8,100,640.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1,190,000	3.17	3,772,300.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	1,515,600	8.38	12,700,728.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	654,000	5.55	3,629,700.00
JD LOGISTICS INC	1,037,800	7.76	8,053,328.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	806,000	7.76	6,254,560.00
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	68,000	118.00	8,024,000.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	1,034,000	5.98	6,183,320.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1,694,000	4.45	7,538,300.00
BYD CO LTD-H	646,000	198.40	128,166,400.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	1,236,000	3.19	3,942,840.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	319,200	36.00	11,491,200.00
GEEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	3,323,000	7.94	26,384,620.00
GREAT WALL MOTOR CO LTD-H	1,278,000	8.50	10,863,000.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	1,458,945	3.29	4,799,929.05
LI AUTO INC-CLASS A	686,044	111.30	76,356,697.20
MINH GROUP LTD	364,000	12.16	4,426,240.00
XPENG INC - CLASS A SHARES	662,824	35.95	23,828,522.80
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	604,000	11.72	7,078,880.00
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	289,400	21.65	6,265,510.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	890,800	70.65	62,935,020.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	2,144,000	3.66	7,847,040.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	1,487,000	22.40	33,308,800.00
LI NING CO LTD	1,506,500	17.30	26,062,450.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	502,400	73.00	36,675,200.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	876,500	4.15	3,637,475.00
EAST BUY HOLDING LTD	237,500	24.20	5,747,500.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	879,000	13.56	11,919,240.00
MEITUAN-CLASS B	2,971,220	69.40	206,202,668.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	889,780	62.50	55,611,250.00

TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	630,000	16.64	10,483,200.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	548,000	8.64	4,734,720.00
TRIP.COM GROUP LTD	344,229	290.20	99,895,255.80
BAIDU INC-CLASS A	1,362,674	106.80	145,533,583.20
BILIBILI INC-CLASS Z	101,435	77.80	7,891,643.00
CHINA LITERATURE LTD	220,600	27.30	6,022,380.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	2,556,000	1.60	4,089,600.00
KINGSOFT CORP LTD	568,000	20.75	11,786,000.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	1,403,000	44.60	62,573,800.00
NETEASE INC	1,146,895	161.50	185,223,542.50
TENCENT HOLDINGS LTD	3,933,700	290.80	1,143,919,960.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9,602,200	73.35	704,321,370.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	62,300	75.40	4,697,420.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	1,037,600	11.40	11,828,640.00
JD.COM INC-CLASS A	1,411,533	93.50	131,978,335.50
MINISO GROUP HOLDING LTD	187,832	39.55	7,428,755.60
POP MART INTERNATIONAL GROUP	231,000	19.04	4,398,240.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	970,000	5.32	5,160,400.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	638,500	15.28	9,756,280.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	2,846,000	3.26	9,277,960.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	702,550	29.15	20,479,332.50
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	308,400	13.60	4,194,240.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	66,063	104.53	6,905,565.39
CHINA FEIHE LTD	2,716,000	3.84	10,429,440.00
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS	372,000	—	—
CHINA MENGNIU DAIRY CO	1,996,000	17.26	34,450,960.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	1,016,000	30.15	30,632,400.00
NONGFU SPRING CO LTD-H	1,184,000	42.15	49,905,600.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	1,128,000	5.67	6,395,760.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	1,138,000	7.62	8,671,560.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	350,000	45.55	15,942,500.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	1,231,000	4.62	5,687,220.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	2,514,000	4.41	11,086,740.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	483,000	25.15	12,147,450.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	175,000	23.05	4,033,750.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	170,600	29.00	4,947,400.00

MICROPORT SCIENTIFIC CORP	459,800	6.41	2,947,318.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1,232,000	5.66	6,973,120.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	265,300	11.66	3,093,398.00
SINOPHARM GROUP CO-H	728,800	20.00	14,576,000.00
3SBIO INC	1,073,500	6.05	6,494,675.00
AKESO INC	274,000	44.10	12,083,400.00
BEIGENE LTD	419,623	96.65	40,556,562.95
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	781,000	12.08	9,434,480.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	847,500	5.04	4,271,400.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	1,486,000	3.04	4,517,440.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	5,445,840	6.10	33,219,624.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	628,000	16.52	10,374,560.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	696,000	12.46	8,672,160.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	744,000	36.00	26,784,000.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	240,500	14.84	3,569,020.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	6,275,500	2.94	18,449,970.00
WUXI APPTEC CO LTD-H	196,040	77.30	15,153,892.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2,297,500	30.00	68,925,000.00
ZAI LAB LTD	534,210	17.82	9,519,622.20
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	15,072,000	3.04	45,818,880.00
BANK OF CHINA LTD-H	48,864,000	2.99	146,103,360.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	4,902,900	4.68	22,945,572.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	4,673,000	3.84	17,944,320.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	57,581,550	4.66	268,330,023.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	1,464,000	2.33	3,411,120.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	2,095,050	28.85	60,442,192.50
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	3,850,820	2.64	10,166,164.80
IND & COMM BK OF CHINA-H	39,911,350	3.83	152,860,470.50
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	4,414,000	3.79	16,729,060.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	5,572,000	0.77	4,290,440.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	1,749,000	4.02	7,030,980.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	768,000	10.08	7,741,440.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	1,676,500	16.16	27,092,240.00
FAR EAST HORIZON LTD	1,246,000	6.11	7,613,060.00
GF SECURITIES CO LTD-H	442,400	8.37	3,702,888.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	1,531,200	3.91	5,986,992.00

HUATAI SECURITIES CO LTD-H	574,200	10.04	5,764,968.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	4,462,000	9.36	41,764,320.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	1,463,800	15.10	22,103,380.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	723,200	6.72	4,859,904.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	445,900	14.52	6,474,468.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	4,392,000	2.54	11,155,680.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	4,140,000	9.95	41,193,000.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	4,004,000	34.60	138,538,400.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	422,100	13.96	5,892,516.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	1,324,000	5.13	6,792,120.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	571,276	5.96	3,404,804.96
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	1,487,000	9.23	13,725,010.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	383,500	20.25	7,765,875.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	439,000	30.25	13,279,750.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	409,000	15.28	6,249,520.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	449,500	5.45	2,449,775.00
LENOVO GROUP LTD	4,414,000	10.26	45,287,640.00
SUNNY OPTICAL TECH	390,200	60.05	23,431,510.00
XIAOMI CORP-CLASS B	9,141,800	13.74	125,608,332.00
ZTE CORP-H	409,531	15.06	6,167,536.86
CHINA TOWER CORP LTD-H	26,118,000	0.77	20,110,860.00
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	288,500	29.00	8,366,500.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	1,930,000	1.96	3,782,800.00
CGN POWER CO LTD-H	5,163,000	2.24	11,565,120.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,904,200	7.55	14,376,710.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	1,903,000	5.02	9,553,060.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	2,292,000	3.04	6,967,680.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	617,000	23.75	14,653,750.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	1,110,000	16.04	17,804,400.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	450,000	62.05	27,922,500.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD	2,154,000	5.88	12,665,520.00
HUANENG POWER INTL INC-H	2,348,000	4.53	10,636,440.00
KUNLUN ENERGY CO LTD	1,992,000	7.00	13,944,000.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	146,000	14.02	2,046,920.00
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	14,212,000	1.07	15,206,840.00
HANERGY THIN FILM POWER GROU	960,000	3.91	3,753,600.00

	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	382,000	17.00	6,494,000.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	3,406,000	3.96	13,487,760.00	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	434,000	13.66	5,928,440.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	2,089,500	12.22	25,533,690.00	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	610,000	5.18	3,159,800.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	2,250,000	24.30	54,675,000.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	423,800	23.45	9,938,110.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	1,072,551	6.50	6,971,581.50	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	5,470,232	0.72	3,938,567.04	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	1,239,000	5.76	7,136,640.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	525,500	6.40	3,363,200.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	1,011,000	9.61	9,715,710.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	800,000	5.08	4,064,000.00	
	香港ドル 小計	488,577,678		6,065,399,474.32 (114,575,396,069)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	1,972,480	1.86	3,668,812.80	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	149,300	21.38	3,192,034.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	1,815,500	6.75	12,254,625.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	2,265,100	4.85	10,985,735.00	
	GAMUDA BHD	1,012,100	4.96	5,020,016.00	
	SIME DARBY BERHAD	1,697,300	2.50	4,243,250.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	554,900	7.61	4,222,789.00	
	MISC BHD	744,800	7.32	5,451,936.00	
	GENTING BHD	1,154,400	4.70	5,425,680.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	1,757,300	2.69	4,727,137.00	
	MR DIY GROUP M BHD	1,949,000	1.43	2,787,070.00	
	IOI CORP BHD	1,440,600	4.01	5,776,806.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	337,100	22.70	7,652,170.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	39,900	119.50	4,768,050.00	
	PPB GROUP BERHAD	371,240	14.72	5,464,652.80	
	QL RESOURCES BHD	521,250	5.86	3,054,525.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	967,000	4.38	4,235,460.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	1,220,300	6.07	7,407,221.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	1,376,300	4.25	5,849,275.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	3,586,000	6.12	21,946,320.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	366,400	19.18	7,027,552.00	

	MALAYAN BANKING BHD	3,414,700	9.10	31,073,770.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	8,440,900	4.37	36,886,733.00	
	RHB BANK BHD	1,098,049	5.61	6,160,054.89	
	AXIATA GROUP BERHAD	1,195,000	2.63	3,142,850.00	
	CELCOMDIGI BHD	1,763,800	4.25	7,496,150.00	
	MAXIS BHD	1,122,400	3.82	4,287,568.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	653,000	5.92	3,865,760.00	
	PETRONAS GAS BHD	447,000	17.64	7,885,080.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	1,554,000	10.52	16,348,080.00	
	INARI AMERTRON BHD	1,618,200	3.21	5,194,422.00	
	マレーシアリングット 小計	46,605,319		257,501,584.49 (8,024,727,878)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	5,993,000	6.50	38,954,500.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	873,500	149.50	130,588,250.00	
	PTT PCL-NVDR	5,421,900	34.25	185,700,075.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	757,900	53.25	40,358,175.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	787,000	24.30	19,124,100.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	2,231,461	34.50	76,985,404.50	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	561,600	31.75	17,830,800.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	439,550	267.00	117,359,850.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	3,107,700	59.75	185,685,075.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	3,539,400	7.40	26,191,560.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	4,492,200	6.75	30,322,350.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	3,667,900	3.88	14,231,452.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,806,900	29.50	53,303,550.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	955,517	34.75	33,204,215.75	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	9,757,701	10.80	105,383,170.80	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	1,787,200	18.30	32,705,760.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	593,600	24.30	14,424,480.00	
	CP ALL PCL-NVDR	3,206,400	53.00	169,939,200.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	1,119,100	29.25	32,733,675.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,996,400	18.00	35,935,200.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	931,700	21.60	20,124,720.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	6,214,800	27.75	172,460,700.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	318,900	240.00	76,536,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	304,300	123.00	37,428,900.00	

	KRUNG THAI BANK - NVDR	1,770,600	16.30	28,860,780.00	
	SCB X PCL-NVDR	472,000	106.00	50,032,000.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	12,000,000	1.80	21,600,000.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	493,000	44.00	21,692,000.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	402,800	41.75	16,816,900.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	1,742,200	82.50	143,731,500.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	690,100	218.00	150,441,800.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	513,100	73.75	37,841,125.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	5,276,828	5.95	31,397,126.60	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	943,600	38.25	36,092,700.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	372,600	49.00	18,257,400.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	1,556,200	43.75	68,083,750.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	1,146,200	65.25	74,789,550.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	5,245,100	7.70	40,387,270.00	
	タイパーツ 小計	93,489,957		2,407,535,064.65 (9,967,195,167)	
フィリピンペン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	924,980	49.10	45,416,518.00	
	AYALA CORPORATION	129,305	680.00	87,927,400.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	1,371,849	38.05	52,198,854.45	
	SM INVESTMENTS CORP	150,555	904.00	136,101,720.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	640,250	241.00	154,300,250.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	261,310	270.20	70,605,962.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	536,200	114.80	61,555,760.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	1,250,397	111.20	139,044,146.40	
	BDO UNIBANK INC	1,344,416	143.90	193,461,462.40	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	1,349,456	57.50	77,593,720.00	
	PLDT INC	35,425	1,288.00	45,627,400.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	169,260	380.00	64,318,800.00	
	AYALA LAND INC	4,129,620	34.15	141,026,523.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	5,640,100	33.60	189,507,360.00	
	フィリピンペン 小計	17,933,123		1,458,685,876.25 (3,809,504,034)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	9,845,800	2,360.00	23,236,088,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	821,600	23,125.00	18,999,500,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	3,732,100	7,525.00	28,084,052,500.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	3,302,400	1,555.00	5,135,232,000.00	

	BARITO PACIFIC TBK PT	13,337,270	1,065.00	14,204,192,550.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	1,329,300	7,600.00	10,102,680,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	4,827,300	2,760.00	13,323,348,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	1,836,700	6,150.00	11,295,705,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	11,331,300	5,050.00	57,223,065,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	475,281,400	84.00	39,923,637,600.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	10,376,500	2,670.00	27,705,255,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	4,136,800	4,590.00	18,987,912,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	1,153,300	11,400.00	13,147,620,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	2,112,200	6,400.00	13,518,080,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	4,456,700	3,160.00	14,083,172,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	11,171,100	1,575.00	17,594,482,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	32,283,300	9,500.00	306,691,350,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	21,884,900	6,275.00	137,327,747,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	13,768,700	5,400.00	74,350,980,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	40,004,500	5,525.00	221,024,862,500.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	11,186,200	920.00	10,291,304,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	29,076,600	3,980.00	115,724,868,000.00	
	インドネシアルピア 小計	707,255,970		1,191,975,134,150.00 (11,204,566,261)	
メキシコペン	CEMEX SAB-CPO	8,314,268	13.99	116,316,609.32	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	1,820,770	87.83	159,918,229.10	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	102,805	220.21	22,638,689.05	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	673,098	33.58	22,602,630.84	
	ALFA S. A. B. -A	1,531,900	13.14	20,129,166.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	301,200	161.24	48,565,488.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	224,200	266.28	59,699,976.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	175,290	491.67	86,184,834.30	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	183,300	156.23	28,636,959.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	106,465	169.74	18,071,369.10	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	3,227,100	69.21	223,347,591.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	263,866	183.57	48,437,881.62	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	270,100	156.66	42,313,866.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	1,183,600	233.01	275,790,636.00	
	GRUMA S. A. B. -B	108,475	305.54	33,143,451.50	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	682,000	77.10	52,582,200.00	

	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	819,500	37.79	30,968,905.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	469,600	63.60	29,866,560.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	1,621,600	169.42	274,731,472.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	991,400	48.50	48,082,900.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER B	10,735,400	15.31	164,358,974.00	
	メキシコペソ 小計	33,805,937		1,806,388,387.83 (15,512,360,280)	
ブラジルリアル	COSAN SA	655,100	18.46	12,093,146.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	2,253,400	41.06	92,524,604.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	2,752,500	39.28	108,118,200.00	
	PRIIO SA	483,200	44.80	21,647,360.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	394,700	27.95	11,031,865.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	421,200	17.92	7,547,904.00	
	GERDAU SA-PREF	663,000	21.78	14,440,140.00	
	KLABIN SA - UNIT	397,200	21.78	8,651,016.00	
	SUZANO SA	472,422	51.85	24,495,080.70	
	VALE SA	2,000,529	68.36	136,756,162.44	
	WEG SA	991,388	33.25	32,963,651.00	
	CCR SA	527,800	13.31	7,025,018.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	509,713	58.36	29,746,850.68	
	RUMO SA	1,023,000	22.45	22,966,350.00	
	LOJAS RENNEN S. A.	503,122	16.15	8,125,420.30	
	MAGAZINE LUIZA SA	1,497,500	2.07	3,099,825.00	
	VIBRA ENERGIA SA	653,400	23.34	15,250,356.00	
	ATACADA0 SA	343,900	10.98	3,776,022.00	
	RAIA DROGASIL SA	755,812	26.00	19,651,112.00	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	832,500	14.00	11,655,000.00	
	AMBEV SA	2,716,700	13.20	35,860,440.00	
	JBS SA	399,800	24.20	9,675,160.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	525,900	16.20	8,519,580.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	2,830,971	4.01	11,352,193.71	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	340,500	27.17	9,251,385.00	
	HYPERA SA	205,800	31.59	6,501,222.00	
	BANCO BRADESCO S. A.	1,313,437	13.70	17,994,086.90	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	2,930,386	15.36	45,010,728.96	
	BANCO DO BRASIL S. A.	502,500	56.58	28,431,450.00	

	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	177,400	29.18	5,176,532.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	2,902,230	32.33	93,829,095.90	
	ITAUSA SA	3,020,162	9.94	30,020,410.28	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	3,789,225	13.43	50,889,291.75	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	662,700	37.00	24,519,900.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	368,000	33.74	12,416,320.00	
	TOTVS SA	313,600	30.90	9,690,240.00	
	TELEFONICA BRASIL S. A.	219,375	50.75	11,133,281.25	
	TIM SA	494,977	17.39	8,607,650.03	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	142,400	46.13	6,568,912.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	717,100	41.13	29,494,323.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	721,390	11.66	8,411,407.40	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	184,700	77.09	14,238,523.00	
	COMPANHIA PARANAENSE -PREF B	616,900	10.05	6,199,845.00	
	CPFL ENERGIA SA	104,700	36.36	3,806,892.00	
	ENERGISA SA-UNITS	120,400	50.09	6,030,836.00	
	ENEVA SA	483,000	12.90	6,230,700.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	96,550	41.23	3,980,756.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	811,400	34.85	28,277,290.00	
	ブラジルリアル 小計	45,843,589		1,123,683,535.80 (33,725,113,959)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	231,184	6,050.00	1,398,663,200.00	
	EMPRESAS CMPC SA	544,129	1,600.00	870,606,400.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	80,619	42,755.00	3,446,865,345.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	11,707,800	69.98	819,311,844.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	103,210,400	11.15	1,150,795,960.00	
	FALABELLA SA	447,714	2,110.00	944,676,540.00	
	CENCOSUD SA	686,091	1,575.00	1,080,593,325.00	
	BANCO DE CHILE	29,371,536	101.25	2,973,868,020.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	51,686	24,000.00	1,240,464,000.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	34,054,503	42.41	1,444,251,472.00	
	ENEL AMERICAS SA	14,141,398	95.15	1,345,554,019.00	
	ENEL CHILE SA	13,798,839	54.40	750,656,841.00	
	チリペソ 小計	208,325,899		17,466,306,966.00 (2,834,344,962)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	23,432	67,400.00	1,579,316,800.00	

S-OIL CORP	32,311	67,000.00	2,164,837,000.00	
SK INNOVATION CO LTD	33,880	112,100.00	3,797,948,000.00	
HANWHA SOLUTIONS CORP	65,451	32,950.00	2,156,610,450.00	
HYUNDAI STEEL CO	47,819	33,800.00	1,616,282,200.00	
KOREA ZINC CO LTD	5,353	460,500.00	2,465,056,500.00	
KUM YANG CO LTD	18,000	75,100.00	1,351,800,000.00	
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	8,081	116,400.00	940,628,400.00	
LG CHEM LTD	31,597	404,500.00	12,780,986,500.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	4,322	262,000.00	1,132,364,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	9,469	136,900.00	1,296,306,100.00	
POSCO HOLDINGS INC	44,104	400,000.00	17,641,600,000.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	17,800	78,900.00	1,404,420,000.00	
SKC CO LTD	8,074	74,000.00	597,476,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	32,378	46,500.00	1,505,577,000.00	
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	276,499	14,870.00	4,111,540,130.00	
ECOPRO BM CO LTD	29,449	227,000.00	6,684,923,000.00	
ECOPRO CO LTD	12,018	490,500.00	5,894,829,000.00	
GS HOLDINGS	27,669	41,650.00	1,152,413,850.00	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	18,394	140,500.00	2,584,357,000.00	
HANWHA OCEAN CO LTD	37,899	22,200.00	841,357,800.00	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	12,400	119,900.00	1,486,760,000.00	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	22,448	115,900.00	2,601,723,200.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	43,467	32,050.00	1,393,117,350.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	17,626	70,400.00	1,240,870,400.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	41,812	53,800.00	2,249,485,600.00	
L&F CO LTD	16,089	157,500.00	2,534,017,500.00	
LG CORP	53,468	73,600.00	3,935,244,800.00	
LG ENERGY SOLUTION	30,392	368,000.00	11,184,256,000.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	17,614	251,000.00	4,421,114,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	26,266	48,900.00	1,284,407,400.00	
SAMSUNG C&T CORP	45,199	119,700.00	5,410,320,300.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	83,943	24,450.00	2,052,406,350.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	354,731	7,570.00	2,685,313,670.00	
SK INC	18,812	160,800.00	3,024,969,600.00	
SK SQUARE CO LTD	49,040	49,850.00	2,444,644,000.00	
HMM CO LTD	132,330	20,000.00	2,646,600,000.00	

HYUNDAI GLOVIS CO LTD	11,173	170,700.00	1,907,231,100.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	107,148	22,500.00	2,410,830,000.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	43,655	49,450.00	2,158,739,750.00	
HANON SYSTEMS	106,991	6,190.00	662,274,290.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	36,173	209,500.00	7,578,243,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	92,825	188,700.00	17,516,077,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	17,752	112,800.00	2,002,425,600.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	10,895	112,000.00	1,220,240,000.00	
KIA CORP	154,327	93,000.00	14,352,411,000.00	
COWAY CO LTD	30,042	57,000.00	1,712,394,000.00	
F&F CO LTD / NEW	9,200	71,600.00	658,720,000.00	
LG ELECTRONICS INC	58,937	94,000.00	5,540,078,000.00	
KANGWON LAND INC	47,178	15,110.00	712,859,580.00	
HYBE CO LTD	11,933	216,000.00	2,577,528,000.00	
JYP ENTERTAINMENT CORP	14,500	82,000.00	1,189,000,000.00	
KAKAO CORP	186,958	56,000.00	10,469,648,000.00	
KRAFTON INC	15,766	207,000.00	3,263,562,000.00	
NAVER CORP	80,161	213,500.00	17,114,373,500.00	
NCSOFT CORP	7,497	192,600.00	1,443,922,200.00	
NETMARBLE CORP	12,296	55,400.00	681,198,400.00	
PEARL ABYSS CORP	17,435	33,700.00	587,559,500.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	17,981	59,500.00	1,069,869,500.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	3,867	284,500.00	1,100,161,500.00	
KT&G CORP	57,530	87,900.00	5,056,887,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	12,195	92,700.00	1,130,476,500.00	
AMOREPACIFIC CORP	14,756	139,500.00	2,058,462,000.00	
LG H&H	5,202	315,000.00	1,638,630,000.00	
HLB INC	67,462	54,700.00	3,690,171,400.00	
CELLTRION INC	91,959	182,000.00	16,736,538,000.00	
CELLTRION PHARM INC	10,459	103,000.00	1,077,277,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	3,690	332,000.00	1,225,080,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	12,838	785,000.00	10,077,830,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	17,376	89,300.00	1,551,676,800.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	14,700	63,600.00	934,920,000.00	
YUHAN CORP	30,223	60,200.00	1,819,424,600.00	
HANA FINANCIAL GROUP	177,231	43,750.00	7,753,856,250.00	

	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	137,043	11,890.00	1,629,441,270.00	
	KAKAOBANK CORP	103,900	29,250.00	3,039,075,000.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	227,235	52,900.00	12,020,731,500.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	261,996	39,650.00	10,388,141,400.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	346,472	13,030.00	4,514,530,160.00	
	KAKAOPAY CORP	11,248	51,500.00	579,272,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	20,102	58,200.00	1,169,936,400.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	55,690	62,300.00	3,469,487,000.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	119,622	7,140.00	854,101,080.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	60,045	10,110.00	607,054,950.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	36,061	35,850.00	1,292,786,850.00	
	DB INSURANCE CO LTD	26,050	80,600.00	2,099,630,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	17,515	241,000.00	4,221,115,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	48,282	63,800.00	3,080,391,600.00	
	POSCO DX CO LTD	30,200	54,000.00	1,630,800,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	24,444	157,400.00	3,847,485,600.00	
	COSMOAM&T CO LTD	12,657	129,900.00	1,644,144,300.00	
	LG DISPLAY CO LTD	119,043	12,310.00	1,465,419,330.00	
	LG INNOTEK CO LTD	7,648	207,000.00	1,583,136,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	34,488	144,600.00	4,986,964,800.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2,813,078	74,100.00	208,449,079,800.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	489,577	59,900.00	29,325,662,300.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	35,148	347,500.00	12,213,930,000.00	
	KT CORP	30,000	34,200.00	1,026,000,000.00	
	LG UPLUS CORP	107,515	9,970.00	1,071,924,550.00	
	SK TELECOM	31,200	49,400.00	1,541,280,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	145,027	19,160.00	2,778,717,320.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	22,700	57,700.00	1,309,790,000.00	
	SK HYNIX INC	322,545	137,400.00	44,317,683,000.00	
	韓国ウォン 小計	9,056,478		643,134,167,580.00 (71,130,638,934)	
ニュー台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	597,150	73.20	43,711,380.00	
	ASIA CEMENT CORP	1,312,281	40.00	52,491,240.00	
	CHINA STEEL CORP	7,062,947	25.10	177,279,969.70	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	1,926,430	56.60	109,035,938.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	2,802,600	71.70	200,946,420.00	

NAN YA PLASTICS CORP	2,815,557	60.50	170,341,198.50
TAIWAN CEMENT	4,058,696	32.70	132,719,359.20
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	75,000	974.00	73,050,000.00
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	1,512,138	30.85	46,649,457.30
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	38,000	1,350.00	51,300,000.00
WALSIN LIHWA CORP	1,629,000	35.95	58,562,550.00
CHINA AIRLINES LTD	1,582,000	20.50	32,431,000.00
EVA AIRWAYS CORP	1,334,000	30.75	41,020,500.00
EVERGREEN MARINE CORP LTD	563,353	151.50	85,347,979.50
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	1,077,000	29.60	31,879,200.00
WAN HAI LINES LTD	322,845	49.75	16,061,538.75
YANG MING MARINE TRANSPORT	1,065,000	49.25	52,451,250.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,145,413	44.35	50,799,066.55
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	100,728	552.00	55,601,856.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	344,098	163.00	56,087,974.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	132,000	334.50	44,154,000.00
POU CHEN	1,066,500	31.15	33,221,475.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	181,880	635.00	115,493,800.00
MOMO.COM INC	53,560	450.00	24,102,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	295,000	266.50	78,617,500.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	2,828,624	71.70	202,812,340.80
PHARMAESSENTIA CORP	136,000	321.00	43,656,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	2,858,387	17.30	49,450,095.10
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	10,281,955	28.15	289,437,033.25
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	8,241,067	24.65	203,142,301.55
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	5,928,648	26.65	157,998,469.20
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	5,228,109	21.40	111,881,532.60
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	7,646,703	37.80	289,045,373.40
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	5,945,405	18.95	112,665,424.75
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	8,862,716	17.20	152,438,715.20
TAIWAN BUSINESS BANK	3,048,448	13.30	40,544,358.40
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	5,564,572	25.50	141,896,586.00
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	2,159,000	44.30	95,643,700.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	918,275	179.50	164,830,362.50
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	5,647,117	26.75	151,060,379.75
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	5,416,366	44.35	240,215,832.10

CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	9,177,255	12.10	111,044,785.50
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	5,158,556	64.60	333,242,717.60
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	6,948,852	8.57	59,551,661.64
ACCTON TECHNOLOGY CORP	280,000	513.00	143,640,000.00
ACER INC	1,664,168	47.60	79,214,396.80
ADVANTECH CO LTD	288,020	336.00	96,774,720.00
ASUSTEK COMPUTER INC	424,774	458.00	194,546,492.00
AUO CORP	4,165,800	18.95	78,941,910.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	306,000	196.00	59,976,000.00
COMPAL ELECTRONICS	2,349,775	37.20	87,411,630.00
DELTA ELECTRONICS INC	1,268,220	284.00	360,174,480.00
E INK HOLDINGS INC	517,000	200.50	103,658,500.00
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	275,000	292.00	80,300,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	7,395,272	102.00	754,317,744.00
INNOLUX CORP	5,345,461	16.80	89,803,744.80
INVENTEC CORP	1,536,429	56.20	86,347,309.80
LARGAN PRECISION CO LTD	59,820	2,550.00	152,541,000.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,131,160	111.00	125,558,760.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	432,000	185.00	79,920,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	114,000	224.50	25,593,000.00
PEGATRON CORP	1,231,976	84.20	103,732,379.20
QUANTA COMPUTER INC	1,611,150	249.00	401,176,350.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	631,193	72.70	45,887,731.10
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	760,000	175.50	133,380,000.00
WISTRON CORP	1,576,000	115.00	181,240,000.00
WIWYNN CORP	59,000	2,095.00	123,605,000.00
WPG HOLDINGS LTD	1,540,168	89.00	137,074,952.00
YAGEO CORPORATION	182,738	556.00	101,602,328.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	346,000	101.50	35,119,000.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	2,063,000	120.00	247,560,000.00
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	962,000	79.70	76,671,400.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	896,400	97.60	87,488,640.00
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	45,000	3,720.00	167,400,000.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	1,818,294	137.00	249,106,278.00
EEMORY TECHNOLOGY INC	35,000	2,620.00	91,700,000.00
GLOBAL UNICHIP CORP	46,000	1,555.00	71,530,000.00

	GLOBALWAFERS CO LTD	124,000	594.00	73,656,000.00	
	MEDIATEK INC	901,236	943.00	849,865,548.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	706,000	71.00	50,126,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	350,000	528.00	184,800,000.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	47,000	1,110.00	52,170,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	2,108,000	28.05	59,129,400.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	272,703	459.00	125,170,677.00	
	SILERGY CORP	184,000	400.50	73,692,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	14,505,000	642.00	9,312,210,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	7,099,000	52.30	371,277,700.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	473,000	76.30	36,089,900.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	1,887,000	27.85	52,552,950.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	865,141	35.80	30,972,047.80	
	ニュー台湾ドル 小計	205,968,129		20,908,620,290.34 (98,565,326,910)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	425,063	474.40	201,649,887.20	
	COAL INDIA LTD	875,273	389.40	340,831,306.20	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	358,066	430.60	154,183,219.60	
	INDIAN OIL CORP LTD	1,480,307	143.70	212,720,115.90	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	1,744,397	234.05	408,276,117.85	
	PETRONET LNG LTD	548,841	256.60	140,832,600.60	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	1,787,301	2,706.15	4,836,704,601.15	
	AMBUJA CEMENTS LTD	355,073	560.15	198,894,140.95	
	APL APOLLO TUBES LTD	93,400	1,489.85	139,151,990.00	
	ASIAN PAINTS LTD	224,046	2,949.20	660,756,463.20	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	170,784	554.70	94,733,884.80	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	146,062	2,076.50	303,297,743.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD-RIGHTS	4,895	316.80	1,550,736.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	707,266	567.20	401,161,275.20	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	179,644	716.30	128,678,997.20	
	JSW STEEL LTD	311,469	815.70	254,065,263.30	
	PI INDUSTRIES LTD	43,731	3,241.95	141,773,715.45	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	81,687	2,590.15	211,581,583.05	
	SHREE CEMENT LTD	4,903	27,948.80	137,032,966.40	
	SRF LTD	79,900	2,268.90	181,285,110.00	
	SUPREME INDUSTRIES LTD	38,100	4,014.85	152,965,785.00	

TATA STEEL LTD	4, 278, 189	133. 75	572, 207, 778. 75
ULTRATECH CEMENT LTD	75, 858	9, 969. 35	756, 254, 952. 30
UPL LTD	237, 272	537. 30	127, 486, 245. 60
VEDANTA LTD	555, 382	263. 60	146, 398, 695. 20
ABB INDIA LTD	32, 000	4, 739. 30	151, 657, 600. 00
ADANI ENTERPRISES LTD	97, 587	2, 893. 60	282, 377, 743. 20
ASHOK LEYLAND LTD	810, 688	169. 75	137, 614, 288. 00
ASTRAL LTD	72, 159	1, 800. 05	129, 889, 807. 95
BHARAT ELECTRONICS LTD	2, 768, 047	189. 70	525, 098, 515. 90
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	334, 557	463. 10	154, 933, 346. 70
CUMMINS INDIA LTD	73, 700	2, 161. 90	159, 332, 030. 00
HAVELLS INDIA LTD	144, 146	1, 290. 35	185, 998, 791. 10
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	111, 154	2, 903. 80	322, 768, 985. 20
LARSEN & TOUBRO LTD	411, 182	3, 593. 45	1, 477, 561, 957. 90
POLYCAB INDIA LTD	24, 700	4, 343. 85	107, 293, 095. 00
SIEMENS LTD	50, 469	4, 205. 40	212, 242, 332. 60
SUZLON ENERGY LTD	4, 883, 900	42. 55	207, 809, 945. 00
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	128, 900	970. 30	125, 071, 670. 00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	314, 258	1, 146. 30	360, 233, 945. 40
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	131, 294	828. 65	108, 796, 773. 10
INTERGLOBE AVIATION LTD	71, 702	2, 863. 05	205, 286, 411. 10
BAJAJ AUTO LTD	36, 471	7, 597. 50	277, 088, 422. 50
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	38, 519	2, 527. 00	97, 337, 513. 00
BHARAT FORGE LTD	133, 250	1, 200. 25	159, 933, 312. 50
EICHER MOTORS LTD	81, 325	3, 616. 45	294, 107, 796. 25
HERO MOTOCORP LTD	63, 559	4, 442. 15	282, 338, 611. 85
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	591, 720	1, 635. 50	967, 758, 060. 00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	78, 705	9, 881. 00	777, 684, 105. 00
MRF LTD	969	136, 857. 95	132, 615, 353. 55
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	1, 263, 368	115. 40	145, 792, 667. 20
SONA BLW PRECISION FORGINGS	213, 720	585. 40	125, 111, 688. 00
TATA MOTORS LTD	1, 083, 589	811. 85	879, 711, 729. 65
TATA MOTORS LTD-A-DVR	263, 600	537. 95	141, 803, 620. 00
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	65, 000	3, 987. 90	259, 213, 500. 00
TVS MOTOR CO LTD	141, 207	1, 941. 10	274, 096, 907. 70
PAGE INDUSTRIES LTD	4, 006	36, 711. 10	147, 064, 666. 60

TITAN CO LTD	233,390	3,770.20	879,926,978.00
INDIAN HOTELS CO LTD	446,100	473.60	211,272,960.00
JUBILANT FOODWORKS LTD	240,560	508.25	122,264,620.00
ZOMATO LTD	2,839,600	136.15	386,611,540.00
INFO EDGE INDIA LTD	37,381	4,982.55	186,252,701.55
TRENT LTD	108,950	3,231.80	352,104,610.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	89,907	3,734.25	335,735,214.75
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	61,472	5,141.90	316,082,876.80
ITC LTD	1,730,831	455.65	788,653,145.15
MARICO LTD	303,092	525.10	159,153,609.20
NESTLE INDIA LTD	197,412	2,482.15	490,006,195.80
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	451,186	1,136.75	512,885,685.50
UNITED SPIRITS LTD	167,525	1,096.00	183,607,400.00
VARUN BEVERAGES LTD	271,393	1,257.40	341,249,558.20
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	73,886	2,492.55	184,164,549.30
DABUR INDIA LTD	355,562	531.60	189,016,759.20
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	227,574	1,157.30	263,371,390.20
HINDUSTAN UNILEVER LTD	479,559	2,428.30	1,164,513,119.70
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	74,763	6,168.85	461,201,732.55
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	472,438	732.50	346,060,835.00
AUROBINDO PHARMA LTD	141,068	1,150.85	162,348,107.80
CIPLA LTD	293,561	1,369.65	402,075,823.65
DIVI'S LABORATORIES LTD	72,484	3,578.90	259,412,987.60
DR. REDDY'S LABORATORIES	65,279	5,855.50	382,241,184.50
LUPIN LTD	112,441	1,454.05	163,494,836.05
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	554,566	1,368.30	758,812,657.80
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	54,086	2,473.40	133,776,312.40
AU SMALL FINANCE BANK LTD	80,800	707.85	57,194,280.00
AXIS BANK LTD	1,376,712	1,042.25	1,434,878,082.00
BANDHAN BANK LTD	404,531	220.95	89,381,124.45
BANK OF BARODA	527,808	227.05	119,838,806.40
HDFC BANK LIMITED	1,634,747	1,434.90	2,345,698,470.30
ICICI BANK LTD	2,995,481	1,009.95	3,025,286,035.95
IDFC FIRST BANK LTD	1,793,641	80.05	143,580,962.05
INDUSIND BANK LTD	161,100	1,512.00	243,583,200.00
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	673,470	1,768.40	1,190,964,348.00

STATE BANK OF INDIA	1, 011, 660	612. 75	619, 894, 665. 00
YES BANK LTD	7, 091, 633	24. 85	176, 227, 080. 05
BAJAJ FINANCE LTD	160, 080	7, 085. 50	1, 134, 246, 840. 00
BAJAJ FINSERV LTD	219, 021	1, 630. 15	357, 037, 083. 15
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	16, 100	8, 194. 70	131, 934, 670. 00
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	249, 500	1, 244. 70	310, 552, 650. 00
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	46, 224	3, 428. 65	158, 485, 917. 60
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	1, 900, 623	239. 85	455, 864, 426. 55
MUTHOOT FINANCE LTD	70, 100	1, 388. 15	97, 309, 315. 00
ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	125, 900	763. 05	96, 067, 995. 00
POWER FINANCE CORPORATION	1, 073, 612	419. 00	449, 843, 428. 00
REC LTD	967, 835	470. 15	455, 027, 625. 25
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	152, 600	759. 85	115, 953, 110. 00
SHRIRAM FINANCE LTD	170, 222	2, 307. 15	392, 727, 687. 30
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	535, 235	579. 00	309, 901, 065. 00
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	138, 845	1, 482. 20	205, 796, 059. 00
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	194, 605	486. 30	94, 636, 411. 50
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	251, 699	1, 380. 90	347, 571, 149. 10
HCL TECHNOLOGIES LTD	558, 651	1, 550. 25	866, 048, 712. 75
INFOSYS LTD	1, 956, 136	1, 669. 10	3, 264, 986, 597. 60
LTIMINDTREE LTD	48, 910	5, 494. 65	268, 743, 331. 50
MPHASIS LTD	43, 391	2, 522. 40	109, 449, 458. 40
PERSISTENT SYSTEMS LTD	28, 000	8, 378. 75	234, 605, 000. 00
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	527, 525	3, 810. 30	2, 010, 028, 507. 50
TATA ELXSI LTD	19, 600	7, 667. 15	150, 276, 140. 00
TECH MAHINDRA LTD	322, 469	1, 322. 05	426, 320, 141. 45
WIPRO LTD	773, 095	470. 00	363, 354, 650. 00
BHARTI AIRTEL LTD	1, 367, 147	1, 160. 55	1, 586, 642, 450. 85
TATA COMMUNICATIONS LTD	66, 300	1, 716. 60	113, 810, 580. 00
ADANI GREEN ENERGY LTD	178, 388	1, 664. 80	296, 980, 342. 40
ADANI POWER LTD	465, 107	543. 30	252, 692, 633. 10
GAIL INDIA LTD	1, 369, 662	165. 40	226, 542, 094. 80
INDRAPRASTHA GAS LTD	213, 723	405. 15	86, 589, 873. 45
NTPC LTD	2, 832, 789	314. 75	891, 620, 337. 75
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	2, 752, 060	245. 50	675, 630, 730. 00
TATA POWER CO LTD	777, 533	365. 10	283, 877, 298. 30

	DLF LTD	347,607	758.65	263,712,050.55	
	GODREJ PROPERTIES LTD	68,467	2,326.90	159,315,862.30	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	138,700	1,056.05	146,474,135.00	
	インドルピー 小計	78,361,470		58,093,581,170.90 (103,987,510,295)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	39,958	746.50	29,828,647.00	
	MONETA MONEY BANK AS	174,521	98.20	17,137,962.20	
	CEZ AS	90,512	883.00	79,922,096.00	
	チェココルナ 小計	304,991		126,888,705.20 (821,617,055)	
クウェートディナール	AGILITY	847,283	0.57	482,951.31	
	BOUBYAN BANK K.S.C	782,041	0.63	499,724.19	
	GULF BANK	1,288,775	0.29	382,766.17	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	5,051,805	0.78	3,970,718.73	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	4,423,098	0.98	4,365,597.72	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	1,118,010	0.53	592,545.30	
	MABANEE CO KPSC	345,094	0.77	268,483.13	
	クウェートディナール 小計	13,856,106		10,562,786.55 (5,080,172,191)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	130,154	32,620.00	4,245,623,480.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	237,560	30,600.00	7,269,336,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	241,634	16,900.00	4,083,614,600.00	
	コロンビアペソ 小計	609,348		15,598,574,080.00 (584,073,007)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	235,486	2,858.00	673,018,988.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	78,795	9,500.00	748,552,500.00	
	OTP BANK PLC	141,641	16,990.00	2,406,480,590.00	
	ハンガリーフォリント 小計	455,922		3,828,052,078.00 (1,592,052,406)	
アラブディルハム	MULTIPLY GROUP	2,382,334	2.99	7,123,178.66	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	1,481,824	3.30	4,890,019.20	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	1,942,280	3.56	6,914,516.80	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	1,802,409	9.22	16,618,210.98	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	944,352	11.16	10,538,968.32	
	DUBAI ISLAMIC BANK	2,117,807	6.25	13,236,293.75	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	2,703,694	15.20	41,096,148.80	

	EMIRATES TELECOM GROUP CO	2,249,674	20.08	45,173,453.92	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	2,874,678	5.07	14,574,617.46	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	4,052,022	7.45	30,187,563.90	
	アラブディルハム 小計	22,551,074		190,352,971.79 (7,669,321,233)	
ポーランドズロチ	ORLEN SA	342,553	60.47	20,714,179.91	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	79,255	111.85	8,864,671.75	
	BUDIMEX	7,879	650.00	5,121,350.00	
	LPP SA	672	15,000.00	10,080,000.00	
	CD PROJEKT SA	39,305	106.35	4,180,086.75	
	CYFROWY POLSAT SA	150,511	10.91	1,642,075.01	
	ALLEGRO.EU SA	294,056	30.20	8,880,491.20	
	PEPCO GROUP NV	65,200	21.64	1,410,928.00	
	DINO POLSKA SA	25,229	423.10	10,674,389.90	
	BANK PEKAO SA	113,342	146.45	16,598,935.90	
	MBANK SA	8,679	498.20	4,323,877.80	
	PKO BANK POLSKI SA	490,314	48.75	23,902,807.50	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	17,302	460.80	7,972,761.60	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	457,338	46.50	21,266,217.00	
PGE SA	422,950	8.22	3,477,494.90		
	ポーランドズロチ 小計	2,514,585		149,110,267.22 (5,458,598,840)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	127,751	189.13	24,161,546.63	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	33,259	848.37	28,215,937.83	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	249,911	329.52	82,350,672.72	
	GOLD FIELDS LTD	528,313	261.86	138,344,042.18	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	325,035	119.62	38,880,686.70	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	590,056	76.20	44,962,267.20	
	KUMBA IRON ORE LTD	35,041	561.22	19,665,710.02	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	183,913	133.55	24,561,581.15	
	SASOL LTD	317,880	161.90	51,464,772.00	
	SIBANYE STILLWATER LTD	1,896,239	22.57	42,798,114.23	
	BIDVEST GROUP LTD	146,948	246.26	36,187,414.48	
	NASPERS LTD-N SHS	114,881	3,172.50	364,459,972.50	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	1,021,247	19.78	20,200,265.66	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	480,830	69.84	33,581,167.20		

	BID CORP LTD	184,622	436.96	80,672,429.12	
	CLICKS GROUP LTD	148,332	297.78	44,170,302.96	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	281,193	266.98	75,072,907.14	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	223,949	193.85	43,412,513.65	
	ABSA GROUP LTD	499,810	159.19	79,564,753.90	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	48,224	2,050.00	98,859,200.00	
	NEDBANK GROUP LTD	421,373	213.04	89,769,303.92	
	STANDARD BANK GROUP LTD	735,750	197.50	145,310,625.00	
	FIRSTRAND LTD	2,894,590	67.50	195,384,825.00	
	REINET INVESTMENTS SCA	84,585	465.33	39,359,938.05	
	REMGRO LTD	267,319	153.18	40,947,924.42	
	DISCOVERY LTD	299,449	134.44	40,257,923.56	
	OLD MUTUAL LTD	2,345,236	12.19	28,588,426.84	
	OUTSURANCE GROUP LTD	394,727	41.81	16,503,535.87	
	SANLAM LTD	940,616	71.12	66,896,609.92	
	MTN GROUP LTD	1,220,409	101.14	123,432,166.26	
	VODACOM GROUP LTD	430,847	100.03	43,097,625.41	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	264,758	123.19	32,615,538.02	
	南アフリカランド 小計	17,737,093		2,233,750,699.54 (17,467,930,470)	
オフショア元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	176,500	6.62	1,168,430.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	1,126,325	5.89	6,634,054.25	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	236,728	35.12	8,313,887.36	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	124,900	13.62	1,701,138.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	235,000	7.55	1,774,250.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	42,000	5.81	244,020.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	685,100	7.99	5,473,949.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	409,600	23.70	9,707,520.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	222,000	9.97	2,213,340.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	142,970	10.43	1,491,177.10	
	SHANXI LU' AN ENVIRONMENTAL-A	100,900	23.35	2,356,015.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	150,082	22.28	3,343,826.96	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	9,100	27.92	254,072.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	650,300	5.64	3,667,692.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	173,900	22.60	3,930,140.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	681,496	6.08	4,143,495.68	

CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	20,540	23.02	472,830.80
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	27,200	23.76	646,272.00
CHINA JUSHI CO LTD -A	110,447	9.54	1,053,664.38
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	123,100	17.98	2,213,338.00
CHINA RARE EARTH RESOURCES-A	32,500	24.99	812,175.00
CMOC GROUP LTD-A	515,101	5.42	2,791,847.42
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	54,324	47.28	2,568,438.72
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	102,531	40.61	4,163,783.91
GEM CO LTD-A	131,700	4.97	654,549.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	84,280	21.65	1,824,662.00
HENAN SHENHUO COAL & POWER-A	125,100	16.83	2,105,433.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	257,100	12.40	3,188,040.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	537,748	6.62	3,559,891.76
HESTEEL CO LTD-A	1,596,100	2.11	3,367,771.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	27,200	48.99	1,332,528.00
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	106,636	6.39	681,404.04
HUAIIBEI MINING HOLDINGS CO-A	131,200	17.59	2,307,808.00
HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A	38,600	17.72	683,992.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	185,200	5.41	1,001,932.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	2,282,300	1.47	3,354,981.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	482,916	3.67	1,772,301.72
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	290,586	9.85	2,862,272.10
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	30,160	54.91	1,656,085.60
JIANGXI COPPER CO LTD-A	99,100	18.14	1,797,674.00
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	181,400	9.78	1,774,092.00
LB GROUP CO LTD-A	59,600	16.60	989,360.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	338,100	11.60	3,921,960.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	319,800	14.16	4,528,368.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	697,700	3.01	2,100,077.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	211,600	15.20	3,216,320.00
RONGSHENG PETROCHEMICAL CO-A	325,971	9.75	3,178,217.25
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	84,740	14.48	1,227,035.20
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	90,424	20.59	1,861,830.16
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	199,150	25.62	5,102,223.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	336,100	2.94	988,134.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	233,900	12.34	2,886,326.00

SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	101,726	18.83	1,915,500.58
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	145,500	5.85	851,175.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	1,174,400	3.70	4,345,280.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	20,880	41.61	868,816.80
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	19,040	49.85	949,144.00
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A	17,980	12.26	220,434.80
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	47,100	15.30	720,630.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	58,100	2.78	161,518.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	13,524	40.62	549,344.88
TIANQI LITHIUM CORP-A	59,200	56.01	3,315,792.00
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	100,000	5.54	554,000.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	60,900	13.05	794,745.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	510,800	3.12	1,593,696.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	95,000	72.09	6,848,550.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	7,840	23.71	185,886.40
WESTERN MINING CO -A	163,200	14.60	2,382,720.00
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	23,240	39.81	925,184.40
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	13,400	16.56	221,904.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	199,060	13.90	2,766,934.00
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	14,560	51.90	755,664.00
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	122,042	10.98	1,340,021.16
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A	34,651	49.46	1,713,838.46
YUNNAN YUNTIANHUA CO-A	40,000	15.65	626,000.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	34,400	26.24	902,656.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	55,015	28.65	1,576,179.75
ZHEJIANG JUHUA CO-A	107,700	16.00	1,723,200.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	204,800	7.94	1,626,112.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	349,900	9.33	3,264,567.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	673,600	12.05	8,116,880.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	78,931	16.85	1,329,987.35
AECC AVIATION POWER CO-A	79,200	33.84	2,680,128.00
AVICOPTER PLC-A	37,400	35.59	1,331,066.00
BEIJING EASPRING MATERIAL-A	14,200	35.90	509,780.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	66,800	27.44	1,832,992.00
BEIJING UNITED INFORMATION-A	25,019	20.49	512,639.31
CHINA BAOAN GROUP-A	49,260	11.73	577,819.80

CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	73,000	30.79	2,247,670.00
CHINA ENERGY ENGINEERING C-A	1,252,100	2.17	2,717,057.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	98,000	6.56	642,880.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	1,045,600	6.41	6,702,296.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	1,305,480	5.10	6,657,948.00
CHINA XD ELECTRIC CO LTD-A	391,100	5.27	2,061,097.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	149,254	155.00	23,134,370.00
CRRC CORP LTD-A	1,139,000	5.67	6,458,130.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	144,760	14.76	2,136,657.60
EVE ENERGY CO LTD-A	67,288	38.93	2,619,521.84
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	1,305,243	4.75	6,199,904.25
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	73,700	8.15	600,655.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	9,750	70.64	688,740.00
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	129,800	7.48	970,904.00
GONEO GROUP CO LTD-A	34,400	93.60	3,219,840.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	231,800	19.40	4,496,920.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	9,940	24.11	239,653.40
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	62,532	52.45	3,279,803.40
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	103,700	12.40	1,285,880.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	47,400	12.96	614,304.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	527,534	3.29	1,735,586.86
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	47,900	10.80	517,320.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	272,409	21.24	5,785,967.16
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	26,700	78.10	2,085,270.00
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	24,000	38.18	916,320.00
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	8,300	33.46	277,718.00
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	49,900	12.57	627,243.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	512,700	5.02	2,573,754.00
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	3,400	100.23	340,782.00
RANGE INTELLIGENT COMPUTI-A	79,700	21.50	1,713,550.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	340,616	13.50	4,598,316.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	84,500	2.42	204,490.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	407,700	4.13	1,683,801.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	49,851	55.74	2,778,694.74
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	185,640	7.98	1,481,407.20
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	60,100	51.55	3,098,155.00

SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	63,100	90.00	5,679,000.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	37,600	13.09	492,184.00
TBEA CO LTD-A	217,100	14.53	3,154,463.00
TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A	12,000	9.91	118,920.00
WEICHAI POWER CO LTD-A	285,251	15.09	4,304,437.59
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	363,600	5.67	2,061,612.00
XIAMEN C & D INC-A	26,900	10.26	275,994.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	36,000	20.67	744,120.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	4,620	53.32	246,338.40
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	113,500	22.23	2,523,105.00
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	221,000	13.81	3,052,010.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-A	45,200	36.07	1,630,364.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,500	6.35	574,675.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	143,900	7.25	1,043,275.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	74,300	33.65	2,500,195.00
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	489,300	3.30	1,614,690.00
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	58,110	16.84	978,572.40
AIR CHINA LTD-A	287,800	7.42	2,135,476.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	1,533,100	4.94	7,573,514.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	547,400	3.90	2,134,860.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	444,100	6.00	2,664,600.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	469,130	10.05	4,714,756.50
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	361,700	7.43	2,687,431.00
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	2,330,900	1.40	3,263,260.00
LIAONING PORT CO LTD-A	2,697,000	1.42	3,829,740.00
S F HOLDING CO LTD-A	142,200	38.42	5,463,324.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	38,100	34.20	1,303,020.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	139,900	5.48	766,652.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	54,200	53.04	2,874,768.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	75,200	12.04	905,408.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	78,060	6.81	531,588.60
ANHUI JIANGHUAI AUTO GROUP-A	109,000	13.84	1,508,560.00
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	288,700	4.99	1,440,613.00
BYD CO LTD -A	58,300	189.90	11,071,170.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	20,100	130.58	2,624,658.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	274,190	14.34	3,931,884.60

FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	46,838	37.48	1,755,488.24
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	92,554	22.30	2,063,954.20
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	348,900	8.46	2,951,694.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	68,200	16.68	1,137,576.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	12,000	97.30	1,167,600.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	12,360	16.26	200,973.60
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	51,300	53.21	2,729,673.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	159,244	13.76	2,191,197.44
SAILUN GROUP CO LTD-A	107,100	11.33	1,213,443.00
SERES GROUP CO L-A	55,300	65.00	3,594,500.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	37,400	20.66	772,684.00
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	8,700	71.97	626,139.00
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	5,900	288.02	1,699,318.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	11,400	37.51	427,614.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	77,853	33.66	2,620,531.98
HAIER SMART HOME CO LTD-A	208,929	22.05	4,606,884.45
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	9,000	21.28	191,520.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	16,120	34.50	556,140.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	12,917	65.27	843,092.59
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	5,200	51.54	268,008.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	27,000	29.72	802,440.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	24,843	10.05	249,672.15
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	75,300	18.83	1,417,899.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	27,900	8.22	229,338.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	626,202	5.92	3,707,115.84
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	700	205.60	143,920.00
KUNLUN TECH CO LTD-A	56,000	36.60	2,049,600.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	80,780	23.22	1,875,711.60
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	241,100	7.41	1,786,551.00
PEOPLE.CN CO LTD-A	55,400	25.00	1,385,000.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	18,300	10.63	194,529.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	126,520	4.96	627,539.20
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	60,699	86.90	5,274,743.10
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	30,800	6.42	197,736.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	48,200	4.41	212,562.00
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	344,500	7.68	2,645,760.00

DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	19,704	24.04	473,684.16
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	84,971	38.81	3,297,724.51
ANGEL YEAST CO LTD-A	7,800	33.27	259,506.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	10,200	212.50	2,167,500.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	46,625	41.30	1,925,612.50
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	21,800	55.94	1,219,492.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	5,900	79.97	471,823.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	40,300	5.15	207,545.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	234,000	8.25	1,930,500.00
CHONGQING BREWERY CO-A	16,080	60.69	975,895.20
EASTROC BEVERAGE GROUP CO -A	17,500	165.36	2,893,800.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	143,133	35.82	5,127,024.06
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	9,800	15.69	153,762.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	49,519	39.31	1,946,591.89
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	118,600	11.73	1,391,178.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	87,500	27.95	2,445,625.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	293,000	27.07	7,931,510.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	32,590	43.54	1,418,968.60
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	44,981	96.20	4,327,172.20
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	3,600	68.09	245,124.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	7,600	24.55	186,580.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	5,500	22.68	124,740.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	47,853	1,638.00	78,383,214.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	48,255	155.80	7,518,129.00
MUYUAN FOODS CO LTD-A	190,980	36.03	6,881,009.40
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	209,700	8.46	1,774,062.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	24,705	23.02	568,709.10
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	44,360	204.29	9,062,304.40
SHEDE SPIRITS CO LTD-A	22,300	90.09	2,009,007.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	12,600	50.76	639,576.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	18,161	72.71	1,320,486.31
WENS FOODSTUFFS GROUP CO L-A	261,140	18.82	4,914,654.80
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	147,900	131.11	19,391,169.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	23,700	30.72	728,064.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	12,500	13.23	165,375.00
BY-HEALTH CO LTD-A	133,500	15.97	2,131,995.00

YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A	9,700	63.99	620,703.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	276,792	13.95	3,861,248.40
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	128,900	28.28	3,645,292.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	4,400	56.71	249,524.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	57,140	33.07	1,889,619.80
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	64,300	33.99	2,185,557.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	37,130	7.13	264,736.90
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	95,160	14.04	1,336,046.40
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	35,560	5.00	177,800.00
OVCTEK CHINA INC-A	17,260	19.52	336,915.20
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	183,900	16.84	3,096,876.00
SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A	31,700	138.59	4,393,303.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	38,300	283.85	10,871,455.00
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	49,300	74.52	3,673,836.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	7,000	68.22	477,540.00
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	15,000	13.69	205,350.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	19,040	98.30	1,871,632.00
BEIJING TONGRENTANG CO-A	29,900	51.14	1,529,086.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	13,804	60.38	833,485.52
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	3,800	42.19	160,322.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	17,000	42.78	727,260.00
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	34,200	68.41	2,339,622.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	8,700	124.02	1,078,974.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	36,000	53.16	1,913,760.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	90,296	49.70	4,487,711.20
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	255,600	50.45	12,895,020.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	7,089	48.86	346,368.54
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	54,190	18.97	1,027,984.30
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	29,900	22.21	664,079.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	8,100	305.55	2,474,955.00
JIANGSU HENGRUI PHARMACEUT-A	196,043	41.20	8,076,971.60
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	18,400	11.51	211,784.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	5,800	35.19	204,102.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	210,622	13.99	2,946,601.78
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	28,125	25.28	711,000.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	10,780	16.07	173,234.60

SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	112,400	23.37	2,626,788.00
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	24,600	32.41	797,286.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	240,500	6.85	1,647,425.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	129,825	23.85	3,096,326.25
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	89,800	28.90	2,595,220.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	76,100	22.29	1,696,269.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	106,800	24.86	2,655,048.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	180,580	19.59	3,537,562.20
WUXI APPTEC CO LTD-A	87,811	73.29	6,435,668.19
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	80,260	49.08	3,939,160.80
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	19,300	228.00	4,400,400.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	13,860	13.08	181,288.80
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	25,700	20.53	527,621.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	85,176	16.90	1,439,474.40
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	2,735,000	3.80	10,393,000.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	751,100	4.90	3,680,390.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	137,793	12.17	1,676,940.81
BANK OF CHINA LTD-A	1,412,300	4.15	5,861,045.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	1,209,833	5.90	7,138,014.70
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	151,000	10.57	1,596,070.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	576,750	7.13	4,112,227.50
BANK OF NANJING CO LTD -A	321,500	7.99	2,568,785.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	236,111	21.15	4,993,747.65
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	543,311	6.35	3,450,024.85
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	257,100	6.70	1,722,570.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	1,913,010	3.07	5,872,940.70
CHINA MERCHANTS BANK-A	653,899	30.90	20,205,479.10
CHINA MINSHENG BANKING-A	1,426,128	3.88	5,533,376.64
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	1,093,500	2.67	2,919,645.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	650,600	4.23	2,752,038.00
CNPC CAPITAL CO LTD-A	361,100	5.98	2,159,378.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	679,150	5.97	4,054,525.50
IND & COMM BK OF CHINA-A	2,029,428	5.01	10,167,434.28
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	740,574	15.47	11,456,679.78
PING AN BANK CO LTD-A	679,061	9.50	6,451,079.50
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	874,400	4.63	4,048,472.00

SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	884,337	6.77	5,986,961.49
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	749,400	6.32	4,736,208.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	461,900	3.47	1,602,793.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	452,855	7.66	3,468,869.30
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	322,834	5.23	1,688,421.82
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	223,500	11.89	2,657,415.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	58,000	7.65	443,700.00
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	96,092	34.34	3,299,799.28
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	159,900	13.43	2,147,457.00
CITIC SECURITIES CO-A	397,445	20.56	8,171,469.20
CSC FINANCIAL CO LTD-A	192,700	22.75	4,383,925.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	26,200	7.95	208,290.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	522,334	13.35	6,973,158.90
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	101,600	16.11	1,636,776.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	97,100	5.55	538,905.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	299,965	7.51	2,252,737.15
GF SECURITIES CO LTD-A	281,900	14.08	3,969,152.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	110,261	5.99	660,463.39
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	51,600	10.40	536,640.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	229,500	8.40	1,927,800.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	173,625	15.06	2,614,792.50
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	31,900	6.67	212,773.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	242,979	9.30	2,259,704.70
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	13,530	129.20	1,748,076.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	313,740	14.26	4,473,932.40
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	24,900	8.00	199,200.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	180,700	5.65	1,020,955.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	226,900	7.84	1,778,896.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	341,800	8.75	2,990,750.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	343,400	6.81	2,338,554.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	26,900	5.24	140,956.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	634,714	4.43	2,811,783.02
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	210,300	8.70	1,829,610.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	246,100	7.14	1,757,154.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	53,700	3.94	211,578.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	567,600	3.11	1,765,236.00

WESTERN SECURITIES CO LTD-A	247,600	6.27	1,552,452.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	74,000	10.05	743,700.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	132,200	6.81	900,282.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	85,400	28.69	2,450,126.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	212,000	24.77	5,251,240.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	135,086	31.22	4,217,384.92
PICC HOLDING CO-A	647,000	5.10	3,299,700.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	412,422	41.15	16,971,165.30
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	319,600	7.85	2,508,860.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	17,500	242.46	4,243,050.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	21,403	8.21	175,718.63
DHC SOFTWARE CO LTD -A	281,500	5.49	1,545,435.00
EMPYREAN TECHNOLOGY CO LTD-A	17,600	88.67	1,560,592.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	50,398	24.68	1,243,822.64
IFLYTEK CO LTD - A	82,885	42.60	3,530,901.00
NAVINFO CO LTD-A	411,400	7.70	3,167,780.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	8,500	62.60	532,100.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	42,276	44.60	1,885,509.60
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	12,400	58.82	729,368.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	87,015	12.96	1,127,714.40
ANKER INNOVATIONS TECHNOLO-A	20,100	76.07	1,529,007.00
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	36,700	19.22	705,374.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	1,238,900	3.74	4,633,486.00
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	26,600	18.74	498,484.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	48,197	25.31	1,219,866.07
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	164,000	9.27	1,520,280.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	296,998	4.69	1,392,920.62
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	13,700	49.70	680,890.00
EVERDISPLAY OPTRONICS SHAN-A	696,400	2.23	1,552,972.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	473,900	15.08	7,146,412.00
GOERTEK INC -A	71,400	17.58	1,255,212.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	166,500	10.40	1,731,600.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	1,330,300	11.35	15,098,905.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	49,000	39.64	1,942,360.00
IEIT SYSTEMS CO LTD-A	54,900	33.38	1,832,562.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	109,400	11.96	1,308,424.00

LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	217,700	5.32	1,158,164.00
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	210,512	29.13	6,132,214.56
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	10,752	105.53	1,134,658.56
NINESTAR CORP-A	39,700	19.86	788,442.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	140,200	16.52	2,316,104.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	27,780	58.43	1,623,185.40
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	31,000	145.00	4,495,000.00
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD-A	51,475	38.49	1,981,272.75
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	72,200	14.90	1,075,780.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	918,300	4.28	3,930,324.00
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	9,000	28.02	252,180.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	111,100	9.28	1,031,008.00
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	110,648	17.79	1,968,427.92
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	25,000	37.14	928,500.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	157,032	6.31	990,871.92
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	132,040	23.26	3,071,250.40
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	6,300	97.01	611,163.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	31,430	27.64	868,725.20
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	75,700	17.28	1,308,096.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	30,100	118.35	3,562,335.00
ZTE CORP-A	154,100	24.72	3,809,352.00
CHINA UNITED NETWORK-A	1,185,800	4.53	5,371,674.00
CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A	323,800	5.31	1,719,378.00
CGN POWER CO LTD-A	632,800	3.57	2,259,096.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	240,000	8.24	1,977,600.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	1,122,300	4.47	5,016,681.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	856,242	23.94	20,498,433.48
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	73,600	17.56	1,292,416.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	570,400	4.28	2,441,312.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	367,600	5.70	2,095,320.00
HUANENG POWER INTL INC-A	324,300	8.69	2,818,167.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	390,500	13.32	5,201,460.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	300,860	6.24	1,877,366.40
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A	180,400	14.99	2,704,196.00
WINTIME ENERGY GROUP CO L-A	2,307,800	1.34	3,092,452.00
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	838,200	5.15	4,316,730.00

ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	20,700	134.96	2,793,672.00
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	10,000	132.81	1,328,100.00
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	51,000	41.68	2,125,680.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	101,300	24.30	2,461,590.00
GALAXYCORE INC-A	100,100	17.43	1,744,743.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTO-CL A	35,556	74.16	2,636,832.96
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	62,322	24.59	1,532,497.98
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	33,200	20.82	691,224.00
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD-A	12,911	30.38	392,236.18
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	71,200	73.20	5,211,840.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	10,100	53.19	537,219.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	144,480	21.18	3,060,086.40
JCET GROUP CO LTD-A	47,200	25.72	1,213,984.00
JINKO SOLAR CO LTD-A	351,000	9.11	3,197,610.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	385,389	22.30	8,594,174.70
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	52,600	51.67	2,717,842.00
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	189,500	15.56	2,948,620.00
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	20,900	254.21	5,312,989.00
PIOTECH INC-A	7,900	182.00	1,437,800.00
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	358,200	12.71	4,552,722.00
SG MICRO CORP-A	7,897	65.76	519,306.72
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A	102,200	18.07	1,846,754.00
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	8,600	66.22	569,492.00
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	3,500	163.21	571,235.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	5,632	123.55	695,833.60
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	164,500	15.52	2,553,040.00
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	201,300	7.28	1,465,464.00
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	29,100	21.58	627,978.00
TONGWEI CO LTD-A	157,700	26.15	4,123,855.00
TRINA SOLAR CO LTD-A	56,200	26.65	1,497,730.00
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	36,299	58.96	2,140,189.04
WILL SEMICONDUCTOR CO LTD-A	38,915	92.60	3,603,529.00
XINJIANG DAQO NEW ENERGY C-A	87,400	28.14	2,459,436.00
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	61,400	38.38	2,356,532.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	242,622	8.94	2,169,040.68
CHINA VANKE CO LTD -A	424,956	9.96	4,232,561.76

	GEMDALE CORP-A	42,900	4.28	183,612.00	
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	498,187	3.61	1,798,455.07	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	357,000	9.60	3,427,200.00	
	SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	58,700	10.88	638,656.00	
	SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	160,740	10.38	1,668,481.20	
	SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	268,100	3.08	825,748.00	
	YOUNGOR FASHION CO LTD	106,400	6.74	717,136.00	
	オフショア元 小計	106,475,256		1,254,876,290.26 (25,800,632,990)	
サウジアラビア リヤル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	202,319	9.11	1,843,126.09	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	1,547,524	31.55	48,824,382.20	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	101,795	37.80	3,847,851.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	198,764	11.70	2,325,538.80	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	141,314	128.60	18,172,980.40	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	202,755	30.95	6,275,267.25	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	869,711	47.00	40,876,417.00	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	26,867	147.20	3,954,822.40	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	521,863	78.80	41,122,804.40	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	194,677	19.94	3,881,859.38	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	362,675	9.70	3,517,947.50	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	158,529	38.35	6,079,587.15	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	23,810	215.60	5,133,436.00	
	JARIR MARKETING CO	303,520	15.22	4,619,574.40	
	NAHDI MEDICAL CO	18,802	143.80	2,703,727.60	
	ALMARAI CO	144,974	59.70	8,654,947.80	
	SAVOLA	136,987	44.55	6,102,770.85	
	DALLAH HEALTHCARE CO	17,729	173.00	3,067,117.00	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	48,783	295.60	14,420,254.80	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	60,419	123.00	7,431,537.00	
	AL RAJHI BANK	1,162,766	88.50	102,904,791.00	
	ALINMA BANK	545,623	42.90	23,407,226.70	
	ARAB NATIONAL BANK	405,036	25.50	10,328,418.00	
	BANK AL-JAZIRA	183,665	19.34	3,552,081.10	
	BANK ALBILAD	290,677	45.95	13,356,608.15	
	BANQUE SAUDI FRANSI	352,854	41.15	14,519,942.10	
	RIYAD BANK	865,575	29.45	25,491,183.75	

	SAUDI AWWAL BANK	599,339	37.70	22,595,080.30	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	268,331	16.02	4,298,662.62	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	1,730,883	43.05	74,514,513.15	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	29,391	215.80	6,342,577.80	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	49,780	223.60	11,130,808.00	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	40,167	126.60	5,085,142.20	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	11,999	333.20	3,998,066.80	
	ELM CO	14,004	924.20	12,942,496.80	
	ETIHAD ETISALAT CO	199,830	51.40	10,271,262.00	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	228,789	13.44	3,074,924.16	
	SAUDI TELECOM CO	1,329,690	42.65	56,711,278.50	
	ACWA POWER CO	56,238	244.80	13,767,062.40	
	POWER & WATER UTILITY CO FOR	34,137	64.40	2,198,422.80	
	SAUDI ELECTRICITY CO	434,114	19.02	8,256,848.28	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	274,619	14.04	3,855,650.76	
	サウジアラビアリヤル 小計	14,391,324		665,458,996.39 (26,252,357,407)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	544,304	144.80	78,815,219.20	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	884,882	42.82	37,890,647.24	
	HEKTAS TICARET T. A. S	473,600	17.43	8,254,848.00	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	491,871	20.48	10,073,518.08	
	SASA POLYESTER SANAYI	755,799	38.06	28,765,709.94	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	715,526	48.48	34,688,700.48	
	KOC HOLDING AS	798,602	154.60	123,463,869.20	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	688,169	47.88	32,949,531.72	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	23,874	729.50	17,416,083.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	543,256	252.25	137,036,326.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	41,470	839.00	34,793,330.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	53,584	238.00	12,752,992.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	241,353	364.25	87,912,830.25	
	AKBANK T. A. S.	1,630,071	40.34	65,757,064.14	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	560,781	68.80	38,581,732.80	
	TURKIYE IS BANKASI-C	1,970,064	24.78	48,818,185.92	
	YAPI VE KREDI BANKASI	1,948,324	21.70	42,278,630.80	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	650,401	66.95	43,544,346.95	
	トルコリラ 小計	13,015,931		883,793,565.72	

				(4,310,526,358)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	40,905	26.00	1,063,530.00
	MYTILINEOS S. A.	59,964	38.90	2,332,599.60
	OPAP SA	103,580	16.18	1,675,924.40
	FF GROUP	5,889	—	—
	JUMBO SA	66,836	26.60	1,777,837.60
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	1,184,493	1.59	1,889,858.58
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	1,330,927	1.74	2,317,809.37
	NATIONAL BANK OF GREECE	647,914	6.85	4,438,210.90
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	420,120	3.43	1,442,692.08
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	95,037	12.97	1,232,629.89
	PUBLIC POWER CORP	111,882	12.27	1,372,792.14
	ユーロ 小計	4,067,547		19,543,884.56 (3,130,343,989)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	288,993	15.95	4,609,438.35
	QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT)	1,224,895	3.65	4,479,441.01
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	2,142,532	1.71	3,663,729.72
	INDUSTRIES QATAR	832,122	12.20	10,151,888.40
	COMMERCIAL BANK PSQC	1,761,049	5.57	9,809,042.93
	DUKHAN BANK	1,104,320	3.99	4,408,445.44
	MASRAF AL RAYAN	3,510,349	2.44	8,596,844.70
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	555,729	10.90	6,057,446.10
	QATAR ISLAMIC BANK	914,528	19.95	18,244,833.60
	QATAR NATIONAL BANK	2,690,428	16.05	43,181,369.40
	OOREDOO QPSC	397,674	10.70	4,255,111.80
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	266,231	17.55	4,672,354.05
	BARWA REAL ESTATE CO	3,105,300	2.90	9,005,370.00
	カタールリアル 小計	18,794,150		131,135,315.50 (5,322,782,456)
	合 計	3,489,362,273		593,681,414,280 (593,681,414,280)

(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	12,341,728.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	414,800	30,819,640.00	
		TRUST FIBRA UNO	1,759,200	51,878,808.00	
メキシコペソ合計			2,822,200	95,040,176.00 (816,157,511)	
合計				816,157,511 (816,157,511)	

(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 49 銘柄	100.00%	—	2.84%
香港ドル	株式 184 銘柄	100.00%	—	19.27%
マレーシアリングgit	株式 31 銘柄	100.00%	—	1.35%
タイバーツ	株式 38 銘柄	100.00%	—	1.68%
フィリピンペソ	株式 14 銘柄	100.00%	—	0.64%
インドネシアルピア	株式 22 銘柄	100.00%	—	1.88%
メキシコペソ	株式 21 銘柄	95.00%	—	2.61%
	投資証券 3 銘柄	—	5.00%	0.14%
ブラジルリアル	株式 48 銘柄	100.00%	—	5.67%
チリペソ	株式 12 銘柄	100.00%	—	0.48%
韓国ウォン	株式 102 銘柄	100.00%	—	11.96%
ニュー台湾ドル	株式 90 銘柄	100.00%	—	16.58%
インドルピー	株式 132 銘柄	100.00%	—	17.49%
チェココルナ	株式 3 銘柄	100.00%	—	0.14%
クウェートディナール	株式 7 銘柄	100.00%	—	0.85%
コロンビアペソ	株式 3 銘柄	100.00%	—	0.10%
ハンガリーフォリント	株式 3 銘柄	100.00%	—	0.27%
アラブディルハム	株式 10 銘柄	100.00%	—	1.29%
ポーランドズロチ	株式 15 銘柄	100.00%	—	0.92%
南アフリカランド	株式 32 銘柄	100.00%	—	2.94%
オフショア元	株式 455 銘柄	100.00%	—	4.34%
サウジアラビアリヤル	株式 42 銘柄	100.00%	—	4.42%
トルコリラ	株式 18 銘柄	100.00%	—	0.73%
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%	—	0.90%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年1月26日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,640,525,292
国債証券	648,869,193,030
地方債証券	41,609,810,988
特殊債券	35,817,564,204
社債券	46,098,431,000
派生商品評価勘定	1,107,195
未収利息	1,355,133,352
前払金	1,280,000
前払費用	56,712,840
差入委託証拠金	9,262,301
流動資産合計	777,459,020,202
資産合計	777,459,020,202
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	541,870
未払金	1,278,564,000
未払解約金	460,017,213
未払利息	930
流動負債合計	1,739,124,013
負債合計	1,739,124,013
純資産の部	
元本等	
元本	608,533,464,538
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	167,186,431,651
元本等合計	775,719,896,189
純資産合計	775,719,896,189
負債純資産合計	777,459,020,202

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1月26日現在]
1. 期首	2023年1月27日
期首元本額	532,608,638,593円
期中追加設定元本額	148,013,908,937円
期中一部解約元本額	72,089,082,992円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	7,439,665,045円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	10,747,372,867円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	2,746,619,059円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	56,245,340,662円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	101,594,469,109円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	32,245,984,304円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	206,252,058円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	187,735,541円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	1,827,705,511円
eMAXIS 国内債券インデックス	6,315,724,263円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	4,289,534,842円
eMAXIS バランス(波乗り型)	366,017,906円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	16,894,641,195円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	41,964,317,139円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	10,933,832,987円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	5,120,983,499円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	2,339,723,792円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	17,130,228,598円
国内債券セレクション(ラップ向け)	10,386,091,705円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	21,633,546,373円
つみたて8資産均等バランス	10,569,951,144円
つみたて4資産均等バランス	3,991,081,280円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	18,465,486円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	13,949,889円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	388,372円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	6,161,677,827円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	2,723,825,131円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	1,084,392,404円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	7,011,048,577円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	6,685,295,313円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	4,045,555,457円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	795,786,854円
三菱UFJ DC年金バランス(株式25)	1,309,878,609円

国内債券インデックスファンド（ラップ向け）	1,660,715,164円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）	363,948,126円
ラップ向けインデックスf 国内債券	6,122,351,446円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）	2,320,158,395円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）	2,481,706,998円
三菱UFJ DC年金バランス（株式80）	8,227,364円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070（確定拠出年金）	2,226,128円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	128,465,862円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	177,956,270円
eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）	79,075,527円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	1,598,521,756円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	1,873,154,147円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	1,105,939,774円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	2,260,834,355円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	124,356,518円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	67,705,551円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA（適格機関投資家限定）	5,930,424,927円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）VA（適格機関投資家限定）	1,730円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	26,467,888円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	9,049,069,757円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	647,222,252円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	4,534,388,897円
MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	118,262,383,144円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	457,816,215円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	1,513,204円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	298,010円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	4,358,131,074円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	2,490,929,518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）	2,980,339,781円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	517,799,828円
MUKAM 日本債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	13,043,515,513円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）	1,911,787,835円
マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）	2,054,382円
日本債券インデックスファンドS	4,587,599,760円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07（適格機関投資家限定）	429,832,474円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09（適格機関投資家限定）	424,280,144円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11（適格機関投資家限定）	424,729,389円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01（適格機関投資家限定）	421,626,267円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03（適格機関投資家限定）	419,477,595円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05（適格機関投資家限定）	420,955,442円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07（適	413,671,752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2021-09 (適格機関投資家限定)	416,234,104 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	418,690,273 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	416,840,490 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	462,440,331 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	469,323,041 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	477,586,919 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	478,244,702 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	476,937,873 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	490,248,647 円
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)	476,919,903 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)	477,769,455 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	18,482,885 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	22,946,508 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	3,232,856 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	9,646,171 円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	17,902,276 円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	44,928,726 円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	9,036,107 円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	28,788,479 円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4,310,209,052 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)	2,221,635,574 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	4,674,252,960 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)	2,934,933,620 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)	2,017,490,629 円
合計	608,533,464,538 円
2. 受益権の総数	608,533,464,538 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 1 月 27 日 至 2024 年 1 月 26 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和 26 年法律第 198 号)第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、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

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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 1月 26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 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 1月 26日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	△21,831,403,370
地方債証券	△363,460,622
特殊債券	△480,471,881
社債券	△112,483,000
合計	△22,787,818,873

(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 1月 26日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	731,130,000	—	731,700,000	570,000
合計		731,130,000	—	731,700,000	570,000

(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。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[2024年1月26日現在]
1口当たり純資産額	1,2747円
(1万口当たり純資産額)	(12,747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445回利付国債(2年)	2,890,000,000	2,891,734,000	
	第446回利付国債(2年)	5,100,000,000	5,102,754,000	
	第447回利付国債(2年)	1,020,000,000	1,020,530,400	
	第448回利付国債(2年)	1,800,000,000	1,800,774,000	
	第449回利付国債(2年)	2,220,000,000	2,220,732,600	
	第450回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,300,273,000	
	第451回利付国債(2年)	2,700,000,000	2,700,405,000	
	第452回利付国債(2年)	3,100,000,000	3,100,000,000	
	第453回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,299,779,000	
	第454回利付国債(2年)	1,800,000,000	1,802,682,000	
	第455回利付国債(2年)	1,850,000,000	1,849,149,000	
	第143回利付国債(5年)	5,380,000,000	5,389,146,000	
	第144回利付国債(5年)	6,380,000,000	6,390,590,800	
	第145回利付国債(5年)	6,410,000,000	6,420,512,400	
	第146回利付国債(5年)	5,150,000,000	5,157,261,500	
	第147回利付国債(5年)	4,730,000,000	4,726,925,500	
	第148回利付国債(5年)	5,100,000,000	5,095,716,000	
	第149回利付国債(5年)	6,050,000,000	6,043,587,000	
	第150回利付国債(5年)	1,930,000,000	1,926,931,300	
	第151回利付国債(5年)	750,000,000	748,237,500	

第152回利付国債（5年）	3,930,000,000	3,932,436,600	
第153回利付国債（5年）	5,620,000,000	5,601,004,400	
第154回利付国債（5年）	5,930,000,000	5,922,468,900	
第155回利付国債（5年）	2,850,000,000	2,865,418,500	
第156回利付国債（5年）	4,650,000,000	4,657,161,000	
第157回利付国債（5年）	2,020,000,000	2,020,404,000	
第158回利付国債（5年）	5,330,000,000	5,309,213,000	
第159回利付国債（5年）	1,980,000,000	1,968,813,000	
第160回利付国債（5年）	2,850,000,000	2,846,266,500	
第161回利付国債（5年）	120,000,000	120,364,800	
第162回利付国債（5年）	190,000,000	190,304,000	
第163回利付国債（5年）	11,950,000,000	12,023,851,000	
第1回利付国債（40年）	1,105,000,000	1,266,639,400	
第2回利付国債（40年）	1,335,000,000	1,475,935,950	
第3回利付国債（40年）	1,168,000,000	1,288,841,280	
第4回利付国債（40年）	1,218,000,000	1,341,042,360	
第5回利付国債（40年）	775,000,000	818,469,750	
第6回利付国債（40年）	1,230,000,000	1,268,043,900	
第7回利付国債（40年）	1,540,000,000	1,509,908,400	
第8回利付国債（40年）	1,510,000,000	1,368,981,100	
第9回利付国債（40年）	2,880,000,000	1,898,668,800	
第10回利付国債（40年）	2,720,000,000	2,104,817,600	
第11回利付国債（40年）	2,100,000,000	1,558,725,000	
第12回利付国債（40年）	2,490,000,000	1,636,502,700	
第13回利付国債（40年）	2,800,000,000	1,816,108,000	
第14回利付国債（40年）	3,070,000,000	2,124,440,000	
第15回利付国債（40年）	3,500,000,000	2,667,735,000	
第16回利付国債（40年）	2,230,000,000	1,860,756,600	
第338回利付国債（10年）	3,330,000,000	3,347,016,300	
第339回利付国債（10年）	4,020,000,000	4,043,436,600	
第340回利付国債（10年）	3,470,000,000	3,492,763,200	
第341回利付国債（10年）	3,320,000,000	3,337,230,800	
第342回利付国債（10年）	2,570,000,000	2,573,546,600	
第343回利付国債（10年）	4,870,000,000	4,876,964,100	
第344回利付国債（10年）	4,620,000,000	4,626,699,000	
第345回利付国債（10年）	6,340,000,000	6,347,291,000	

第346回利付国債（10年）	6,130,000,000	6,133,800,600	
第347回利付国債（10年）	5,700,000,000	5,699,031,000	
第348回利付国債（10年）	4,970,000,000	4,963,688,100	
第349回利付国債（10年）	6,090,000,000	6,075,871,200	
第350回利付国債（10年）	6,530,000,000	6,504,533,000	
第351回利付国債（10年）	4,870,000,000	4,842,484,500	
第352回利付国債（10年）	4,110,000,000	4,079,832,600	
第353回利付国債（10年）	4,630,000,000	4,588,654,100	
第354回利付国債（10年）	6,220,000,000	6,158,608,600	
第355回利付国債（10年）	2,740,000,000	2,710,928,600	
第356回利付国債（10年）	7,740,000,000	7,649,829,000	
第357回利付国債（10年）	5,750,000,000	5,678,470,000	
第358回利付国債（10年）	6,790,000,000	6,693,989,400	
第359回利付国債（10年）	8,550,000,000	8,413,713,000	
第360回利付国債（10年）	6,340,000,000	6,222,963,600	
第361回利付国債（10年）	6,410,000,000	6,276,800,200	
第362回利付国債（10年）	6,140,000,000	5,995,525,800	
第363回利付国債（10年）	7,920,000,000	7,707,981,600	
第364回利付国債（10年）	7,220,000,000	7,004,844,000	
第365回利付国債（10年）	7,980,000,000	7,717,138,800	
第366回利付国債（10年）	4,740,000,000	4,608,986,400	
第367回利付国債（10年）	5,540,000,000	5,371,584,000	
第368回利付国債（10年）	6,880,000,000	6,651,171,200	
第369回利付国債（10年）	6,070,000,000	6,008,571,600	
第370回利付国債（10年）	6,370,000,000	6,290,247,600	
第371回利付国債（10年）	5,010,000,000	4,890,461,400	
第372回利付国債（10年）	6,620,000,000	6,688,848,000	
第1回利付国債（30年）	196,000,000	223,304,760	
第2回利付国債（30年）	268,000,000	301,406,200	
第3回利付国債（30年）	307,000,000	344,454,000	
第4回利付国債（30年）	252,000,000	294,338,520	
第5回利付国債（30年）	238,000,000	267,735,720	
第6回利付国債（30年）	339,000,000	387,985,500	
第7回利付国債（30年）	339,000,000	386,571,870	
第8回利付国債（30年）	302,000,000	332,752,660	
第9回利付国債（30年）	206,000,000	219,909,120	

第10回利付国債（30年）	398,000,000	414,158,800	
第11回利付国債（30年）	237,000,000	259,363,320	
第12回利付国債（30年）	325,000,000	367,753,750	
第13回利付国債（30年）	595,000,000	668,089,800	
第14回利付国債（30年）	683,000,000	794,028,480	
第15回利付国債（30年）	686,000,000	805,583,520	
第16回利付国債（30年）	547,000,000	643,233,710	
第17回利付国債（30年）	577,000,000	673,191,670	
第18回利付国債（30年）	687,000,000	795,223,110	
第19回利付国債（30年）	593,000,000	686,557,610	
第20回利付国債（30年）	655,000,000	773,574,650	
第21回利付国債（30年）	529,000,000	613,486,590	
第22回利付国債（30年）	975,000,000	1,153,259,250	
第23回利付国債（30年）	194,000,000	229,620,340	
第24回利付国債（30年）	981,000,000	1,161,121,410	
第25回利付国債（30年）	1,287,000,000	1,492,521,030	
第26回利付国債（30年）	1,014,000,000	1,188,489,120	
第27回利付国債（30年）	760,000,000	900,075,600	
第28回利付国債（30年）	1,426,000,000	1,688,840,320	
第29回利付国債（30年）	830,000,000	970,958,900	
第30回利付国債（30年）	1,721,000,000	1,987,686,160	
第31回利付国債（30年）	2,223,000,000	2,530,729,890	
第32回利付国債（30年）	1,989,000,000	2,289,418,560	
第33回利付国債（30年）	1,227,000,000	1,354,693,890	
第34回利付国債（30年）	2,231,000,000	2,522,993,280	
第35回利付国債（30年）	2,379,000,000	2,612,332,320	
第36回利付国債（30年）	1,929,000,000	2,111,676,300	
第37回利付国債（30年）	2,717,000,000	2,924,307,100	
第38回利付国債（30年）	1,590,000,000	1,680,916,200	
第39回利付国債（30年）	1,360,000,000	1,458,137,600	
第40回利付国債（30年）	1,720,000,000	1,812,020,000	
第41回利付国債（30年）	1,210,000,000	1,250,898,000	
第42回利付国債（30年）	1,920,000,000	1,980,902,400	
第43回利付国債（30年）	1,690,000,000	1,741,409,800	
第44回利付国債（30年）	1,630,000,000	1,677,400,400	
第45回利付国債（30年）	1,580,000,000	1,567,518,000	

第46回利付国債（30年）	2,380,000,000	2,357,294,800	
第47回利付国債（30年）	1,900,000,000	1,912,179,000	
第48回利付国債（30年）	2,100,000,000	2,032,464,000	
第49回利付国債（30年）	2,160,000,000	2,086,560,000	
第50回利付国債（30年）	1,910,000,000	1,628,275,000	
第51回利付国債（30年）	2,460,000,000	1,859,268,000	
第52回利付国債（30年）	2,020,000,000	1,595,012,200	
第53回利付国債（30年）	1,950,000,000	1,570,647,000	
第54回利付国債（30年）	1,870,000,000	1,572,239,900	
第55回利付国債（30年）	1,940,000,000	1,624,691,800	
第56回利付国債（30年）	1,840,000,000	1,534,854,400	
第57回利付国債（30年）	2,040,000,000	1,696,341,600	
第58回利付国債（30年）	2,280,000,000	1,889,983,200	
第59回利付国債（30年）	1,960,000,000	1,581,171,200	
第60回利付国債（30年）	1,730,000,000	1,460,466,000	
第61回利付国債（30年）	1,820,000,000	1,458,311,400	
第62回利付国債（30年）	1,370,000,000	1,038,405,200	
第63回利付国債（30年）	1,960,000,000	1,439,208,400	
第64回利付国債（30年）	2,080,000,000	1,521,083,200	
第65回利付国債（30年）	1,510,000,000	1,099,748,100	
第66回利付国債（30年）	1,900,000,000	1,377,006,000	
第67回利付国債（30年）	2,840,000,000	2,170,100,800	
第68回利付国債（30年）	2,060,000,000	1,568,278,000	
第69回利付国債（30年）	1,890,000,000	1,474,540,200	
第70回利付国債（30年）	1,990,000,000	1,547,185,200	
第71回利付国債（30年）	1,960,000,000	1,518,510,000	
第72回利付国債（30年）	1,910,000,000	1,474,558,200	
第73回利付国債（30年）	2,030,000,000	1,563,120,300	
第74回利付国債（30年）	3,040,000,000	2,535,998,400	
第75回利付国債（30年）	2,370,000,000	2,131,341,000	
第76回利付国債（30年）	2,070,000,000	1,904,503,500	
第77回利付国債（30年）	2,040,000,000	1,966,172,400	
第78回利付国債（30年）	2,360,000,000	2,165,087,600	
第79回利付国債（30年）	2,030,000,000	1,767,013,500	
第80回利付国債（30年）	2,200,000,000	2,212,826,000	
第75回利付国債（20年）	705,000,000	722,237,250	

第76回利付国債（20年）	410,000,000	419,093,800	
第77回利付国債（20年）	370,000,000	378,628,400	
第78回利付国債（20年）	310,000,000	318,267,700	
第79回利付国債（20年）	150,000,000	154,209,000	
第80回利付国債（20年）	585,000,000	602,228,250	
第81回利付国債（20年）	250,000,000	258,205,000	
第82回利付国債（20年）	1,082,000,000	1,119,285,720	
第83回利付国債（20年）	395,000,000	410,484,000	
第84回利付国債（20年）	880,000,000	912,832,800	
第85回利付国債（20年）	520,000,000	542,926,800	
第86回利付国債（20年）	1,047,000,000	1,097,632,920	
第87回利付国債（20年）	420,000,000	439,416,600	
第88回利付国債（20年）	1,264,000,000	1,332,180,160	
第89回利付国債（20年）	340,000,000	357,527,000	
第90回利付国債（20年）	1,270,000,000	1,342,186,800	
第91回利付国債（20年）	548,000,000	580,595,040	
第92回利付国債（20年）	1,282,000,000	1,357,458,520	
第93回利付国債（20年）	190,000,000	201,413,300	
第94回利付国債（20年）	875,000,000	930,300,000	
第95回利付国債（20年）	1,107,000,000	1,189,250,100	
第96回利付国債（20年）	340,000,000	362,967,000	
第97回利付国債（20年）	573,000,000	615,980,730	
第98回利付国債（20年）	610,000,000	653,547,900	
第99回利付国債（20年）	1,480,000,000	1,591,310,800	
第100回利付国債（20年）	1,030,000,000	1,114,975,000	
第101回利付国債（20年）	723,000,000	788,583,330	
第102回利付国債（20年）	520,000,000	569,275,200	
第103回利付国債（20年）	760,000,000	828,711,600	
第104回利付国債（20年）	610,000,000	659,849,200	
第105回利付国債（20年）	920,000,000	997,850,400	
第106回利付国債（20年）	571,000,000	621,938,910	
第107回利付国債（20年）	607,000,000	660,452,420	
第108回利付国債（20年）	1,000,000,000	1,078,410,000	
第109回利付国債（20年）	560,000,000	605,936,800	
第110回利付国債（20年）	876,000,000	956,732,160	
第111回利付国債（20年）	861,000,000	948,503,430	

第1 1 2 回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,151,146,500	
第1 1 3 回利付国債（20年）	922,000,000	1,014,338,300	
第1 1 4 回利付国債（20年）	1,600,000,000	1,766,688,000	
第1 1 5 回利付国債（20年）	944,000,000	1,047,811,680	
第1 1 6 回利付国債（20年）	461,000,000	513,314,280	
第1 1 7 回利付国債（20年）	1,320,000,000	1,461,847,200	
第1 1 8 回利付国債（20年）	520,000,000	574,152,800	
第1 1 9 回利付国債（20年）	400,000,000	436,516,000	
第1 2 0 回利付国債（20年）	780,000,000	841,456,200	
第1 2 1 回利付国債（20年）	1,299,000,000	1,428,276,480	
第1 2 2 回利付国債（20年）	100,000,000	109,304,000	
第1 2 3 回利付国債（20年）	1,318,000,000	1,469,714,980	
第1 2 4 回利付国債（20年）	1,240,000,000	1,374,416,000	
第1 2 5 回利付国債（20年）	1,844,000,000	2,072,877,280	
第1 2 6 回利付国債（20年）	200,000,000	221,972,000	
第1 2 7 回利付国債（20年）	440,000,000	485,289,200	
第1 2 8 回利付国債（20年）	1,974,000,000	2,178,684,060	
第1 2 9 回利付国債（20年）	280,000,000	307,031,200	
第1 3 0 回利付国債（20年）	1,862,000,000	2,043,898,780	
第1 3 1 回利付国債（20年）	420,000,000	457,934,400	
第1 3 2 回利付国債（20年）	187,000,000	203,955,290	
第1 3 3 回利付国債（20年）	2,320,000,000	2,547,963,200	
第1 3 4 回利付国債（20年）	4,545,000,000	4,997,182,050	
第1 3 5 回利付国債（20年）	50,000,000	54,584,500	
第1 3 6 回利付国債（20年）	190,000,000	205,857,400	
第1 3 7 回利付国債（20年）	4,342,000,000	4,742,375,820	
第1 3 8 回利付国債（20年）	160,000,000	172,118,400	
第1 3 9 回利付国債（20年）	310,000,000	336,098,900	
第1 4 0 回利付国債（20年）	2,817,000,000	3,079,150,020	
第1 4 1 回利付国債（20年）	1,120,000,000	1,224,496,000	
第1 4 2 回利付国債（20年）	3,090,000,000	3,405,828,900	
第1 4 3 回利付国債（20年）	1,740,000,000	1,887,447,600	
第1 4 4 回利付国債（20年）	1,520,000,000	1,635,656,800	
第1 4 5 回利付国債（20年）	3,100,000,000	3,392,516,000	
第1 4 6 回利付国債（20年）	3,420,000,000	3,742,369,200	
第1 4 7 回利付国債（20年）	3,450,000,000	3,742,387,500	

第148回利付国債（20年）	3,360,000,000	3,610,992,000	
第149回利付国債（20年）	3,440,000,000	3,695,764,000	
第150回利付国債（20年）	3,750,000,000	3,988,237,500	
第151回利付国債（20年）	3,780,000,000	3,937,361,400	
第152回利付国債（20年）	3,110,000,000	3,235,550,700	
第153回利付国債（20年）	3,980,000,000	4,176,811,000	
第154回利付国債（20年）	3,510,000,000	3,640,115,700	
第155回利付国債（20年）	3,600,000,000	3,646,476,000	
第156回利付国債（20年）	3,100,000,000	2,919,208,000	
第157回利付国債（20年）	3,630,000,000	3,320,832,900	
第158回利付国債（20年）	2,960,000,000	2,800,189,600	
第159回利付国債（20年）	2,850,000,000	2,719,812,000	
第160回利付国債（20年）	3,630,000,000	3,495,399,600	
第161回利付国債（20年）	3,120,000,000	2,955,170,400	
第162回利付国債（20年）	3,580,000,000	3,377,694,200	
第163回利付国債（20年）	3,330,000,000	3,129,367,500	
第164回利付国債（20年）	3,890,000,000	3,589,069,600	
第165回利付国債（20年）	3,160,000,000	2,902,807,600	
第166回利付国債（20年）	3,720,000,000	3,501,450,000	
第167回利付国債（20年）	2,910,000,000	2,649,293,100	
第168回利付国債（20年）	2,660,000,000	2,373,704,200	
第169回利付国債（20年）	2,720,000,000	2,377,280,000	
第170回利付国債（20年）	2,150,000,000	1,868,092,000	
第171回利付国債（20年）	2,720,000,000	2,350,923,200	
第172回利付国債（20年）	2,360,000,000	2,062,923,200	
第173回利付国債（20年）	3,150,000,000	2,739,208,500	
第174回利付国債（20年）	4,670,000,000	4,039,690,100	
第175回利付国債（20年）	2,920,000,000	2,557,511,200	
第176回利付国債（20年）	2,930,000,000	2,553,172,700	
第177回利付国債（20年）	3,140,000,000	2,674,683,400	
第178回利付国債（20年）	3,420,000,000	2,953,204,200	
第179回利付国債（20年）	3,240,000,000	2,784,942,000	
第180回利付国債（20年）	3,780,000,000	3,414,889,800	
第181回利付国債（20年）	2,850,000,000	2,612,937,000	
第182回利付国債（20年）	2,680,000,000	2,534,904,800	
第183回利付国債（20年）	2,870,000,000	2,848,704,600	

	第184回利付国債（20年）	2,740,000,000	2,577,024,800	
	第185回利付国債（20年）	3,880,000,000	3,638,664,000	
	第186回利付国債（20年）	2,760,000,000	2,766,292,800	
	第1回大韓民国	100,000,000	100,367,000	
	第2回大韓民国	100,000,000	100,807,000	
国債証券 合計		663,789,000,000	648,869,193,030	
地方債証券	第5回東京都公募公債（20年）	100,000,000	102,328,000	
	第7回東京都公募公債（20年）	100,000,000	103,360,000	
	第7回東京都公募公債（30年）	80,000,000	93,295,200	
	第10回東京都公募公債（30年）	100,000,000	113,426,000	
	第12回東京都公募公債（20年）	100,000,000	107,431,000	
	第20回東京都公募公債（20年）	80,000,000	87,392,000	
	第21回東京都公募公債（20年）	80,000,000	88,164,800	
	第28回東京都公募公債（20年）	100,000,000	107,176,000	
	第33回東京都公募公債（20年）	100,000,000	89,923,000	
	第747回東京都公募公債	500,000,000	502,915,000	
	第750回東京都公募公債	200,000,000	201,148,000	
	第751回東京都公募公債	500,000,000	502,170,000	
	第757回東京都公募公債	150,000,000	149,569,500	
	第758回東京都公募公債	150,000,000	149,569,500	
	第782回東京都公募公債	100,000,000	99,502,000	
	第783回東京都公募公債	400,000,000	397,836,000	
	第807回東京都公募公債	200,000,000	195,280,000	
	第809回東京都公募公債	100,000,000	97,395,000	
	平成27年度第1回北海道公募公債	300,000,000	301,278,000	
	平成27年度第5回北海道公募公債	100,000,000	100,679,000	
	平成30年度第14回北海道公募公債	100,000,000	98,984,000	
	令和3年度第14回北海道公募公債（5年）	400,000,000	397,764,000	
	第36回2号宮城県公募公債	342,000,000	333,453,420	
	第2回神奈川県公募公債（30年）	180,000,000	217,837,800	
	第3回神奈川県公募公債（20年）	500,000,000	514,090,000	
	第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	118,163,000	
	第20回神奈川県公募公債（20年）	500,000,000	540,880,000	
	第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	104,948,000	
	第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,015,000	
	第234回神奈川県公募公債	100,000,000	99,606,000	

第243回神奈川県公募公債	100,000,000	97,956,000	
第256回神奈川県公募公債	350,000,000	339,041,500	
第7回大阪府公募公債（20年）	220,000,000	239,701,000	
第11回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	108,052,000	
第179回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	99,696,000	
第184回大阪府公募公債（5年）	120,000,000	119,539,200	
第186回大阪府公募公債（5年）	300,000,000	298,770,000	
第191回大阪府公募公債（5年）	160,000,000	159,105,600	
第393回大阪府公募公債	110,000,000	110,468,600	
第400回大阪府公募公債	136,000,000	136,909,840	
第407回大阪府公募公債	200,000,000	199,708,000	
第410回大阪府公募公債	200,000,000	199,206,000	
第415回大阪府公募公債	100,000,000	99,890,000	
第417回大阪府公募公債	300,000,000	300,522,000	
第420回大阪府公募公債	100,000,000	99,851,000	
第426回大阪府公募公債	100,000,000	99,604,000	
第435回大阪府公募公債	130,000,000	128,962,600	
第439回大阪府公募公債	100,000,000	98,975,000	
第455回大阪府公募公債	148,000,000	144,779,520	
第460回大阪府公募公債	194,000,000	188,878,400	
第464回大阪府公募公債	800,000,000	773,960,000	
第465回大阪府公募公債	500,000,000	484,855,000	
第467回大阪府公募公債	200,000,000	194,116,000	
第471回大阪府公募公債	97,000,000	93,159,770	
第483回大阪府公募公債	200,000,000	200,704,000	
平成26年度第2回京都府公募公債（15年）	200,000,000	206,684,000	
平成26年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	105,449,000	
第1回兵庫県公募公債（15年）	400,000,000	414,908,000	
第2回兵庫県公募公債（20年）	300,000,000	322,824,000	
第2回兵庫県公募公債（30年）	90,000,000	102,318,300	
第4回兵庫県公募公債（12年）	300,000,000	304,299,000	
第5回兵庫県公募公債（12年）	400,000,000	406,244,000	
第5回兵庫県公募公債（15年）	200,000,000	208,228,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	104,329,000	
第9回兵庫県公募公債（15年）	800,000,000	825,392,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	200,000,000	220,666,000	

第27回兵庫県公募公債（20年）	200,000,000	184,774,000	
平成28年度第29回兵庫県公募公債	100,000,000	100,141,000	
令和5年度第4回兵庫県公募公債（グリーン）	100,000,000	98,829,000	
令和5年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	100,000,000	
第1回静岡県公募公債（15年）	100,000,000	104,134,000	
第6回静岡県公募公債（15年）	300,000,000	310,269,000	
第11回静岡県公募公債（20年）	550,000,000	597,982,000	
第14回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	108,414,000	
平成27年度第10回静岡県公募公債	400,000,000	402,240,000	
令和2年度第15回静岡県公募公債（5年）	120,000,000	119,653,200	
令和2年度第13回静岡県公募公債（5年）	120,000,000	119,653,200	
平成20年度第8回愛知県公募公債（20年）	200,000,000	215,844,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	700,000,000	769,286,000	
平成23年度第13回愛知県公募公債	500,000,000	518,985,000	
平成24年度第14回愛知県公募公債（15年）	300,000,000	311,955,000	
平成27年度第7回愛知県公募公債	100,000,000	100,668,000	
平成27年度第16回愛知県公募公債	100,000,000	100,599,000	
平成29年度第5回愛知県公募公債	600,000,000	599,694,000	
平成30年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	99,349,000	
平成30年度第8回愛知県公募公債	200,000,000	198,990,000	
令和3年度第18回愛知県公募公債	100,000,000	96,859,000	
令和5年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	99,660,000	
平成23年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	108,989,000	
平成26年度第7回広島県公募公債	260,000,000	261,157,000	
平成28年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,849,000	
平成28年度第4回広島県公募公債	100,000,000	99,704,000	
平成28年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	92,173,000	
平成30年度第4回広島県公募公債	200,000,000	198,800,000	
令和3年度第7回広島県公募公債	100,000,000	96,633,000	
第2回埼玉県公募公債（サステナビリティ）	100,000,000	99,795,000	
第3回埼玉県公募公債	200,000,000	201,170,000	
第9回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	220,812,000	
第10回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	109,434,000	
第14回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	213,128,000	
第16回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	102,454,000	
平成30年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,393,000	

令和2年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	98,014,000	
令和3年度第2回埼玉県公募公債(5年)	110,000,000	109,671,100	
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	70,000,000	82,676,300	
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	80,000,000	90,833,600	
平成22年度第2回福岡県公募公債(20年)	800,000,000	886,352,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	103,727,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	100,618,000	
令和2年度第4回福岡県公募公債	200,000,000	195,240,000	
令和5年度第1回福岡県公募公債(グリーン)	100,000,000	99,095,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	98,831,000	
第9回千葉県公募公債(20年)	80,000,000	86,952,800	
第13回千葉県公募公債(20年)	300,000,000	324,639,000	
第14回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	103,154,000	
平成27年度第3回千葉県公募公債	200,000,000	201,208,000	
平成27年度第6回千葉県公募公債	500,000,000	503,135,000	
平成28年度第3回千葉県公募公債	400,000,000	399,004,000	
平成30年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	98,749,000	
令和元年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	98,218,000	
令和5年度第7回千葉県公募公債(サステナビリティ)	100,000,000	99,437,000	
令和5年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	100,541,000	
平成27年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	100,132,000	
令和4年度第1回長野県公募公債	300,000,000	290,976,000	
令和5年度第2回長野県公募公債	100,000,000	99,615,000	
第2回群馬県公募公債(20年)	100,000,000	110,294,000	
第7回群馬県公募公債(20年)	100,000,000	91,530,000	
平成27年度第1回岐阜県公募公債	300,000,000	301,980,000	
令和2年度第2回岐阜県公募公債(5年)	100,000,000	99,790,000	
平成27年度第1回大分県公募公債	203,400,000	204,634,638	
第144回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,914,000	
第145回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,405,000	
第148回共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,360,000	
第150回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,294,000	
第151回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,184,000	
第152回共同発行市場公募地方債	700,000,000	704,613,000	
第153回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,254,000	

第158回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,698,000	
第172回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,000,000	
第173回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,644,000	
第185回共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,353,000	
第193回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,411,000	
第198回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,930,000	
第232回共同発行市場公募地方債	450,000,000	437,548,500	
令和元年度第3回堺市公募公債	100,000,000	98,101,000	
平成27年度第1回長崎県公募公債	300,000,000	301,980,000	
平成27年度第1回佐賀県公募公債	500,000,000	503,125,000	
平成29年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	99,710,000	
平成30年度第1回福島県公募公債	100,000,000	99,397,000	
第2回滋賀県公募公債（サステナビリティ）	100,000,000	99,866,000	
令和元年度第2回栃木県公募公債	100,000,000	98,055,000	
令和2年度第2回栃木県公募公債	100,000,000	97,419,000	
令和3年度第1回熊本県公募公債（5年）	200,000,000	199,274,000	
令和5年度第2回奈良県公募公債	200,000,000	199,422,000	
第5回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	109,569,000	
第15回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	110,708,000	
令和2年度第3回大阪市公募公債（5年）	500,000,000	499,150,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	116,616,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	108,066,000	
第9回名古屋市公募公債（30年）	90,000,000	97,857,900	
第28回名古屋市公募公債（5年）	500,000,000	498,770,000	
第491回名古屋市公募公債	400,000,000	402,768,000	
第511回名古屋市公募公債	100,000,000	97,696,000	
第1回京都市公募公債（15年）	100,000,000	101,598,000	
第3回京都市公募公債（20年）	100,000,000	103,677,000	
第5回京都市公募公債（20年）	50,000,000	53,136,500	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	110,000,000	116,271,100	
平成20年度第24回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	216,228,000	
平成22年度第4回神戸市公募公債	100,000,000	109,009,000	
平成23年度第4回神戸市公募公債（20年）	150,000,000	164,344,500	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	102,902,000	
第7回横浜市公募公債（20年）	450,000,000	466,335,000	
第19回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	219,568,000	

	平成27年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	201,322,000	
	平成27年度第3回横浜市公募公債	400,000,000	402,588,000	
	平成27年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	301,869,000	
	第27回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	107,287,000	
	第33回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	91,818,000	
	第35回横浜市公募公債(20年)	500,000,000	461,985,000	
	第54回横浜市公募公債(5年)	300,000,000	299,370,000	
	平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)	80,000,000	90,032,800	
	平成23年度第3回札幌市公募公債	100,000,000	109,755,000	
	平成23年度第9回札幌市公募公債	600,000,000	623,826,000	
	令和2年度第7回札幌市公募公債	200,000,000	194,478,000	
	令和3年度第2回札幌市公募公債(5年)	100,000,000	99,665,000	
	令和3年度第9回札幌市公募公債(5年)	100,000,000	99,643,000	
	第7回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	108,931,000	
	第12回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	110,389,000	
	第62回川崎市公募公債(5年)	490,000,000	488,221,300	
	第3回北九州市公募公債(サステナビリティ)	100,000,000	99,392,000	
	第17回北九州市公募公債(20年)	100,000,000	106,237,000	
	令和3年度第4回千葉市公募公債	100,000,000	96,057,000	
	令和5年度第4回千葉市公募公債(サステナビリティ)	100,000,000	99,973,000	
	平成26年度第4回福井県公募公債	100,000,000	100,427,000	
	令和2年度第2回徳島県公募公債	100,000,000	97,419,000	
	平成28年度第1回山梨県公募公債	200,000,000	199,450,000	
	平成30年度第1回山梨県公募公債	100,000,000	99,571,000	
	令和2年度第1回山梨県公募公債	700,000,000	682,500,000	
	第96回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	100,000,000	108,529,000	
地方債証券 合計		40,880,400,000	41,609,810,988	
特殊債券	第4回政府保証新関西国際空港債券	904,000,000	909,396,880	
	第21回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券	600,000,000	599,532,000	
	第6回神奈川県住宅供給公社債券	100,000,000	98,073,000	
	第36回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	30,000,000	31,942,500	
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	100,000,000	121,237,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	140,000,000	146,764,800	

第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	300,000,000	316,917,000	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	30,000,000	35,751,600	
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	233,934,000	
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	212,938,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	110,000,000	127,000,500	
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	300,000,000	321,750,000	
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	214,906,000	
第28回道路債券（財投機関債）	100,000,000	117,841,000	
第33回道路債券（財投機関債）	300,000,000	356,778,000	
第42回道路債券（財投機関債）	200,000,000	204,814,000	
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	150,000,000	163,470,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	108,028,000	
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,456,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,907,000	
第116回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,855,000	
第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,318,000	
第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	96,824,000	
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,007,000	
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	300,000,000	303,144,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	99,873,000	
第158回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,831,000	
第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	102,383,000	
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,634,000	
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	105,017,000	
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,203,000	
第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,974,000	

第247回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,250,000,000	1,257,762,500	
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	101,615,090	
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,746,000	
第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,520,000	
第263回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,066,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,446,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,182,000	
第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	299,424,000	
第276回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	299,403,000	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,357,000	
第443回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	297,978,000	
第1回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	50,000,000	54,757,500	
第4回公営企業債券（30年）（財投機関債）	100,000,000	119,464,000	
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	108,333,000	
第12回公営企業債券（20年）（財投機関債）	300,000,000	306,615,000	
第13回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	110,359,000	
第14回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	80,000,000	88,675,200	
第16回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	80,000,000	86,844,800	
第17回公営企業債券（20年）（財投機関債）	150,000,000	157,068,000	
第22回公営企業債券（20年）（財投機関債）	1,000,000,000	1,068,700,000	
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	107,422,000	
第24回公営企業債券（20年）（財投機関債）	300,000,000	323,988,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	200,000,000	215,218,000	
第27回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	50,000,000	54,167,500	
第27回地方公共団体金融機構債券（5年）（財投機関債）	100,000,000	99,860,000	
第44回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	102,692,000	

第73回政府保証地方公共団体金融機構債券	302,000,000	303,802,940	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	400,000,000	402,276,000	
第77回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,516,000	
第77回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	300,000,000	301,734,000	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	150,789,000	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,088,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	674,000,000	672,847,460	
第83回政府保証地方公共団体金融機構債券	102,000,000	101,807,220	
F90回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	105,033,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	299,655,000	
第94回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,999,000	
第100回政府保証地方公共団体金融機構債券	325,000,000	323,648,000	
第101回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,839,000	
第102回政府保証地方公共団体金融機構債券	131,000,000	130,693,460	
F104回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	101,345,000	
第108回政府保証地方公共団体金融機構債券	223,000,000	221,624,090	
第115回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,168,000	
F131回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	70,000,000	74,456,200	
F151回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	103,862,000	
F203回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	200,000,000	205,748,000	
F234回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	106,069,000	
第27回首都高速道路	100,000,000	99,697,000	
第24回阪神高速道路	200,000,000	199,782,000	
第10回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	87,889,600	
第15回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	86,896,800	
第48回福祉医療機構債券（財投機関債）	400,000,000	399,480,000	
第54回福祉医療機構債券（財投機関債）	100,000,000	99,223,000	
第4回中部国際空港（財投機関債）	200,000,000	200,020,000	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	31,247,000	31,031,083	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	32,560,000	32,397,200	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	37,664,000	37,331,050	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	53,950,000	53,346,839	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,078,000	10,114,986	

第 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,448,000	19,325,940	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,522,000	19,357,342	
第 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,736,000	19,539,024	
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,095,000	18,890,999	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,738,000	36,149,404	
第 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,074,000	37,496,037	
第 3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,594,000	20,324,464	
第 4 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,000,000	39,064,760	
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,535,000	23,402,822	
第 4 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,728,000	89,455,453	
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,277,000	55,334,557	
第 4 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,495,000	16,069,399	
第 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,022,000	34,311,839	
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,676,000	34,918,307	
第 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,834,000	36,055,976	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,714,000	38,006,699	
第 5 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,424,000	40,702,914	
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,400,000	42,736,806	
第 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,335,000	24,073,786	
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,497,000	24,259,007	
第 5 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,844,000	51,486,858	
第 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,630,000	52,100,801	
第 6 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,146,000	52,470,169	
第 6 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,773,000	29,439,670	
第 6 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,441,000	28,976,544	
第 6 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,424,000	201,285,613	
第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,557,000	96,303,467	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,585,000	30,329,654	
第 7 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,273,000	34,191,667	
第 7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,102,000	28,766,050	
第 7 7 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	30,000,000	31,104,900	
第 7 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,317,000	29,834,151	
第 8 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,077,000	33,593,331	
第 8 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,831,000	36,286,412	
第 8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	139,996,000	141,632,553	

第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,010,000	73,845,234	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	108,601,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,105,000	39,349,406	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	120,276,000	120,466,036	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,546,000	42,225,628	
第93回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	200,000,000	207,716,000	
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,567,000	53,220,421	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,168,000	50,579,568	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,446,000	52,246,705	
第100回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	200,000,000	217,912,000	
第102回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	103,744,000	
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,636,000	55,148,628	
第106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	116,682,000	113,173,372	
第107回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	120,300,000	116,046,192	
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	255,772,000	245,362,079	
第110回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	324,355,000	308,889,753	
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	526,648,000	499,994,344	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	136,376,000	131,117,341	
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	473,879,000	456,274,395	
第121回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	130,000,000	143,015,600	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	211,116,000	202,255,461	
第123回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	108,255,000	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,126,000	67,013,106	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,253,000	68,837,600	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,825,000	67,628,667	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	144,994,000	138,637,463	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,020,000	138,320,076	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,412,000	68,886,259	
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,801,000	68,334,447	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	219,015,000	208,627,118	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,567,000	69,848,923	
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,625,000	71,076,581	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,166,000	143,289,898	

第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,558,000	142,110,582	
第143回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	103,479,000	
第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,710,000	146,933,675	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	239,442,000	221,859,773	
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	244,128,000	227,063,452	
第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,062,000	153,969,833	
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,134,000	77,077,009	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,820,000	154,620,938	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,320,000	80,099,269	
第161回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	101,488,000	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	172,712,000	161,829,416	
第164回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	100,570,000	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,948,000	81,462,450	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	261,657,000	245,709,005	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,266,000	166,202,828	
第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,230,000	165,958,172	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,958,000	167,681,265	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,362,000	83,237,128	
第174回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	180,000,000	180,810,000	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,299,000	85,366,390	
第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,346,000	169,698,481	
第177回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,816,000	171,276,654	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,469,000	86,357,712	
第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,508,000	172,734,245	
第180回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,885,000	86,948,018	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,641,000	87,573,537	
第182回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,978,000	176,596,981	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,356,000	177,300,603	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,992,000	177,411,810	
第186回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,021,000	91,789,335	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,236,000	189,105,630	
第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,157,000	95,622,367	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,576,000	95,538,773	
第192回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	387,396,000	386,102,097	

第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,289,000	96,262,601	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,029,000	96,820,302	
第194回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	99,646,000	
第195回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,982,000	194,287,286	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	296,349,000	294,778,350	
第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,828,000	197,717,216	
第198回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,926,000	200,543,268	
第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	399,576,000	400,443,079	
第200回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,484,000	
第201回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	298,071,000	
第203回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	99,968,000	
第6回沖繩振興開発金融公庫債券（財投機関債）	50,000,000	51,331,500	
い第843号商工債券	200,000,000	199,640,000	
い第848号商工債券	100,000,000	99,635,000	
い第850号商工債券	300,000,000	298,740,000	
い第852号商工債券	100,000,000	99,502,000	
い第854号商工債券	500,000,000	497,145,000	
い第857号商工債券	100,000,000	99,346,000	
い第871号商工債券	200,000,000	199,116,000	
い第872号商工債券	400,000,000	399,532,000	
第376回信金中金債	100,000,000	99,644,000	
第280号商工債券（3年）	200,000,000	199,606,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	100,547,000	
第7回国際協力機構債券（財投機関債）	70,000,000	76,601,700	
第83回東日本高速道路	400,000,000	398,284,000	
第29回西日本高速道路	200,000,000	200,358,000	
第56回西日本高速道路	900,000,000	898,227,000	
第61回西日本高速道路	700,000,000	696,829,000	
第72回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	102,285,000	
特殊債券 合計	35,542,287,000	35,817,564,204	
社債券			
第19回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	100,523,000	
第29回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	199,612,000	
第35回フランス相互信用連合銀行	500,000,000	492,185,000	
第38回フランス相互信用連合銀行	300,000,000	300,564,000	

第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	100,000,000	98,228,000	
第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	200,000,000	199,200,000	
第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	200,000,000	197,756,000	
第36回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	400,000,000	399,980,000	
第1回サンタンデール銀行(2019)	500,000,000	498,785,000	
第12回新関西国際空港	100,000,000	102,748,000	
第27回新関西国際空港	100,000,000	99,626,000	
第32回成田国際空港	100,000,000	98,367,000	
第1回国際石油開発帝石	100,000,000	99,439,000	
第48回鹿島建設(サステナビリティ)	100,000,000	100,168,000	
第10回明治ホールディングス(サステナビリティ)	200,000,000	198,892,000	
第16回アサヒグループホールディングス	100,000,000	99,514,000	
第19回アサヒグループホールディングス	400,000,000	399,872,000	
第21回麒麟ホールディングス(ソーシャル)	300,000,000	298,668,000	
第22回麒麟ホールディングス(ソーシャル)	100,000,000	100,334,000	
第9回サントリーホールディングス	500,000,000	498,770,000	
第22回味の素	100,000,000	100,091,000	
第3回 キュービー	100,000,000	99,887,000	
第13回日本たばこ産業	400,000,000	395,932,000	
第16回日本たばこ産業	300,000,000	296,976,000	
第6回ヒューリック	400,000,000	395,040,000	
第24回森ヒルズリート投資法人(グリーン)	300,000,000	300,792,000	
第27回東急不動産ホールディングス(グリーン)	300,000,000	299,844,000	
第9回クラレ	100,000,000	99,665,000	
第22回旭化成	100,000,000	100,155,000	
第42回王子ホールディングス	300,000,000	298,332,000	
第4回野村総合研究所	100,000,000	98,917,000	
第12回野村総合研究所	200,000,000	199,894,000	
第6回花王	200,000,000	199,492,000	
第1回アステラス製薬	400,000,000	399,724,000	
第17回Zホールディングス	100,000,000	99,725,000	
第22回Zホールディングス	200,000,000	198,852,000	
第7回住友三井オートサービス(サステナビリティ)	100,000,000	99,159,000	
第8回住友三井オートサービス(サステナビリティ)	100,000,000	99,948,000	

第11回ブリヂストン	500,000,000	497,940,000	
第12回日本電気硝子	100,000,000	98,754,000	
第4回新日本製鐵	200,000,000	199,450,000	
第36回ジェイ エフ イー ホールディングス	400,000,000	398,092,000	
第1回住友生命2023基金	400,000,000	397,276,000	
第14回LIXIL	200,000,000	199,238,000	
第1回日本郵政(グリーン)	100,000,000	99,367,000	
第4回日本郵政	500,000,000	501,440,000	
第30回ダイキン工業	200,000,000	197,248,000	
第55回日本精工	100,000,000	99,906,000	
第19回日立製作所	100,000,000	99,243,000	
第17回パナソニック	500,000,000	500,825,000	
第22回パナソニック	100,000,000	98,749,000	
第24回パナソニックホールディングス	300,000,000	299,436,000	
第25回パナソニックホールディングス	400,000,000	400,212,000	
第18回デンソー	300,000,000	297,873,000	
第40回三菱重工業	300,000,000	297,924,000	
第27回J A三井リース	100,000,000	99,942,000	
第26回トヨタ自動車(サステナビリティ)	800,000,000	796,000,000	
第27回トヨタ自動車(サステナビリティ)	100,000,000	96,471,000	
第31回トヨタ自動車(サステナビリティ)	200,000,000	195,896,000	
第4回ヤマハ発動機	100,000,000	99,902,000	
第1回明治安田生命2019基金	200,000,000	199,870,000	
第7回アシックス	100,000,000	100,386,000	
第63回三井物産	400,000,000	425,116,000	
第51回住友商事	100,000,000	102,734,000	
第61回住友商事	100,000,000	100,306,000	
第43回丸井グループ	100,000,000	99,912,000	
第44回丸井グループ	100,000,000	99,610,000	
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	300,000,000	299,940,000	
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	500,000,000	489,075,000	
第23回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	200,000,000	219,726,000	
第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	200,000,000	204,086,000	
第29回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	200,000,000	205,296,000	
第30回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	100,000,000	107,731,000	
第88回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	106,134,000	

第15回みずほフィナンシャルグループ劣後特約付	100,000,000	97,658,000	
第18回みずほ銀行(劣後特約付)	100,000,000	103,161,000	
第38回芙蓉総合リース(サステナビリティ)	400,000,000	401,604,000	
第7回みずほリース	200,000,000	197,916,000	
第21回みずほリース	300,000,000	298,635,000	
第22回みずほリース(サステナビリティ)	300,000,000	299,646,000	
第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	1,200,000,000	1,196,568,000	
第17回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	300,000,000	297,669,000	
第25回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン)	300,000,000	298,170,000	
第26回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン)	200,000,000	196,108,000	
第28回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン)	300,000,000	300,447,000	
第29回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン)	300,000,000	301,656,000	
第30回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン)	200,000,000	202,296,000	
第53回日産フィナンシャルサービス	300,000,000	297,471,000	
第56回日産フィナンシャルサービス	500,000,000	497,375,000	
第57回日産フィナンシャルサービス	400,000,000	394,936,000	
第30回東京センチュリー	100,000,000	98,875,000	
第34回東京センチュリー	300,000,000	294,432,000	
第96回トヨタファイナンス	800,000,000	795,856,000	
第22回ポケットカード	100,000,000	99,576,000	
第24回ポケットカード	300,000,000	300,594,000	
第79回アコム	300,000,000	299,862,000	
第189回オリックス	200,000,000	200,094,000	
第220回オリックス	400,000,000	400,892,000	
第34回三井住友ファイナンス&リース	300,000,000	300,507,000	
第3回野村ホールディングス	200,000,000	198,120,000	
第24回野村ホールディングス	100,000,000	102,453,000	
第27回野村ホールディングス	100,000,000	102,477,000	
第83回三井不動産(グリーン)	200,000,000	194,822,000	
第137回三菱地所	300,000,000	299,496,000	
第142回三菱地所(サステナビリティ)	200,000,000	199,316,000	
第143回三菱地所	100,000,000	98,438,000	
第111回住友不動産(グリーン)	100,000,000	99,825,000	

第13回森トラスト総合リート投資法人	200,000,000	199,994,000	
第20回森トラストリート投資法人	200,000,000	200,140,000	
第76回東京急行電鉄	200,000,000	207,926,000	
第36回京王電鉄	200,000,000	199,436,000	
第53回東日本旅客鉄道	300,000,000	323,466,000	
第71回東日本旅客鉄道	400,000,000	431,092,000	
第100回東日本旅客鉄道	200,000,000	205,770,000	
第163回東日本旅客鉄道	600,000,000	597,024,000	
第73回西日本旅客鉄道	400,000,000	398,000,000	
第42回東海旅客鉄道	100,000,000	108,833,000	
第53回東海旅客鉄道	100,000,000	107,104,000	
第28回東京地下鉄	300,000,000	296,766,000	
第50回阪急阪神ホールディングス	200,000,000	198,052,000	
第58回阪急阪神ホールディングス	200,000,000	199,232,000	
第68回名古屋鉄道（サステナビリティ）	200,000,000	198,206,000	
第1回横浜高速鉄道	300,000,000	301,080,000	
第31回KDDI（サステナビリティ）	200,000,000	199,388,000	
第9回ソフトバンク	600,000,000	590,556,000	
第13回ソフトバンク	500,000,000	468,810,000	
第16回ソフトバンク	500,000,000	465,885,000	
第21回ソフトバンク	700,000,000	694,295,000	
第22回ソフトバンク	300,000,000	295,389,000	
第548回東京電力	100,000,000	103,045,000	
第567回東京電力	100,000,000	100,630,000	
第508回関西電力	200,000,000	200,064,000	
第510回関西電力	500,000,000	499,915,000	
第511回関西電力	100,000,000	99,607,000	
第518回関西電力	200,000,000	198,418,000	
第524回関西電力	200,000,000	198,422,000	
第393回中国電力	100,000,000	99,706,000	
第400回中国電力	200,000,000	198,924,000	
第409回中国電力	200,000,000	197,776,000	
第433回中国電力	700,000,000	696,990,000	
第448回中国電力	200,000,000	196,548,000	
第322回北陸電力	100,000,000	99,748,000	
第485回東北電力	100,000,000	99,728,000	

第492回東北電力	300,000,000	299,904,000	
第494回東北電力	200,000,000	199,798,000	
第529回東北電力	500,000,000	496,940,000	
第552回東北電力	400,000,000	403,676,000	
第449回九州電力	300,000,000	300,048,000	
第468回九州電力	100,000,000	99,058,000	
第471回九州電力	300,000,000	296,838,000	
第484回九州電力	400,000,000	391,168,000	
第503回九州電力	600,000,000	598,656,000	
第511回九州電力	600,000,000	601,800,000	
第49回電源開発	500,000,000	499,525,000	
第50回電源開発	200,000,000	199,632,000	
第57回電源開発	100,000,000	98,818,000	
第59回電源開発	300,000,000	296,727,000	
第64回電源開発	600,000,000	591,234,000	
第67回電源開発	200,000,000	194,802,000	
第86回電源開発	100,000,000	98,310,000	
第6回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,513,000	
第13回東京電力パワーグリッド	300,000,000	299,547,000	
第15回東京電力パワーグリッド	100,000,000	98,863,000	
第25回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,477,000	
第28回東京電力パワーグリッド	400,000,000	401,364,000	
第31回東京電力パワーグリッド	300,000,000	300,099,000	
第33回東京電力パワーグリッド	200,000,000	200,414,000	
第35回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,918,000	
第39回東京電力パワーグリッド	400,000,000	400,176,000	
第47回東京電力パワーグリッド	200,000,000	192,436,000	
第49回東京電力パワーグリッド	400,000,000	399,436,000	
第16回JERA	200,000,000	200,106,000	
第17回JERA	200,000,000	200,614,000	
第21回JERA	200,000,000	199,940,000	
第3回東京電力リニューアブルパワー（グリーン）	400,000,000	402,004,000	
第51回大阪ガス	100,000,000	98,208,000	
第13回広島ガス	200,000,000	197,392,000	
第7回ファーストリテイリング	100,000,000	99,312,000	
社債券 合計	46,200,000,000	46,098,431,000	

合計	786,411,687,000	772,394,999,222
----	-----------------	-----------------

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年1月26日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	2,858,217,017
コール・ローン	3,450,411,892
国債証券	521,627,234,978
派生商品評価勘定	94,230,568
未収入金	12,699,921
未収利息	4,144,832,233
前払費用	446,630,212
流動資産合計	532,634,256,821
資産合計	532,634,256,821
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	983,679
未払金	440,641,510
未払解約金	271,792,170
未払利息	881
流動負債合計	713,418,240
負債合計	713,418,240
純資産の部	
元本等	
元本	206,647,867,531
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	325,272,971,050
元本等合計	531,920,838,581
純資産合計	531,920,838,581
負債純資産合計	532,634,256,821

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1月26日現在]
1. 期首	2023年1月27日
期首元本額	174,401,387,040円
期中追加設定元本額	57,561,997,583円
期中一部解約元本額	25,315,517,092円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	280,077,392円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	645,435,989円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	407,521,244円
三菱UFJ 外国債券オープン	830,884,536円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	2,117,442,844円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	6,101,280,863円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	4,784,401,977円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	536,468,781円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	96,241,967円
ファンド・マネジャー(海外債券)	895,726,448円
eMAXIS 先進国債券インデックス	6,083,670,061円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,354,786,717円
eMAXIS バランス(波乗り型)	210,492,811円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,014,612,091円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	419,661,400円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	237,925,486円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	159,847,454円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	39,001,288,318円
海外債券セレクション(ラップ向け)	5,794,847,787円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	11,699,465,823円
つみたて8資産均等バランス	5,765,865,057円
つみたて4資産均等バランス	2,071,842,710円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	4,447,147円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,310,805円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	556,353円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	232,162,396円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	155,699,614円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	89,525,587円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	791,825,592円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	1,204,460,672円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	1,800,742,790円
三菱UFJ DC年金インデックス(先進国債券)	2,042,403,938円

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	75,858,016円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	173,890,473円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	34,612,561円
ラップ向けインデックスf 先進国債券	2,756,084,087円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	31,128,167円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	3,851,044,159円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	76,839,332円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	42,238,720円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	54,433,336円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	205,592円
三菱UFJ 外国債券オープン (確定拠出年金)	3,101,269,888円
三菱UFJ 外国債券オープン (毎月分配型)	16,771,403,427円
ワールド・インカムオープン	993,048,159円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	15,553,369,468円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (毎月分配型)	407,136,940円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (年1回決算型)	2,141,369,369円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	825,801,219円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	512,433,579円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	281,332,315円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	324,789,919円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	177,493,481円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	70,611,898円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA (適格機関投資家限定)	1,006,608,711円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型) VA (適格機関投資家限定)	103円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2 (適格機関投資家限定)	10,383,745円
MUAM 世界債券オープン (適格機関投資家限定)	1,028,461,738円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	11,170,719円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,522,880,546円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,137,750,689円
MUAM 外国債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)	41,720,753,305円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	465,972,697円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	383,138円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	102,202円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	1,258,247,368円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	60,903,911円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	108,652,517円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)	1,031,658,432円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	31,096,604円
MUKAM 外国債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	2,482,508,842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)	655,362,166円
外国債券インデックスファンドV (適格機関投資家限定)	772,204,051円
海外債券インデックスファンドS	4,074,292,643円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	1,615,459円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	2,714,089円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	503,871円

インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	890,268円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	4,440,348円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	3,564,102円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	7,461,109円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	3,386,271円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	8,627,509円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,751,838,476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）	193,917,904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）	554,205,925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）	457,256,361円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	187,734,957円
合計	206,647,867,531円
2. 受益権の総数	206,647,867,531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1月27日 至 2024年1月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、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1月26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 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

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024年1月26日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		△4,711,470,935
合計		△4,711,470,935

(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1月26日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	3,230,653,700	—	3,324,504,145	93,850,445
	カナダドル	17,508,560	—	17,526,836	18,276
	オーストラリアドル	15,543,880	—	15,549,168	5,288
	イギリスポンド	43,152,426	—	43,129,019	△23,407
	シンガポールドル	4,405,080	—	4,404,788	△292
	マレーシアリング	5,299,240	—	5,295,806	△3,434
	スウェーデンクローネ	4,943,470	—	4,943,225	△245
	デンマーククローネ	5,368,200	—	5,367,750	△450
	メキシコペソ	9,772,470	—	9,777,522	5,052
	オフショア元	89,998,838	—	89,765,044	△233,794
ユーロ	272,541,200	—	272,170,650	△370,550	
合計		3,699,187,064	—	3,792,433,953	93,246,889

(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1月26日現在]
1口当たり純資産額	2,5740円
(1万口当たり純資産額)	(25,740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	5,000,000.00	4,721,093.75	
		0.25 T-NOTE 250630	6,650,000.00	6,263,079.12	
		0.25 T-NOTE 250731	5,800,000.00	5,444,183.57	
		0.25 T-NOTE 250831	6,700,000.00	6,269,603.52	
		0.25 T-NOTE 250930	7,600,000.00	7,092,046.85	
		0.25 T-NOTE 251031	10,300,000.00	9,584,431.60	
		0.375 T-NOTE 250430	4,670,000.00	4,429,750.40	
		0.375 T-NOTE 251130	10,150,000.00	9,439,698.22	
		0.375 T-NOTE 251231	8,500,000.00	7,885,742.23	
		0.375 T-NOTE 260131	9,200,000.00	8,508,921.84	
		0.375 T-NOTE 270731	7,150,000.00	6,292,418.91	
		0.375 T-NOTE 270930	7,300,000.00	6,389,210.97	
		0.5 T-NOTE 250331	6,500,000.00	6,195,058.61	
		0.5 T-NOTE 260228	9,900,000.00	9,156,339.81	
		0.5 T-NOTE 270430	5,280,000.00	4,706,831.23	
		0.5 T-NOTE 270531	4,280,000.00	3,804,351.57	
		0.5 T-NOTE 270630	5,900,000.00	5,230,718.75	
		0.5 T-NOTE 270831	4,950,000.00	4,364,701.15	
		0.5 T-NOTE 271031	7,900,000.00	6,927,929.64	

0.625 T-NOTE 260731	7,930,000.00	7,264,158.81	
0.625 T-NOTE 270331	3,800,000.00	3,411,167.96	
0.625 T-NOTE 271130	7,550,000.00	6,635,594.73	
0.625 T-NOTE 271231	8,630,000.00	7,564,397.28	
0.625 T-NOTE 300515	12,090,000.00	9,791,247.05	
0.625 T-NOTE 300815	16,160,000.00	12,974,712.41	
0.75 T-NOTE 260331	8,100,000.00	7,519,552.70	
0.75 T-NOTE 260430	9,200,000.00	8,515,750.00	
0.75 T-NOTE 260531	8,200,000.00	7,572,347.64	
0.75 T-NOTE 260831	10,100,000.00	9,259,253.87	
0.75 T-NOTE 280131	8,850,000.00	7,777,801.79	
0.875 T-NOTE 260630	8,300,000.00	7,675,716.82	
0.875 T-NOTE 260930	10,000,000.00	9,183,007.80	
0.875 T-NOTE 301115	17,430,000.00	14,169,364.49	
1 T-NOTE 280731	9,150,000.00	8,011,968.75	
1.125 T-BOND 400515	6,020,000.00	3,728,637.50	
1.125 T-BOND 400815	8,350,000.00	5,113,722.69	
1.125 T-NOTE 250228	4,150,000.00	3,993,564.46	
1.125 T-NOTE 261031	10,450,000.00	9,635,022.47	
1.125 T-NOTE 270228	2,950,000.00	2,697,809.57	
1.125 T-NOTE 280229	9,760,000.00	8,693,071.82	
1.125 T-NOTE 280831	9,970,000.00	8,760,748.07	
1.125 T-NOTE 310215	16,920,000.00	13,954,042.92	
1.25 T-BOND 500515	9,420,000.00	4,748,820.66	
1.25 T-NOTE 261130	11,360,000.00	10,488,475.00	
1.25 T-NOTE 261231	8,200,000.00	7,561,457.06	
1.25 T-NOTE 280331	9,950,000.00	8,890,286.09	
1.25 T-NOTE 280430	9,740,000.00	8,683,057.85	
1.25 T-NOTE 280531	9,750,000.00	8,673,500.94	
1.25 T-NOTE 280630	9,680,000.00	8,593,457.84	
1.25 T-NOTE 280930	10,700,000.00	9,438,779.33	
1.25 T-NOTE 310815	17,720,000.00	14,477,793.75	
1.375 T-BOND 401115	8,400,000.00	5,351,226.55	
1.375 T-BOND 500815	10,430,000.00	5,437,859.78	
1.375 T-NOTE 260831	3,800,000.00	3,541,570.32	
1.375 T-NOTE 281031	8,250,000.00	7,306,406.25	

1. 375 T-NOTE 281231	8,700,000.00	7,674,691.42	
1. 375 T-NOTE 311115	18,100,000.00	14,832,101.46	
1. 5 T-NOTE 250215	6,300,000.00	6,089,902.11	
1. 5 T-NOTE 260815	9,740,000.00	9,114,128.93	
1. 5 T-NOTE 270131	11,540,000.00	10,693,207.37	
1. 5 T-NOTE 281130	9,700,000.00	8,627,126.93	
1. 5 T-NOTE 300215	8,740,000.00	7,544,736.74	
1. 625 T-BOND 501115	10,710,000.00	5,980,238.11	
1. 625 T-NOTE 260215	9,760,000.00	9,251,412.45	
1. 625 T-NOTE 260515	7,670,000.00	7,237,064.47	
1. 625 T-NOTE 260930	2,100,000.00	1,967,519.52	
1. 625 T-NOTE 261031	3,350,000.00	3,131,988.29	
1. 625 T-NOTE 261130	3,400,000.00	3,174,351.55	
1. 625 T-NOTE 290815	7,050,000.00	6,225,480.50	
1. 625 T-NOTE 310515	16,640,000.00	14,090,049.95	
1. 75 T-BOND 410815	11,370,000.00	7,605,908.17	
1. 75 T-NOTE 250315	9,030,000.00	8,740,052.29	
1. 75 T-NOTE 261231	4,700,000.00	4,397,437.50	
1. 75 T-NOTE 290131	8,600,000.00	7,716,316.37	
1. 75 T-NOTE 291115	5,150,000.00	4,558,755.84	
1. 875 T-BOND 410215	10,700,000.00	7,396,792.93	
1. 875 T-BOND 510215	11,810,000.00	7,034,331.25	
1. 875 T-BOND 511115	10,450,000.00	6,195,911.17	
1. 875 T-NOTE 260630	3,500,000.00	3,317,001.94	
1. 875 T-NOTE 260731	5,500,000.00	5,201,582.04	
1. 875 T-NOTE 270228	9,120,000.00	8,533,434.33	
1. 875 T-NOTE 290228	7,800,000.00	7,030,968.75	
1. 875 T-NOTE 320215	16,860,000.00	14,298,399.66	
2 T-BOND 411115	10,220,000.00	7,118,269.94	
2 T-BOND 500215	7,790,000.00	4,828,582.81	
2 T-BOND 510815	11,990,000.00	7,352,773.85	
2 T-NOTE 250215	8,110,000.00	7,881,042.69	
2 T-NOTE 250815	11,490,000.00	11,070,121.27	
2 T-NOTE 261115	8,680,000.00	8,192,767.20	
2. 125 T-NOTE 250515	6,970,000.00	6,755,182.43	
2. 125 T-NOTE 260531	5,000,000.00	4,770,507.80	

2. 25 T-BOND 410515	9,190,000.00	6,741,367.59	
2. 25 T-BOND 460815	5,040,000.00	3,425,526.56	
2. 25 T-BOND 490815	6,580,000.00	4,344,984.75	
2. 25 T-BOND 520215	9,890,000.00	6,441,635.09	
2. 25 T-NOTE 251115	10,290,000.00	9,912,565.98	
2. 25 T-NOTE 260331	4,500,000.00	4,314,638.65	
2. 25 T-NOTE 270215	6,810,000.00	6,450,346.87	
2. 25 T-NOTE 270815	6,190,000.00	5,818,358.21	
2. 25 T-NOTE 271115	7,500,000.00	7,024,218.74	
2. 375 T-BOND 420215	7,850,000.00	5,801,027.38	
2. 375 T-BOND 491115	6,910,000.00	4,686,788.48	
2. 375 T-BOND 510515	11,570,000.00	7,779,921.15	
2. 375 T-NOTE 260430	2,000,000.00	1,920,781.24	
2. 375 T-NOTE 270515	9,070,000.00	8,590,459.21	
2. 375 T-NOTE 290331	7,500,000.00	6,920,361.30	
2. 375 T-NOTE 290515	7,480,000.00	6,890,950.00	
2. 5 T-BOND 450215	5,050,000.00	3,673,184.56	
2. 5 T-BOND 460215	4,030,000.00	2,896,011.51	
2. 5 T-BOND 460515	4,210,000.00	3,016,974.78	
2. 5 T-NOTE 250131	3,350,000.00	3,275,702.12	
2. 5 T-NOTE 260228	3,450,000.00	3,327,767.56	
2. 5 T-NOTE 270331	7,700,000.00	7,338,460.97	
2. 625 T-NOTE 250331	1,960,000.00	1,915,287.50	
2. 625 T-NOTE 250415	9,000,000.00	8,787,128.94	
2. 625 T-NOTE 251231	3,200,000.00	3,100,750.01	
2. 625 T-NOTE 260131	3,900,000.00	3,775,839.83	
2. 625 T-NOTE 270531	7,900,000.00	7,539,716.78	
2. 625 T-NOTE 290215	9,640,000.00	9,022,437.50	
2. 625 T-NOTE 290731	5,600,000.00	5,208,109.36	
2. 75 T-BOND 420815	2,520,000.00	1,969,685.14	
2. 75 T-BOND 421115	3,700,000.00	2,883,687.50	
2. 75 T-BOND 470815	4,860,000.00	3,612,821.50	
2. 75 T-BOND 471115	5,110,000.00	3,791,679.88	
2. 75 T-NOTE 250228	3,440,000.00	3,369,184.36	
2. 75 T-NOTE 250515	6,400,000.00	6,253,500.03	
2. 75 T-NOTE 250630	2,370,000.00	2,313,434.75	

2.75 T-NOTE 250831	4,050,000.00	3,944,478.50	
2.75 T-NOTE 270430	6,400,000.00	6,139,249.98	
2.75 T-NOTE 270731	7,650,000.00	7,319,944.34	
2.75 T-NOTE 280215	9,990,000.00	9,504,938.64	
2.75 T-NOTE 290531	7,160,000.00	6,716,695.32	
2.75 T-NOTE 320815	15,460,000.00	13,940,571.87	
2.875 T-BOND 430515	4,680,000.00	3,701,861.70	
2.875 T-BOND 450815	3,500,000.00	2,711,816.41	
2.875 T-BOND 461115	2,340,000.00	1,792,339.45	
2.875 T-BOND 490515	7,170,000.00	5,409,428.87	
2.875 T-BOND 520515	9,820,000.00	7,373,630.88	
2.875 T-NOTE 250430	6,000,000.00	5,872,851.54	
2.875 T-NOTE 250531	4,230,000.00	4,137,633.97	
2.875 T-NOTE 250615	7,800,000.00	7,628,460.91	
2.875 T-NOTE 250731	6,100,000.00	5,958,341.77	
2.875 T-NOTE 251130	3,800,000.00	3,700,027.35	
2.875 T-NOTE 280515	10,090,000.00	9,626,490.62	
2.875 T-NOTE 280815	10,310,000.00	9,814,233.95	
2.875 T-NOTE 290430	7,000,000.00	6,615,000.00	
2.875 T-NOTE 320515	15,480,000.00	14,136,686.77	
3 T-BOND 420515	1,920,000.00	1,566,000.00	
3 T-BOND 441115	3,900,000.00	3,107,507.82	
3 T-BOND 450515	2,790,000.00	2,213,854.08	
3 T-BOND 451115	2,000,000.00	1,580,937.50	
3 T-BOND 470215	5,030,000.00	3,933,224.18	
3 T-BOND 470515	3,390,000.00	2,646,318.75	
3 T-BOND 480215	5,970,000.00	4,638,643.36	
3 T-BOND 480815	7,070,000.00	5,479,250.00	
3 T-BOND 490215	7,800,000.00	6,033,878.90	
3 T-BOND 520815	8,670,000.00	6,682,673.43	
3 T-NOTE 250715	6,700,000.00	6,558,802.72	
3 T-NOTE 250930	5,400,000.00	5,276,390.65	
3 T-NOTE 251031	3,300,000.00	3,222,720.69	
3.125 T-BOND 411115	1,990,000.00	1,664,409.57	
3.125 T-BOND 420215	2,200,000.00	1,836,011.71	
3.125 T-BOND 430215	3,160,000.00	2,606,382.81	

3. 125 T-BOND 440815	4, 130, 000. 00	3, 369, 257. 22	
3. 125 T-BOND 480515	6, 010, 000. 00	4, 773, 606. 81	
3. 125 T-NOTE 250815	5, 000, 000. 00	4, 900, 195. 30	
3. 125 T-NOTE 270831	7, 300, 000. 00	7, 069, 451. 18	
3. 125 T-NOTE 281115	8, 280, 000. 00	7, 952, 034. 33	
3. 125 T-NOTE 290831	5, 900, 000. 00	5, 625, 742. 15	
3. 25 T-BOND 420515	6, 950, 000. 00	5, 881, 844. 69	
3. 25 T-NOTE 270630	6, 300, 000. 00	6, 135, 978. 49	
3. 25 T-NOTE 290630	6, 170, 000. 00	5, 931, 033. 00	
3. 375 T-BOND 420815	6, 300, 000. 00	5, 421, 691. 41	
3. 375 T-BOND 440515	3, 380, 000. 00	2, 874, 914. 46	
3. 375 T-BOND 481115	6, 920, 000. 00	5, 743, 194. 55	
3. 375 T-NOTE 330515	16, 100, 000. 00	15, 176, 765. 62	
3. 5 T-BOND 390215	1, 360, 000. 00	1, 242, 885. 93	
3. 5 T-NOTE 250915	5, 100, 000. 00	5, 024, 595. 68	
3. 5 T-NOTE 280131	6, 100, 000. 00	5, 975, 974. 61	
3. 5 T-NOTE 280430	6, 900, 000. 00	6, 753, 375. 00	
3. 5 T-NOTE 300131	5, 100, 000. 00	4, 944, 708. 97	
3. 5 T-NOTE 300430	5, 600, 000. 00	5, 421, 718. 73	
3. 5 T-NOTE 330215	15, 100, 000. 00	14, 395, 136. 68	
3. 625 T-BOND 430815	3, 400, 000. 00	3, 015, 242. 19	
3. 625 T-BOND 440215	3, 870, 000. 00	3, 425, 403. 52	
3. 625 T-BOND 530215	8, 690, 000. 00	7, 587, 965. 39	
3. 625 T-BOND 530515	9, 060, 000. 00	7, 917, 590. 62	
3. 625 T-NOTE 260515	7, 000, 000. 00	6, 908, 398. 42	
3. 625 T-NOTE 280331	6, 000, 000. 00	5, 903, 554. 68	
3. 625 T-NOTE 280531	6, 600, 000. 00	6, 492, 105. 44	
3. 625 T-NOTE 300331	5, 500, 000. 00	5, 364, 003. 92	
3. 75 T-BOND 410815	2, 060, 000. 00	1, 887, 957. 82	
3. 75 T-BOND 431115	3, 360, 000. 00	3, 031, 415. 61	
3. 75 T-NOTE 260415	7, 000, 000. 00	6, 925, 078. 16	
3. 75 T-NOTE 300531	5, 600, 000. 00	5, 495, 875. 00	
3. 75 T-NOTE 300630	5, 400, 000. 00	5, 298, 433. 61	
3. 875 T-BOND 400815	1, 870, 000. 00	1, 756, 886. 91	
3. 875 T-BOND 430215	6, 040, 000. 00	5, 562, 580. 45	
3. 875 T-BOND 430515	6, 200, 000. 00	5, 704, 484. 34	

3. 875 T-NOTE 250331	5,000,000.00	4,955,761.70	
3. 875 T-NOTE 250430	4,000,000.00	3,963,828.12	
3. 875 T-NOTE 260115	6,700,000.00	6,644,515.62	
3. 875 T-NOTE 271130	6,900,000.00	6,853,101.52	
3. 875 T-NOTE 271231	7,000,000.00	6,954,335.92	
3. 875 T-NOTE 290930	6,030,000.00	5,971,819.90	
3. 875 T-NOTE 291130	5,100,000.00	5,047,406.25	
3. 875 T-NOTE 291231	5,700,000.00	5,640,773.46	
3. 875 T-NOTE 330815	16,640,000.00	16,314,999.97	
4 T-BOND 421115	5,870,000.00	5,513,672.68	
4 T-BOND 521115	9,230,000.00	8,629,328.95	
4 T-NOTE 251215	5,700,000.00	5,663,595.69	
4 T-NOTE 260215	8,000,000.00	7,953,593.76	
4 T-NOTE 280229	8,020,000.00	8,004,179.26	
4 T-NOTE 280630	6,000,000.00	5,991,328.14	
4 T-NOTE 291031	5,500,000.00	5,480,556.62	
4 T-NOTE 300228	6,270,000.00	6,243,058.55	
4 T-NOTE 300731	5,400,000.00	5,374,265.64	
4. 125 T-BOND 530815	10,020,000.00	9,588,670.23	
4. 125 T-NOTE 260615	7,000,000.00	6,985,917.96	
4. 125 T-NOTE 270930	7,440,000.00	7,454,967.18	
4. 125 T-NOTE 271031	6,500,000.00	6,512,314.44	
4. 125 T-NOTE 280731	6,500,000.00	6,525,136.72	
4. 125 T-NOTE 300831	6,500,000.00	6,512,441.38	
4. 125 T-NOTE 321115	15,100,000.00	15,103,539.13	
4. 25 T-BOND 390515	1,770,000.00	1,759,870.89	
4. 25 T-BOND 401115	1,980,000.00	1,946,084.75	
4. 25 T-NOTE 250531	9,000,000.00	8,962,910.19	
4. 25 T-NOTE 251015	6,000,000.00	5,983,710.96	
4. 375 T-BOND 380215	1,000,000.00	1,017,343.75	
4. 375 T-BOND 391115	2,270,000.00	2,280,950.97	
4. 375 T-BOND 400515	2,080,000.00	2,082,559.37	
4. 375 T-BOND 410515	1,960,000.00	1,949,625.77	
4. 375 T-BOND 430815	6,360,000.00	6,266,090.64	
4. 375 T-NOTE 260815	5,500,000.00	5,525,029.29	
4. 375 T-NOTE 261215	10,000,000.00	10,067,187.50	

4. 375 T-NOTE 280831	7,000,000.00	7,100,625.00	
4. 375 T-NOTE 281130	8,050,000.00	8,176,410.09	
4. 375 T-NOTE 301130	6,250,000.00	6,353,515.62	
4. 5 T-BOND 360215	1,160,000.00	1,207,804.69	
4. 5 T-BOND 380515	1,330,000.00	1,367,458.19	
4. 5 T-BOND 390815	1,880,000.00	1,919,289.06	
4. 5 T-NOTE 251115	4,700,000.00	4,709,455.08	
4. 5 T-NOTE 260715	6,500,000.00	6,545,195.28	
4. 5 T-NOTE 331115	12,400,000.00	12,772,968.66	
4. 625 T-BOND 400215	2,100,000.00	2,168,660.15	
4. 625 T-NOTE 250228	3,000,000.00	2,997,363.27	
4. 625 T-NOTE 250630	5,000,000.00	5,008,007.80	
4. 625 T-NOTE 260315	6,000,000.00	6,042,187.50	
4. 625 T-NOTE 260915	7,500,000.00	7,583,789.10	
4. 625 T-NOTE 261015	6,800,000.00	6,880,617.19	
4. 625 T-NOTE 261115	7,000,000.00	7,088,046.84	
4. 625 T-NOTE 280930	7,050,000.00	7,225,148.43	
4. 625 T-NOTE 300930	5,700,000.00	5,876,566.39	
4. 75 T-BOND 410215	2,010,000.00	2,095,425.00	
4. 75 T-BOND 431115	2,980,000.00	3,085,929.69	
4. 75 T-BOND 531115	7,000,000.00	7,438,593.72	
4. 75 T-NOTE 250731	7,500,000.00	7,529,003.92	
4. 875 T-NOTE 251130	8,400,000.00	8,474,484.39	
4. 875 T-NOTE 281031	8,500,000.00	8,807,128.88	
4. 875 T-NOTE 301031	5,500,000.00	5,751,796.87	
5 T-BOND 370515	1,020,000.00	1,108,373.43	
5 T-NOTE 250831	8,500,000.00	8,567,734.37	
5 T-NOTE 250930	7,600,000.00	7,669,171.84	
5 T-NOTE 251031	9,500,000.00	9,595,371.07	
5. 25 T-BOND 281115	2,690,000.00	2,832,485.93	
5. 375 T-BOND 310215	1,300,000.00	1,408,722.65	
6 T-BOND 260215	1,200,000.00	1,239,187.50	
6. 125 T-BOND 271115	1,160,000.00	1,243,329.69	
6. 25 T-BOND 300515	1,150,000.00	1,286,966.79	
アメリカドル合計	1,856,730,000.00	1,668,430,957.42 (246,427,252,410)	

カナダドル	国債証券	0.25 CAN GOVT 260301	2,200,000.00	2,038,930.65	
		0.5 CAN GOVT 250901	2,900,000.00	2,735,400.37	
		0.5 CAN GOVT 301201	4,500,000.00	3,700,676.38	
		1 CAN GOVT 260901	2,500,000.00	2,329,482.60	
		1 CAN GOVT 270601	1,930,000.00	1,774,076.11	
		1.25 CAN GOVT 250301	2,100,000.00	2,028,085.81	
		1.25 CAN GOVT 270301	2,500,000.00	2,324,445.67	
		1.25 CAN GOVT 300601	4,410,000.00	3,863,630.01	
		1.5 CAN GOVT 250401	1,000,000.00	966,272.05	
		1.5 CAN GOVT 260601	4,070,000.00	3,856,604.20	
		1.5 CAN GOVT 310601	5,900,000.00	5,154,252.39	
		1.5 CAN GOVT 311201	4,270,000.00	3,696,676.23	
		1.75 CAN GOVT 531201	4,900,000.00	3,354,702.04	
		2 CAN GOVT 280601	2,670,000.00	2,511,592.93	
		2 CAN GOVT 320601	3,750,000.00	3,353,980.57	
		2 CAN GOVT 511201	6,060,000.00	4,473,199.12	
		2.25 CAN GOVT 250601	4,360,000.00	4,240,937.68	
		2.25 CAN GOVT 290601	2,210,000.00	2,084,133.98	
		2.25 CAN GOVT 291201	1,000,000.00	939,301.38	
		2.5 CAN GOVT 321201	3,500,000.00	3,243,548.17	
		2.75 CAN GOVT 270901	2,000,000.00	1,941,557.92	
		2.75 CAN GOVT 330601	3,000,000.00	2,829,018.36	
		2.75 CAN GOVT 481201	1,680,000.00	1,476,938.78	
		2.75 CAN GOVT 551201	1,750,000.00	1,513,657.85	
		2.75 CANADA GOVER 641201	1,250,000.00	1,068,341.70	
		3 CAN GOVT 251001	3,000,000.00	2,940,851.85	
		3 CAN GOVT 340601	1,200,000.00	1,149,760.04	
		3.25 CAN GOVT 280901	2,600,000.00	2,570,412.70	
		3.25 CAN GOVT 331201	3,170,000.00	3,110,515.60	
		3.5 CAN GOVT 280301	2,000,000.00	1,994,817.44	
		3.5 CAN GOVT 451201	1,650,000.00	1,648,508.07	
		3.75 CAN GOVT 250201	3,000,000.00	2,973,027.63	
		3.75 CAN GOVT 250501	3,500,000.00	3,470,748.50	
4 CAN GOVT 290301	1,080,000.00	1,105,685.35			
4 CAN GOVT 410601	1,200,000.00	1,273,717.35			
4.5 CAN GOVT 251101	2,540,000.00	2,553,650.29			

		4. 5 CAN GOVT 260201	700,000.00	706,533.52	
		5 CAN GOVT 370601	830,000.00	959,859.16	
		5. 75 CAN GOVT 290601	950,000.00	1,055,753.71	
		5. 75 CAN GOVT 330601	1,430,000.00	1,687,238.59	
カナダドル合計			105,260,000.00	96,700,522.75 (10,598,377,293)	
オーストラリアドル	国債証券	0. 25 AUST GOVT 251121	5,450,000.00	5,106,035.07	
		0. 5 AUST GOVT 260921	4,100,000.00	3,762,719.11	
		1 AUST GOVT 301221	3,010,000.00	2,463,227.75	
		1 AUST GOVT 311121	4,250,000.00	3,368,316.59	
		1. 25 AUST GOVT 320521	4,530,000.00	3,608,007.55	
		1. 5 AUST GOVT 310621	3,740,000.00	3,126,610.04	
		1. 75 AUST GOVT 321121	3,980,000.00	3,265,245.37	
		1. 75 AUST GOVT 510621	3,070,000.00	1,705,945.48	
		2. 25 AUST GOVT 280521	2,900,000.00	2,720,208.64	
		2. 5 AUST GOVT 300521	3,940,000.00	3,615,574.29	
		2. 75 AUST GOVT 271121	2,490,000.00	2,397,739.20	
		2. 75 AUST GOVT 281121	3,040,000.00	2,894,717.82	
		2. 75 AUST GOVT 291121	2,980,000.00	2,798,179.32	
		2. 75 AUST GOVT 350621	1,520,000.00	1,308,747.83	
		2. 75 AUST GOVT 410521	2,170,000.00	1,705,927.57	
		3 AUST GOVT 331121	4,100,000.00	3,694,646.32	
		3 AUST GOVT 470321	2,020,000.00	1,555,056.51	
		3. 25 AUST GOVT 250421	1,100,000.00	1,089,683.66	
		3. 25 AUST GOVT 290421	2,660,000.00	2,580,604.63	
		3. 25 AUST GOVT 390621	2,130,000.00	1,842,961.34	
		3. 5 AUST GOVT 341221	2,300,000.00	2,144,676.90	
		3. 75 AUST GOVT 340521	2,300,000.00	2,203,338.24	
		3. 75 AUST GOVT 370421	3,150,000.00	2,952,834.63	
4. 25 AUST GOVT 260421	2,490,000.00	2,511,503.88			
4. 5 AUST GOVT 330421	3,900,000.00	3,982,498.26			
4. 75 AUST GOVT 270421	3,050,000.00	3,137,816.51			
4. 75 AUST GOVT 540621	1,570,000.00	1,606,584.29			
オーストラリアドル合計			81,940,000.00	73,149,406.80 (7,112,316,823)	
イギリス	国債証券	0. 125 GILT 260130	2,600,000.00	2,402,790.00	

ボンド

0.125 GILT 280131	2,300,000.00	1,984,458.40	
0.25 GILT 250131	5,100,000.00	4,879,163.88	
0.25 GILT 310731	4,460,000.00	3,415,022.00	
0.375 GILT 261022	3,750,000.00	3,400,464.75	
0.375 GILT 301022	2,390,000.00	1,906,068.02	
0.5 GILT 290131	4,900,000.00	4,161,080.00	
0.5 GILT 611022	3,700,000.00	1,091,130.00	
0.625 GILT 250607	2,880,000.00	2,736,720.00	
0.625 GILT 350731	4,030,000.00	2,742,818.00	
0.625 GILT 501022	2,890,000.00	1,154,266.00	
0.875 GILT 291022	2,320,000.00	1,974,222.56	
0.875 GILT 330731	5,140,000.00	3,876,074.00	
0.875 GILT 460131	2,980,000.00	1,469,736.00	
1 GILT 320131	5,100,000.00	4,086,820.74	
1.125 GILT 390131	3,600,000.00	2,318,760.00	
1.125 GILT 731022	1,500,000.00	546,733.20	
1.25 GILT 270722	2,100,000.00	1,921,143.00	
1.25 GILT 411022	3,750,000.00	2,286,750.00	
1.25 GILT 510731	4,180,000.00	2,030,644.00	
1.5 GILT 260722	2,490,000.00	2,344,015.78	
1.5 GILT 470722	3,160,000.00	1,773,708.00	
1.5 GILT 530731	2,950,000.00	1,496,936.20	
1.625 GILT 281022	3,470,000.00	3,147,654.35	
1.625 GILT 541022	2,060,000.00	1,073,466.00	
1.625 GILT 711022	2,530,000.00	1,166,491.92	
1.75 GILT 370907	3,340,000.00	2,474,606.00	
1.75 GILT 490122	1,780,000.00	1,038,808.00	
1.75 GILT 570722	3,230,000.00	1,708,347.00	
2 GILT 250907	2,100,000.00	2,023,194.60	
2.5 GILT 650722	2,480,000.00	1,574,800.00	
3.25 GILT 330131	5,100,000.00	4,822,815.00	
3.25 GILT 440122	3,440,000.00	2,855,544.00	
3.5 GILT 251022	4,400,000.00	4,336,860.00	
3.5 GILT 450122	3,190,000.00	2,735,744.00	
3.5 GILT 680722	2,470,000.00	2,026,882.00	
3.75 GILT 380129	3,350,000.00	3,148,665.00	

		3. 75 GILT 520722	2, 110, 000. 00	1, 837, 177. 00	
		3. 75 GILT 531022	4, 180, 000. 00	3, 617, 372. 00	
		4 GILT 600122	1, 980, 000. 00	1, 804, 374. 00	
		4 GILT 631022	1, 630, 000. 00	1, 480, 366. 00	
		4. 125 GILT 270129	4, 900, 000. 00	4, 913, 429. 92	
		4. 25 GILT 271207	2, 450, 000. 00	2, 480, 071. 30	
		4. 25 GILT 320607	3, 370, 000. 00	3, 456, 777. 50	
		4. 25 GILT 360307	2, 410, 000. 00	2, 427, 593. 00	
		4. 25 GILT 390907	2, 320, 000. 00	2, 280, 332. 64	
		4. 25 GILT 401207	2, 420, 000. 00	2, 364, 582. 00	
		4. 25 GILT 461207	2, 680, 000. 00	2, 557, 256. 00	
		4. 25 GILT 491207	1, 990, 000. 00	1, 890, 102. 00	
		4. 25 GILT 551207	2, 770, 000. 00	2, 628, 176. 00	
		4. 5 GILT 280607	2, 500, 000. 00	2, 558, 994. 25	
		4. 5 GILT 340907	1, 990, 000. 00	2, 060, 426. 10	
		4. 5 GILT 421207	3, 190, 000. 00	3, 190, 156. 31	
		4. 625 GILT 340131	1, 570, 000. 00	1, 643, 790. 00	
		4. 75 GILT 301207	3, 650, 000. 00	3, 850, 180. 60	
		4. 75 GILT 381207	2, 310, 000. 00	2, 410, 891. 56	
		4. 75 GILT 431022	1, 250, 000. 00	1, 284, 625. 00	
		5 GILT 250307	2, 490, 000. 00	2, 499, 319. 57	
		6 GILT 281207	1, 890, 000. 00	2, 070, 632. 97	
		イギリスポンド合計	177, 260, 000. 00	145, 440, 028. 12 (27, 287, 458, 075)	
シンガポ ールドル	国債証券	1. 25 SINGAPORGOVT 261101	700, 000. 00	667, 100. 00	
		1. 625 SINGAPORGOV 310701	1, 050, 000. 00	957, 600. 00	
		1. 875 SINGAPORGOV 500301	700, 000. 00	567, 000. 00	
		1. 875 SINGAPORGOV 511001	950, 000. 00	773, 480. 50	
		2. 125 SINGAPORGOV 260601	1, 530, 000. 00	1, 494, 504. 00	
		2. 25 SINGAPORGOVT 360801	1, 300, 000. 00	1, 202, 500. 00	
		2. 375 SINGAPORGOV 250601	1, 560, 000. 00	1, 538, 784. 00	
		2. 375 SINGAPORGOV 390701	780, 000. 00	723, 106. 80	
		2. 625 SINGAPORGOV 280501	800, 000. 00	791, 440. 00	
		2. 625 SINGAPORGOV 320801	700, 000. 00	682, 150. 00	
		2. 75 SINGAPORGOVT 420401	980, 000. 00	951, 545. 70	
		2. 75 SINGAPORGOVT 460301	1, 140, 000. 00	1, 101, 240. 00	

		2. 875 SINGAPORGOV 270901	1,000,000.00	998,000.00	
		2. 875 SINGAPORGOV 280801	1,000,000.00	999,685.00	
		2. 875 SINGAPORGOV 290701	1,760,000.00	1,755,600.00	
		2. 875SINGAPORGOVT 300901	1,340,000.00	1,335,310.00	
		3 SINGAPORGOVT 720801	910,000.00	940,485.00	
		3. 375 SINGAPORGOV 330901	1,280,000.00	1,323,801.60	
		3. 5 SINGAPORGOVT 270301	1,000,000.00	1,015,000.00	
シンガポールドル合計			20,480,000.00	19,818,332.60 (2,183,385,702)	
マレーシア アリンギ ット	国債証券	2. 632 MALAYSIAGOV 310415	2,800,000.00	2,603,934.31	
		3. 502MALAYSIAGOVT 270531	3,000,000.00	2,999,957.01	
		3. 582 MALAYSIAGOV 320715	2,370,000.00	2,321,351.38	
		3. 733 MALAYSIAGO 280615	2,800,000.00	2,812,372.64	
		3. 757 MALAYSIAGOV 400522	3,980,000.00	3,830,498.41	
		3. 828 MALAYSIAGOV 340705	3,410,000.00	3,401,322.06	
		3. 844 MALAYSIAGOV 330415	2,400,000.00	2,390,594.76	
		3. 882 MALAYSIAGOV 250314	2,410,000.00	2,426,093.01	
		3. 885 MALAYSIAGOV 290815	3,600,000.00	3,639,517.20	
		3. 892 MALAYSIAGOV 270315	5,100,000.00	5,162,998.77	
		3. 899 MALAYSIAGOV 271116	5,640,000.00	5,707,256.43	
		3. 9 MALAYSIAGOVT 261130	2,150,000.00	2,175,499.43	
		3. 906 MALAYSIAGOV 260715	2,730,000.00	2,761,465.43	
		3. 955 MALAYSIAGOV 250915	4,270,000.00	4,306,609.69	
		4. 065 MALAYSIAGOV 500615	5,250,000.00	5,110,080.20	
		4. 232MALAYSIAGOVT 310630	2,550,000.00	2,627,728.33	
		4. 254 MALAYSIAGOV 350531	2,150,000.00	2,207,093.25	
		4. 392 MALAYSIAGOV 260415	1,350,000.00	1,376,325.27	
		4. 457 MALAYSIAGOV 530331	1,600,000.00	1,660,462.72	
		4. 498 MALAYSIAGOV 300415	3,640,000.00	3,789,576.70	
		4. 504 MALAYSIAGOV 290430	1,500,000.00	1,560,710.40	
		4. 642 MALAYSIAGOV 331107	2,600,000.00	2,772,927.30	
		4. 696 MALAYSIAGOV 421015	3,900,000.00	4,204,128.63	
		4. 736 MALAYSIAGOV 460315	1,650,000.00	1,772,852.56	
4. 762 MALAYSIAGOV 370407	4,440,000.00	4,778,758.68			
4. 893 MALAYSIAGOV 380608	3,360,000.00	3,689,176.84			
4. 921 MALAYSIAGOV 480706	2,020,000.00	2,233,301.90			

		4. 935 MALAYSIAGOV 430930	1, 190, 000. 00	1, 313, 180. 94	
マレーシアリングット合計			83, 860, 000. 00	85, 635, 774. 25 (2, 668, 736, 141)	
ニュージーランドドル	国債証券	0. 25 NZ GOVT 280515	2, 000, 000. 00	1, 676, 162. 88	
		1. 75 NZ GOVT 410515	600, 000. 00	375, 869. 44	
		2 NZ GOVT 320515	2, 300, 000. 00	1, 886, 885. 36	
		2. 75 NZ GOVT 250415	1, 400, 000. 00	1, 361, 195. 90	
		2. 75 NZ GOVT 370415	1, 450, 000. 00	1, 150, 621. 41	
		2. 75 NZ GOVT 510515	1, 180, 000. 00	786, 894. 96	
		3 NZ GOVT 290420	1, 700, 000. 00	1, 587, 659. 63	
		3. 5 NZ GOVT 330414	1, 900, 000. 00	1, 733, 743. 06	
		4. 5 NZ GOVT 270415	1, 800, 000. 00	1, 800, 422. 82	
		4. 5 NZ GOVT 300515	1, 000, 000. 00	999, 803. 66	
ニュージーランドドル合計			15, 330, 000. 00	13, 359, 259. 12 (1, 205, 005, 172)	
スウェーデンクローネ	国債証券	0. 125 SWD GOVT 310512	9, 450, 000. 00	8, 137, 793. 60	
		0. 75 SWD GOVT 280512	8, 000, 000. 00	7, 518, 002. 64	
		0. 75 SWD GOVT 291112	12, 200, 000. 00	11, 259, 877. 88	
		1 SWD GOVT 261112	11, 960, 000. 00	11, 499, 997. 82	
		1. 75 SWD GOVT 331111	11, 500, 000. 00	10, 992, 898. 99	
		2. 25 SWD GOVT 320601	6, 750, 000. 00	6, 746, 700. 80	
		2. 5 SWD GOVT 250512	8, 840, 000. 00	8, 784, 182. 56	
		3. 5 SWD GOVT 390330	6, 470, 000. 00	7, 352, 702. 10	
スウェーデンクローネ合計			75, 170, 000. 00	72, 292, 156. 39 (1, 021, 488, 169)	
ノルウェークローネ	国債証券	1. 25 NORWE GOVT 310917	4, 700, 000. 00	3, 973, 544. 50	
		1. 375 NORWE GOVT 300819	8, 770, 000. 00	7, 675, 346. 14	
		1. 5 NORWE GOVT 260219	6, 040, 000. 00	5, 776, 112. 40	
		1. 75 NORWE GOVT 250313	10, 200, 000. 00	9, 938, 520. 96	
		1. 75 NORWE GOVT 270217	5, 120, 000. 00	4, 851, 660. 80	
		1. 75 NORWE GOVT 290906	4, 600, 000. 00	4, 195, 108. 00	
		2 NORWE GOVT 280426	6, 900, 000. 00	6, 497, 785. 20	
		2. 125 NORWE GOVT 320518	10, 500, 000. 00	9, 400, 755. 00	
		3 NORWE GOVT 330815	4, 500, 000. 00	4, 280, 899. 50	
		3. 5 NORWE GOVT 421006	4, 000, 000. 00	4, 021, 640. 00	
ノルウェークローネ合計			65, 330, 000. 00	60, 611, 372. 50	

				(858,257,034)
デンマーク クローネ	国債証券	0 DMK GOVT 311115	14,550,000.00	12,166,934.21
		0.25 DMK GOVT 521115	11,830,000.00	6,368,952.59
		0.5 DMK GOVT 271115	8,100,000.00	7,573,777.02
		0.5 DMK GOVT 291115	10,550,000.00	9,530,078.75
		1.75 DMK GOVT 251115	7,490,000.00	7,379,522.50
		2.25 DMK GOVT 331115	3,500,000.00	3,445,400.00
		4.5 DMK GOVT 391115	15,650,000.00	19,513,820.67
デンマーククローネ合計			71,670,000.00	65,978,485.74 (1,417,217,873)
メキシコ ペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 361120	12,350,000.00	13,059,384.00
		5 MEXICAN BONOS 250306	34,000,000.00	32,360,520.00
		5.5 MEXICAN BONOS 270304	52,000,000.00	46,538,960.00
		5.75 MEXICAN BONO 260305	65,500,000.00	60,498,609.29
		7 MEXICAN BONOS 260903	20,000,000.00	18,764,600.00
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	48,750,000.00	46,184,775.00
		7.5 MEXICAN BONOS 330526	34,000,000.00	30,315,080.00
		7.75 MEXICAN BONO 310529	68,050,000.00	62,793,137.50
		7.75 MEXICAN BONO 341123	13,400,000.00	12,012,966.00
		7.75 MEXICAN BONO 421113	49,690,000.00	42,587,808.30
		8 MEXICAN BONOS 350524	5,000,000.00	4,561,176.35
		8 MEXICAN BONOS 471107	39,100,000.00	34,029,512.00
		8 MEXICAN BONOS 530731	33,270,000.00	28,634,490.90
		8.5 MEXICAN BONOS 290301	13,420,000.00	13,029,075.40
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	39,150,000.00	38,155,981.50
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	39,700,000.00	37,095,680.00
メキシコペソ合計			567,380,000.00	520,621,756.24 (4,470,839,331)
イスラエル シェケル	国債証券	0.5 ISRAEL FIXED 250430	6,500,000.00	6,257,225.00
		0.5 ISRAEL FIXED 260227	5,800,000.00	5,439,530.00
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	3,370,000.00	2,826,082.00
		1.3 ISRAEL FIXED 320430	4,800,000.00	3,848,640.00
		1.5 ISRAEL FIXED 370531	4,900,000.00	3,435,880.00
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	3,080,000.00	2,875,334.00
		2.8 ISRAEL FIXED 521129	800,000.00	549,360.00
		3.75 ISRAEL FIXED 470331	4,680,000.00	4,144,140.00

		5. 5 ISRAEL FIXED 420131	3,130,000.00	3,430,167.00	
		6. 25 ISRAEL FIXED 261030	5,000,000.00	5,380,500.00	
イスラエルシェケル合計			42,060,000.00	38,186,858.00 (1,521,929,588)	
ポーランド ドズロチ	国債証券	0. 25 POLAND 261025	3,000,000.00	2,643,576.00	
		0. 75 POLAND 250425	3,500,000.00	3,325,525.00	
		1. 25 POLAND 301025	9,190,000.00	7,187,030.31	
		1. 75 POLAND 320425	9,900,000.00	7,620,287.40	
		2. 5 POLAND 260725	7,840,000.00	7,391,732.32	
		2. 5 POLAND 270725	6,110,000.00	5,630,187.81	
		2. 75 POLAND 280425	5,760,000.00	5,259,231.36	
		2. 75 POLAND 291025	7,900,000.00	6,996,737.70	
		3. 25 POLAND 250725	8,700,000.00	8,481,334.20	
		3. 75 POLAND 270525	4,000,000.00	3,849,264.00	
		5. 75 POLAND 290425	5,600,000.00	5,743,955.84	
		6 POLAND 331025	2,000,000.00	2,094,052.00	
		7. 5 POLAND 280725	6,000,000.00	6,556,821.00	
ポーランドズロチ合計			79,500,000.00	72,779,734.94 (2,664,305,980)	
中国元	国債証券	1. 99 CHINA GOVT 250409	35,000,000.00	34,938,286.60	
		2 CHINA GOVT 250615	42,000,000.00	41,893,899.60	
		2. 18 CHINA GOVT 250825	34,000,000.00	33,993,581.82	
		2. 18 CHINA GOVT 260815	35,000,000.00	34,959,034.60	
		2. 22 CHINA GOVT 250925	50,000,000.00	50,026,170.00	
		2. 24 CHINA GOVT 250525	18,000,000.00	18,017,238.60	
		2. 26 CHINA GOVT 250224	14,000,000.00	14,025,338.60	
		2. 28 CHINA GOVT 251125	34,000,000.00	34,059,479.60	
		2. 3 CHINA GOVT 260515	30,000,000.00	30,033,123.00	
		2. 33 CHINA GOVT 251215	30,000,000.00	30,088,482.00	
		2. 35 CHINA GOVT 250315	22,000,000.00	22,057,945.80	
		2. 37 CHINA GOVT 270120	28,000,000.00	28,089,863.20	
		2. 39 CHINA GOVT 261115	25,000,000.00	25,096,320.00	
		2. 4 CHINA GOVT 280715	31,000,000.00	31,014,694.00	
		2. 44 CHINA GOVT 271015	23,000,000.00	23,085,672.70	
		2. 46 CHINA GOVT 260215	29,000,000.00	29,148,717.80	
2. 48 CHINA GOVT 270415	28,000,000.00	28,117,023.20			

2.48 CHINA GOVT 280925	12,000,000.00	12,058,852.80	
2.5 CHINA GOVT 270725	25,000,000.00	25,140,207.50	
2.52 CHINA GOVT 330825	37,000,000.00	36,938,899.68	
2.55 CHINA GOVT 281015	50,000,000.00	50,466,295.00	
2.6 CHINA GOVT 300915	39,000,000.00	39,289,263.00	
2.6 CHINA GOVT 320901	23,000,000.00	23,062,304.70	
2.62 CHINA GOVT 280415	33,000,000.00	33,398,940.30	
2.62 CHINA GOVT 290925	21,000,000.00	21,219,586.50	
2.62 CHINA GOVT 300625	31,000,000.00	31,249,881.70	
2.64 CHINA GOVT 280115	41,000,000.00	41,473,492.60	
2.67 CHINA GOVT 330525	28,000,000.00	28,272,039.60	
2.67 CHINA GOVT 331125	31,000,000.00	31,402,039.00	
2.68 CHINA GOVT 300521	45,000,000.00	45,546,484.50	
2.69 CHINA GOVT 260812	34,000,000.00	34,380,915.60	
2.69 CHINA GOVT 320815	26,000,000.00	26,276,991.00	
2.74 CHINA GOVT 260804	15,000,000.00	15,204,306.00	
2.75 CHINA GOVT 290615	30,000,000.00	30,534,192.00	
2.75 CHINA GOVT 320217	24,000,000.00	24,401,858.40	
2.76 CHINA GOVT 320515	25,000,000.00	25,414,577.50	
2.79 CHINA GOVT 291215	31,000,000.00	31,592,856.40	
2.8 CHINA GOVT 290324	27,000,000.00	27,540,475.20	
2.8 CHINA GOVT 300325	35,000,000.00	35,652,452.50	
2.8 CHINA GOVT 321115	29,000,000.00	29,542,604.50	
2.85 CHINA GOVT 270604	32,000,000.00	32,571,449.60	
2.88 CHINA GOVT 330225	26,000,000.00	26,727,508.60	
2.89 CHINA GOVT 311118	20,000,000.00	20,545,180.00	
2.9 CHINA GOVT 260505	17,000,000.00	17,270,522.70	
2.91 CHINA GOVT 281014	32,000,000.00	32,801,116.80	
2.99 CHINA GOVT 251015	9,000,000.00	9,137,638.80	
3 CHINA GOVT 531015	8,000,000.00	8,462,741.60	
3.01 CHINA GOVT 280513	39,000,000.00	40,133,156.70	
3.02 CHINA GOVT 251022	36,000,000.00	36,572,097.60	
3.02 CHINA GOVT 310527	38,000,000.00	39,329,167.80	
3.03 CHINA GOVT 260311	28,000,000.00	28,527,699.20	
3.12 CHINA GOVT 261205	37,000,000.00	37,952,394.80	
3.12 CHINA GOVT 521025	15,000,000.00	15,925,417.50	

		3. 13 CHINA GOVT 291121	30,000,000.00	31,193,889.00	
		3. 19 CHINA GOVT 530415	17,000,000.00	18,515,363.00	
		3. 22 CHINA GOVT 251206	18,000,000.00	18,377,582.40	
		3. 25 CHINA GOVT 260606	28,000,000.00	28,729,643.60	
		3. 25 CHINA GOVT 281122	17,000,000.00	17,763,208.20	
		3. 27 CHINA GOVT 301119	35,000,000.00	36,857,716.00	
		3. 28 CHINA GOVT 271203	24,000,000.00	24,957,048.00	
		3. 29 CHINA GOVT 290523	25,000,000.00	26,186,735.00	
		3. 32 CHINA GOVT 520415	17,000,000.00	18,859,454.90	
		3. 39 CHINA GOVT 500316	32,000,000.00	35,543,571.20	
		3. 52 CHINA GOVT 270504	19,000,000.00	19,864,353.70	
		3. 53 CHINA GOVT 511018	16,000,000.00	18,264,547.20	
		3. 54 CHINA GOVT 280816	13,000,000.00	13,758,165.20	
		3. 59 CHINA GOVT 270803	7,000,000.00	7,352,108.40	
		3. 6 CHINA GOVT 250906	8,000,000.00	8,212,487.20	
		3. 61 CHINA GOVT 250607	10,000,000.00	10,232,994.00	
		3. 69 CHINA GOVT 280517	15,000,000.00	15,977,428.50	
		3. 72 CHINA GOVT 510412	21,000,000.00	24,902,215.80	
		3. 77 CHINA GOVT 250308	11,000,000.00	11,235,082.10	
		3. 81 CHINA GOVT 500914	31,000,000.00	36,884,389.00	
		3. 86 CHINA GOVT 490722	25,000,000.00	29,837,662.50	
		4. 08 CHINA GOVT 481022	25,000,000.00	30,759,412.50	
		中国元合計	1,981,000,000.00	2,038,925,536.20 (41,954,562,973)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 250420	800,000.00	771,851.20	
		0 AUSTRIA GOVT 281020	1,790,000.00	1,589,886.95	
		0 AUSTRIA GOVT 300220	2,150,000.00	1,843,797.00	
		0 AUSTRIA GOVT 310220	2,130,000.00	1,771,467.75	
		0 AUSTRIA GOVT 401020	810,000.00	490,173.93	
		0 BEL GOVT 271022	1,800,000.00	1,642,427.10	
		0 BEL GOVT 311022	2,300,000.00	1,875,439.78	
		0 BUND 260815	5,930,000.00	5,589,202.90	
		0 BUND 271115	3,100,000.00	2,854,591.60	
		0 BUND 281115	4,400,000.00	3,974,467.20	
		0 BUND 290815	4,550,000.00	4,047,297.80	
		0 BUND 300215	4,820,000.00	4,241,330.08	

0 BUND 300815	4,960,000.00	4,318,696.80	
0 BUND 300815	1,550,000.00	1,350,928.85	
0 BUND 310215	3,700,000.00	3,186,565.80	
0 BUND 310815	5,400,000.00	4,598,283.60	
0 BUND 310815	1,900,000.00	1,619,343.40	
0 BUND 320215	4,690,000.00	3,944,651.13	
0 BUND 350515	3,630,000.00	2,793,201.51	
0 BUND 360515	3,800,000.00	2,839,056.00	
0 BUND 500815	6,220,000.00	3,261,979.48	
0 BUND 500815	1,560,000.00	822,163.68	
0 BUND 520815	4,540,000.00	2,268,987.58	
0 FINNISH GOVT 300915	750,000.00	632,482.20	
0 IRISH GOVT 311018	1,350,000.00	1,116,184.05	
0 ITALY GOVT 260401	3,300,000.00	3,096,092.27	
0 ITALY GOVT 260801	5,000,000.00	4,648,020.00	
0 NETH GOVT 260115	2,200,000.00	2,091,247.40	
0 NETH GOVT 270115	1,950,000.00	1,817,399.22	
0 NETH GOVT 290115	1,300,000.00	1,156,582.05	
0 NETH GOVT 300715	2,650,000.00	2,271,156.00	
0 NETH GOVT 310715	2,220,000.00	1,854,925.55	
0 NETH GOVT 380115	1,540,000.00	1,054,417.71	
0 NETH GOVT 520115	2,830,000.00	1,368,803.08	
0 O. A. T 250225	5,400,000.00	5,222,369.16	
0 O. A. T 250325	7,380,000.00	7,126,113.24	
0 O. A. T 260225	6,600,000.00	6,256,140.00	
0 O. A. T 270225	6,130,000.00	5,682,387.40	
0 O. A. T 291125	7,180,000.00	6,216,666.58	
0 O. A. T 301125	8,840,000.00	7,445,048.00	
0 O. A. T 311125	8,400,000.00	6,866,815.20	
0 O. A. T 320525	6,530,000.00	5,253,685.38	
0 OBL 250411	2,800,000.00	2,703,652.00	
0 OBL 251010	4,000,000.00	3,827,320.00	
0 OBL 251010	1,000,000.00	958,388.00	
0 OBL 260410	6,910,000.00	6,553,236.70	
0 OBL 261009	2,900,000.00	2,724,680.50	
0 OBL 270416	3,050,000.00	2,838,997.95	

0 SPAIN GOVT 250131	3,630,000.00	3,513,858.15	
0 SPAIN GOVT 250531	2,500,000.00	2,399,885.50	
0 SPAIN GOVT 260131	3,000,000.00	2,836,338.00	
0 SPAIN GOVT 270131	3,800,000.00	3,503,849.43	
0 SPAIN GOVT 280131	3,800,000.00	3,410,952.20	
0.1 BEL GOVT 300622	2,500,000.00	2,141,320.00	
0.1 SPAIN GOVT 310430	4,360,000.00	3,559,756.00	
0.125 FINNISH GOV 310915	1,070,000.00	884,724.15	
0.125 FINNISH GOV 360415	510,000.00	364,114.34	
0.125 FINNISH GOV 520415	750,000.00	349,231.91	
0.2 IRISH GOVT 270515	500,000.00	465,741.35	
0.2 IRISH GOVT 301018	1,220,000.00	1,052,246.90	
0.25 AUSTRIA GOVT 361020	1,050,000.00	750,942.15	
0.25 BUND 270215	4,490,000.00	4,227,101.52	
0.25 BUND 280815	4,170,000.00	3,831,521.10	
0.25 BUND 290215	4,850,000.00	4,417,389.70	
0.25 FINNISH GOVT 400915	540,000.00	345,026.84	
0.25 ITALY GOVT 280315	2,700,000.00	2,409,733.80	
0.25 NETH GOVT 250715	1,930,000.00	1,860,571.72	
0.25 NETH GOVT 290715	2,950,000.00	2,632,063.75	
0.25 O. A. T 261125	5,680,000.00	5,332,952.00	
0.35 BEL GOVT 320622	2,450,000.00	2,016,152.04	
0.35 IRISH GOVT 321018	800,000.00	663,437.28	
0.35 ITALY GOVT 250201	3,060,000.00	2,970,666.36	
0.4 BEL GOVT 400622	1,300,000.00	840,827.00	
0.4 IRISH GOVT 350515	1,020,000.00	792,846.00	
0.45 ITALY GOVT 290215	2,300,000.00	2,010,924.50	
0.5 AUSTRIA GOVT 270420	2,100,000.00	1,971,366.60	
0.5 AUSTRIA GOVT 290220	2,050,000.00	1,852,517.35	
0.5 BUND 250215	7,110,000.00	6,921,227.15	
0.5 BUND 260215	6,660,000.00	6,396,830.10	
0.5 BUND 270815	5,120,000.00	4,826,342.40	
0.5 BUND 280215	4,280,000.00	4,006,127.08	
0.5 FINNISH GOVT 260415	1,670,000.00	1,595,974.24	
0.5 FINNISH GOVT 270915	700,000.00	652,108.10	
0.5 FINNISH GOVT 280915	1,480,000.00	1,350,810.80	

0. 5 FINNISH GOVT 290915	1, 350, 000. 00	1, 206, 818. 59	
0. 5 FINNISH GOVT 430415	780, 000. 00	492, 151. 92	
0. 5 ITALY GOVT 260201	2, 450, 000. 00	2, 332, 057. 58	
0. 5 ITALY GOVT 280715	2, 400, 000. 00	2, 144, 389. 82	
0. 5 NETH GOVT 260715	3, 970, 000. 00	3, 785, 810. 26	
0. 5 NETH GOVT 320715	2, 300, 000. 00	1, 953, 337. 92	
0. 5 NETH GOVT 400115	2, 630, 000. 00	1, 880, 151. 86	
0. 5 O. A. T 250525	6, 490, 000. 00	6, 287, 463. 32	
0. 5 O. A. T 260525	7, 530, 000. 00	7, 181, 496. 54	
0. 5 O. A. T 290525	9, 030, 000. 00	8, 143, 840. 95	
0. 5 O. A. T 400525	3, 990, 000. 00	2, 667, 688. 74	
0. 5 O. A. T 440625	3, 390, 000. 00	2, 040, 166. 41	
0. 5 O. A. T 720525	2, 100, 000. 00	815, 290. 56	
0. 5 SPAIN GOVT 300430	3, 580, 000. 00	3, 101, 858. 78	
0. 5 SPAIN GOVT 311031	3, 190, 000. 00	2, 646, 551. 60	
0. 55 IRISH GOVT 410422	600, 000. 00	408, 046. 80	
0. 6 ITALY GOVT 310801	3, 100, 000. 00	2, 515, 808. 10	
0. 6 SPAIN GOVT 291031	3, 680, 000. 00	3, 249, 793. 28	
0. 65 BEL GOVT 710622	1, 090, 000. 00	456, 050. 55	
0. 7 AUSTRIA GOVT 710420	680, 000. 00	302, 893. 08	
0. 7 SPAIN GOVT 320430	3, 800, 000. 00	3, 160, 087. 60	
0. 75 AUSTRIA GOVT 261020	2, 480, 000. 00	2, 362, 852. 24	
0. 75 AUSTRIA GOVT 280220	1, 690, 000. 00	1, 576, 105. 83	
0. 75 AUSTRIA GOVT 510320	1, 570, 000. 00	910, 926. 56	
0. 75 FINNISH GOVT 310415	1, 050, 000. 00	921, 671. 10	
0. 75 NETH GOVT 270715	2, 670, 000. 00	2, 527, 449. 23	
0. 75 NETH GOVT 280715	3, 020, 000. 00	2, 814, 783. 60	
0. 75 O. A. T 280225	7, 400, 000. 00	6, 909, 972. 00	
0. 75 O. A. T 280525	9, 750, 000. 00	9, 068, 943. 00	
0. 75 O. A. T 281125	9, 060, 000. 00	8, 355, 603. 12	
0. 75 O. A. T 520525	5, 560, 000. 00	3, 022, 927. 52	
0. 75 O. A. T 530525	4, 990, 000. 00	2, 655, 897. 56	
0. 8 BEL GOVT 250622	2, 970, 000. 00	2, 885, 037. 21	
0. 8 BEL GOVT 270622	2, 880, 000. 00	2, 723, 572. 80	
0. 8 BEL GOVT 280622	2, 250, 000. 00	2, 095, 670. 25	
0. 8 SPAIN GOVT 270730	3, 350, 000. 00	3, 136, 685. 40	

0. 8 SPAIN GOVT 290730	5, 430, 000. 00	4, 876, 623. 27	
0. 85 AUSTRIA GOVT 200630	650, 000. 00	283, 904. 40	
0. 85 ITALY GOVT 270115	3, 060, 000. 00	2, 881, 136. 88	
0. 85 SPAIN GOVT 370730	2, 470, 000. 00	1, 777, 297. 20	
0. 875 FINNISH GOV 250915	630, 000. 00	611, 488. 64	
0. 9 AUSTRIA GOVT 320220	2, 120, 000. 00	1, 844, 079. 88	
0. 9 BEL GOVT 290622	3, 090, 000. 00	2, 842, 784. 55	
0. 9 IRISH GOVT 280515	1, 640, 000. 00	1, 543, 256. 40	
0. 9 ITALY GOVT 310401	4, 230, 000. 00	3, 552, 257. 68	
0. 95 ITALY GOVT 270915	4, 000, 000. 00	3, 723, 384. 00	
0. 95 ITALY GOVT 300801	2, 940, 000. 00	2, 525, 677. 56	
0. 95 ITALY GOVT 311201	2, 730, 000. 00	2, 254, 406. 70	
0. 95 ITALY GOVT 320601	3, 600, 000. 00	2, 928, 456. 00	
0. 95 ITALY GOVT 370301	2, 560, 000. 00	1, 770, 992. 64	
1 BEL GOVT 260622	2, 760, 000. 00	2, 659, 903. 08	
1 BEL GOVT 310622	2, 850, 000. 00	2, 536, 690. 95	
1 BUND 250815	5, 580, 000. 00	5, 434, 540. 56	
1 BUND 380515	3, 610, 000. 00	2, 978, 141. 70	
1 IRISH GOVT 260515	1, 850, 000. 00	1, 788, 679. 90	
1 O. A. T 251125	6, 580, 000. 00	6, 381, 645. 90	
1 O. A. T 270525	6, 260, 000. 00	5, 967, 032. 00	
1 SPAIN GOVT 420730	2, 070, 000. 00	1, 337, 075. 10	
1 SPAIN GOVT 501031	3, 650, 000. 00	1, 959, 958. 75	
1. 1 IRISH GOVT 290515	1, 610, 000. 00	1, 505, 420. 84	
1. 1 ITALY GOVT 270401	3, 300, 000. 00	3, 116, 597. 22	
1. 125 FINNISH GOV 340415	730, 000. 00	621, 717. 64	
1. 2 AUSTRIA GOVT 251020	2, 710, 000. 00	2, 641, 312. 34	
1. 2 ITALY GOVT 250815	2, 100, 000. 00	2, 040, 549. 98	
1. 2 SPAIN GOVT 401031	3, 030, 000. 00	2, 111, 516. 10	
1. 25 BEL GOVT 330422	1, 770, 000. 00	1, 559, 371. 77	
1. 25 BUND 480815	5, 990, 000. 00	4, 641, 686. 94	
1. 25 ITALY GOVT 261201	2, 680, 000. 00	2, 559, 426. 80	
1. 25 O. A. T 340525	6, 790, 000. 00	5, 852, 986. 79	
1. 25 O. A. T 360525	7, 150, 000. 00	5, 907, 408. 65	
1. 25 O. A. T 380525	2, 880, 000. 00	2, 280, 124. 80	
1. 25 SPAIN GOVT 301031	4, 030, 000. 00	3, 623, 997. 65	

1. 3 IRISH GOVT 330515	860,000.00	768,772.92	
1. 3 OBL 271015	5,750,000.00	5,566,345.00	
1. 3 OBL 271015	800,000.00	775,530.16	
1. 3 SPAIN GOVT 261031	4,750,000.00	4,571,476.00	
1. 35 IRISH GOVT 310318	1,070,000.00	993,243.55	
1. 35 ITALY GOVT 300401	3,610,000.00	3,214,586.30	
1. 375 FINNISH GOV 270415	800,000.00	772,193.76	
1. 375 FINNISH GOV 470415	840,000.00	612,478.18	
1. 4 BEL GOVT 530622	1,720,000.00	1,101,334.59	
1. 4 SPAIN GOVT 280430	3,740,000.00	3,541,780.00	
1. 4 SPAIN GOVT 280730	4,240,000.00	4,002,390.40	
1. 45 BEL GOVT 370622	1,220,000.00	1,005,478.86	
1. 45 ITALY GOVT 250515	2,300,000.00	2,251,195.70	
1. 45 ITALY GOVT 360301	2,140,000.00	1,629,370.32	
1. 45 SPAIN GOVT 271031	4,330,000.00	4,135,565.68	
1. 45 SPAIN GOVT 290430	3,300,000.00	3,088,400.70	
1. 45 SPAIN GOVT 711031	1,300,000.00	625,657.50	
1. 5 AUSTRIA GOVT 470220	1,810,000.00	1,337,629.82	
1. 5 AUSTRIA GOVT 861102	460,000.00	272,957.10	
1. 5 FINNISH GOVT 320915	750,000.00	680,511.00	
1. 5 IRISH GOVT 500515	1,460,000.00	1,059,526.38	
1. 5 ITALY GOVT 250601	3,300,000.00	3,228,795.90	
1. 5 ITALY GOVT 450430	2,010,000.00	1,248,748.68	
1. 5 O. A. T 310525	9,560,000.00	8,886,268.56	
1. 5 O. A. T 500525	5,230,000.00	3,629,703.68	
1. 5 SPAIN GOVT 270430	4,290,000.00	4,128,344.22	
1. 6 BEL GOVT 470622	1,570,000.00	1,137,713.06	
1. 6 ITALY GOVT 260601	4,120,000.00	3,997,765.28	
1. 6 SPAIN GOVT 250430	3,510,000.00	3,445,057.98	
1. 65 ITALY GOVT 301201	3,870,000.00	3,453,231.96	
1. 65 ITALY GOVT 320301	4,450,000.00	3,864,193.10	
1. 7 BEL GOVT 500622	1,840,000.00	1,315,009.36	
1. 7 BUND 320815	4,350,000.00	4,184,234.55	
1. 7 IRISH GOVT 370515	1,190,000.00	1,039,750.60	
1. 7 ITALY GOVT 510901	2,390,000.00	1,428,436.29	
1. 75 O. A. T 390625	5,470,000.00	4,610,345.74	

1.75 O. A. T 660525	2,590,000.00	1,755,476.10	
1.8 BUND 530815	4,060,000.00	3,479,383.46	
1.8 BUND 530815	1,000,000.00	858,580.00	
1.8 ITALY GOVT 410301	2,640,000.00	1,875,535.20	
1.85 AUSTRIA GOVT 490523	870,000.00	681,898.17	
1.85 ITALY GOVT 250701	2,400,000.00	2,357,493.60	
1.85 SPAIN GOVT 350730	3,510,000.00	3,021,818.67	
1.9 BEL GOVT 380622	1,360,000.00	1,169,938.36	
1.9 SPAIN GOVT 521031	2,920,000.00	1,932,923.20	
1.95 SPAIN GOVT 260430	3,520,000.00	3,455,400.96	
1.95 SPAIN GOVT 300730	3,790,000.00	3,582,838.60	
2 AUSTRIA GOVT 260715	1,000,000.00	986,200.00	
2 IRISH GOVT 450218	1,640,000.00	1,379,659.84	
2 ITALY GOVT 251201	3,530,000.00	3,468,150.87	
2 ITALY GOVT 280201	3,880,000.00	3,732,536.72	
2 NETH GOVT 540115	1,310,000.00	1,123,642.02	
2 O. A. T 321125	7,450,000.00	7,052,251.95	
2 O. A. T 480525	4,650,000.00	3,688,677.60	
2.05 ITALY GOVT 270801	2,650,000.00	2,569,638.75	
2.1 AUSTRIA GOVT 170920	950,000.00	702,711.20	
2.1 BUND 291115	3,800,000.00	3,785,233.20	
2.1 ITALY GOVT 260715	2,350,000.00	2,304,619.15	
2.15 BEL GOVT 660622	1,530,000.00	1,149,403.32	
2.15 ITALY GOVT 520901	1,550,000.00	1,009,852.90	
2.15 ITALY GOVT 720301	850,000.00	507,146.83	
2.15 SPAIN GOVT 251031	6,000,000.00	5,928,915.54	
2.2 ITALY GOVT 270601	2,000,000.00	1,952,460.00	
2.2 OBL 280413	4,250,000.00	4,249,532.50	
2.25 BEL GOVT 570622	1,020,000.00	798,083.70	
2.25 ITALY GOVT 360901	2,720,000.00	2,254,561.76	
2.3 BUND 330215	5,650,000.00	5,686,549.85	
2.3 BUND 330215	950,000.00	956,465.70	
2.35 SPAIN GOVT 330730	3,110,000.00	2,908,608.84	
2.4 AUSTRIA GOVT 340523	1,300,000.00	1,250,769.00	
2.4 BUND 301115	2,580,000.00	2,614,308.84	
2.4 IRISH GOVT 300515	1,490,000.00	1,486,276.49	

2.4 OBL 281019	4,820,000.00	4,864,869.38	
2.45 ITALY GOVT 330901	2,870,000.00	2,585,301.74	
2.45 ITALY GOVT 500901	2,490,000.00	1,776,059.73	
2.5 BUND 440704	4,730,000.00	4,709,353.55	
2.5 BUND 460815	4,950,000.00	4,942,842.30	
2.5 ITALY GOVT 251115	2,330,000.00	2,310,861.38	
2.5 ITALY GOVT 321201	2,850,000.00	2,611,050.30	
2.5 NETH GOVT 300115	600,000.00	602,539.20	
2.5 NETH GOVT 330115	2,750,000.00	2,745,866.75	
2.5 NETH GOVT 330715	1,650,000.00	1,641,585.00	
2.5 O.A.T 260924	7,300,000.00	7,288,035.30	
2.5 O.A.T 300525	9,590,000.00	9,577,535.58	
2.5 O.A.T 430525	2,110,000.00	1,897,660.15	
2.5 SCHATS 250313	1,000,000.00	994,047.33	
2.55 SPAIN GOVT 321031	4,190,000.00	4,021,264.51	
2.6 BUND 330815	4,310,000.00	4,437,515.66	
2.625 FINNISH GOV 420704	940,000.00	884,865.24	
2.65 ITALY GOVT 271201	2,800,000.00	2,764,176.80	
2.7 ITALY GOVT 470301	3,300,000.00	2,552,909.70	
2.7 SPAIN GOVT 481031	2,910,000.00	2,412,252.26	
2.75 BEL GOVT 390422	950,000.00	904,821.80	
2.75 FINNISH GOVT 280704	1,110,000.00	1,121,610.60	
2.75 FINNISH GOVT 380415	680,000.00	658,476.15	
2.75 NETH GOVT 470115	3,320,000.00	3,340,426.63	
2.75 O.A.T 271025	10,320,000.00	10,414,624.08	
2.75 O.A.T 290225	5,250,000.00	5,308,500.75	
2.8 ITALY GOVT 281201	3,680,000.00	3,627,593.12	
2.8 ITALY GOVT 290615	3,200,000.00	3,131,283.20	
2.8 ITALY GOVT 670301	1,510,000.00	1,076,738.72	
2.8 SCHATS 250612	3,470,000.00	3,465,652.09	
2.8 SPAIN GOVT 260531	3,500,000.00	3,499,734.00	
2.875 FINNISH GOV 290415	600,000.00	609,274.80	
2.9 AUSTRIA GOVT 290523	700,000.00	712,749.10	
2.9 AUSTRIA GOVT 330220	2,180,000.00	2,202,443.10	
2.9 SPAIN GOVT 461031	2,990,000.00	2,609,979.97	
2.95 ITALY GOVT 380901	2,380,000.00	2,079,037.93	

3 BEL GOVT 330622	2, 750, 000. 00	2, 793, 848. 75	
3 BEL GOVT 340622	2, 050, 000. 00	2, 073, 640. 60	
3 FINNISH GOVT 330915	920, 000. 00	937, 459. 29	
3 IRISH GOVT 431018	690, 000. 00	697, 890. 84	
3 ITALY GOVT 290801	3, 400, 000. 00	3, 360, 645. 00	
3 O. A. T 330525	5, 500, 000. 00	5, 621, 275. 00	
3 O. A. T 540525	3, 450, 000. 00	3, 244, 785. 02	
3. 1 ITALY GOVT 400301	2, 310, 000. 00	2, 016, 743. 19	
3. 15 AUSTRIA GOVT 440620	1, 250, 000. 00	1, 259, 120. 00	
3. 15 AUSTRIA GOVT 531020	500, 000. 00	501, 840. 00	
3. 15 SPAIN GOVT 330430	3, 500, 000. 00	3, 501, 636. 60	
3. 25 BUND 420704	3, 120, 000. 00	3, 447, 715. 44	
3. 25 ITALY GOVT 380301	2, 220, 000. 00	2, 016, 141. 80	
3. 25 ITALY GOVT 460901	2, 740, 000. 00	2, 336, 751. 46	
3. 25 NETH GOVT 440115	500, 000. 00	537, 861. 50	
3. 25 O. A. T 450525	4, 710, 000. 00	4, 740, 322. 98	
3. 3 BEL GOVT 540622	1, 690, 000. 00	1, 657, 683. 82	
3. 35 ITALY GOVT 350301	3, 110, 000. 00	2, 960, 340. 58	
3. 4 ITALY GOVT 250328	2, 300, 000. 00	2, 303, 033. 24	
3. 4 ITALY GOVT 280401	3, 000, 000. 00	3, 038, 715. 00	
3. 45 AUSTRIA GOVT 301020	700, 000. 00	735, 140. 00	
3. 45 BEL GOVT 430622	800, 000. 00	820, 287. 36	
3. 45 ITALY GOVT 480301	2, 820, 000. 00	2, 472, 389. 88	
3. 45 SPAIN GOVT 430730	1, 800, 000. 00	1, 729, 229. 40	
3. 45 SPAIN GOVT 660730	2, 230, 000. 00	2, 003, 944. 90	
3. 5 ITALY GOVT 260115	2, 500, 000. 00	2, 523, 987. 50	
3. 5 ITALY GOVT 300301	4, 470, 000. 00	4, 518, 642. 54	
3. 5 O. A. T 260425	6, 690, 000. 00	6, 819, 826. 14	
3. 5 O. A. T 331125	2, 620, 000. 00	2, 781, 402. 48	
3. 5 SPAIN GOVT 290531	1, 000, 000. 00	1, 033, 453. 80	
3. 55 SPAIN GOVT 331031	3, 690, 000. 00	3, 798, 807. 03	
3. 6 ITALY GOVT 250929	2, 000, 000. 00	2, 016, 608. 20	
3. 7 ITALY GOVT 300615	2, 350, 000. 00	2, 392, 925. 10	
3. 75 BEL GOVT 450622	1, 620, 000. 00	1, 737, 121. 14	
3. 75 NETH GOVT 420115	2, 940, 000. 00	3, 348, 953. 41	
3. 8 AUSTRIA GOVT 620126	700, 000. 00	802, 956. 70	

3. 8 ITALY GOVT 260415	2, 700, 000. 00	2, 748, 667. 50	
3. 8 ITALY GOVT 280801	3, 090, 000. 00	3, 178, 729. 35	
3. 85 ITALY GOVT 260915	1, 450, 000. 00	1, 482, 916. 45	
3. 85 ITALY GOVT 291215	2, 600, 000. 00	2, 674, 240. 40	
3. 85 ITALY GOVT 490901	2, 180, 000. 00	2, 024, 039. 31	
3. 9 SPAIN GOVT 390730	1, 670, 000. 00	1, 726, 091. 29	
4 BEL GOVT 320328	1, 250, 000. 00	1, 368, 353. 75	
4 BUND 370104	4, 440, 000. 00	5, 209, 505. 28	
4 FINNISH GOVT 250704	240, 000. 00	243, 766. 03	
4 ITALY GOVT 301115	2, 220, 000. 00	2, 297, 108. 14	
4 ITALY GOVT 311030	1, 650, 000. 00	1, 705, 365. 75	
4 ITALY GOVT 350430	2, 150, 000. 00	2, 173, 452. 20	
4 ITALY GOVT 370201	4, 950, 000. 00	4, 960, 132. 65	
4 NETH GOVT 370115	3, 160, 000. 00	3, 599, 248. 21	
4 O. A. T 381025	4, 020, 000. 00	4, 480, 539. 24	
4 O. A. T 550425	3, 090, 000. 00	3, 503, 976. 57	
4 O. A. T 600425	3, 180, 000. 00	3, 654, 454. 40	
4. 1 ITALY GOVT 290201	2, 230, 000. 00	2, 322, 879. 50	
4. 15 AUSTRIA GOVT 370315	2, 540, 000. 00	2, 851, 724. 04	
4. 2 ITALY GOVT 340301	1, 680, 000. 00	1, 738, 623. 60	
4. 2 SPAIN GOVT 370131	3, 460, 000. 00	3, 744, 152. 84	
4. 25 BEL GOVT 410328	2, 380, 000. 00	2, 708, 697. 04	
4. 25 BUND 390704	3, 010, 000. 00	3, 679, 424. 00	
4. 35 ITALY GOVT 331101	3, 270, 000. 00	3, 432, 486. 30	
4. 4 ITALY GOVT 330501	3, 800, 000. 00	4, 015, 395. 40	
4. 45 ITALY GOVT 430901	1, 450, 000. 00	1, 476, 404. 50	
4. 5 BEL GOVT 260328	1, 610, 000. 00	1, 672, 064. 21	
4. 5 ITALY GOVT 260301	3, 740, 000. 00	3, 854, 268. 22	
4. 5 ITALY GOVT 531001	1, 530, 000. 00	1, 548, 852. 66	
4. 5 O. A. T 410425	6, 030, 000. 00	7, 133, 894. 01	
4. 65 SPAIN GOVT 250730	2, 890, 000. 00	2, 958, 863. 49	
4. 7 SPAIN GOVT 410730	3, 300, 000. 00	3, 752, 040. 93	
4. 75 BUND 280704	2, 340, 000. 00	2, 589, 882. 75	
4. 75 BUND 340704	4, 170, 000. 00	5, 105, 748. 00	
4. 75 BUND 400704	3, 230, 000. 00	4, 197, 821. 05	
4. 75 ITALY GOVT 280901	3, 930, 000. 00	4, 201, 747. 71	

	4.75 ITALY GOVT 440901	2,900,000.00	3,072,732.70	
	4.75 O.A.T 350425	4,900,000.00	5,774,194.30	
	4.85 AUSTRIA GOVT 260315	1,370,000.00	1,430,985.55	
	4.9 SPAIN GOVT 400730	3,310,000.00	3,825,956.18	
	5 BEL GOVT 350328	2,950,000.00	3,523,249.31	
	5 ITALY GOVT 250301	4,280,000.00	4,355,670.40	
	5 ITALY GOVT 340801	3,850,000.00	4,239,523.75	
	5 ITALY GOVT 390801	3,980,000.00	4,347,155.00	
	5 ITALY GOVT 400901	3,600,000.00	3,935,385.36	
	5.15 SPAIN GOVT 281031	3,250,000.00	3,593,222.75	
	5.15 SPAIN GOVT 441031	2,640,000.00	3,183,808.32	
	5.25 ITALY GOVT 291101	4,660,000.00	5,151,084.78	
	5.4 IRISH GOVT 250313	2,100,000.00	2,152,237.08	
	5.5 BEL GOVT 280328	3,380,000.00	3,779,745.84	
	5.5 BUND 310104	4,280,000.00	5,189,196.12	
	5.5 NETH GOVT 280115	2,180,000.00	2,431,726.78	
	5.5 O.A.T 290425	6,800,000.00	7,777,207.60	
	5.625 BUND 280104	2,540,000.00	2,862,319.90	
	5.75 ITALY GOVT 330201	3,820,000.00	4,426,799.36	
	5.75 O.A.T 321025	5,490,000.00	6,776,526.60	
	5.75 SPAIN GOVT 320730	3,980,000.00	4,782,268.50	
	5.9 SPAIN GOVT 260730	4,650,000.00	4,994,000.49	
	6 ITALY GOVT 310501	5,030,000.00	5,862,314.10	
	6 O.A.T 251025	5,760,000.00	6,070,988.16	
	6 SPAIN GOVT 290131	4,230,000.00	4,861,604.56	
	6.25 AUSTRIA GOVT 270715	1,630,000.00	1,827,960.24	
	6.25 BUND 300104	1,700,000.00	2,081,426.79	
	6.5 BUND 270704	1,750,000.00	1,990,886.97	
	6.5 ITALY GOVT 271101	3,900,000.00	4,383,221.70	
	7.25 ITALY GOVT 261101	2,300,000.00	2,561,719.30	
ユーロ合計		1,136,870,000.00	1,062,846,365.83 (170,236,102,414)	
合計			521,627,234,978 (521,627,234,978)	

(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。

外貨建有利証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	有利証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 269 銘柄	100.00%	47.24%
カナダドル	国債証券 40 銘柄	100.00%	2.03%
オーストラリアドル	国債証券 27 銘柄	100.00%	1.36%
イギリスポンド	国債証券 59 銘柄	100.00%	5.23%
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 28 銘柄	100.00%	0.51%
ニュージーランドドル	国債証券 10 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 10 銘柄	100.00%	0.16%
デンマーククローネ	国債証券 7 銘柄	100.00%	0.27%
メキシコペソ	国債証券 16 銘柄	100.00%	0.86%
イスラエルシェケル	国債証券 10 銘柄	100.00%	0.29%
ポーランドズロチ	国債証券 13 銘柄	100.00%	0.51%
中国元	国債証券 75 銘柄	100.00%	8.04%
ユーロ	国債証券 366 銘柄	100.00%	32.64%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

新興国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年1月26日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	1,916,851,441
コール・ローン	34,625,300
国債証券	84,312,998,200
派生商品評価勘定	435,651
未収入金	194,897,024
未収利息	1,238,196,857
前払費用	116,021,982
流動資産合計	87,814,026,455
資産合計	87,814,026,455
負債の部	

流動負債	
派生商品評価勘定	450,202
前受収益	188,001
未払金	3,894,125
未払解約金	65,300,606
未払利息	8
流動負債合計	69,832,942
負債合計	69,832,942
純資産の部	
元本等	
元本	49,510,869,131
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	38,233,324,382
元本等合計	87,744,193,513
純資産合計	87,744,193,513
負債純資産合計	87,814,026,455

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1月26日現在]
1. 期首	2023年1月27日
期首元本額	43,842,059,667円
期中追加設定元本額	7,525,241,433円
期中一部解約元本額	1,856,431,969円
元本の内訳※	
eMAXIS バランス(8資産均等型)	3,418,521,516円
eMAXIS バランス(波乗り型)	305,210,639円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,185,760,687円
海外債券セレクション(ラップ向け)	521,700,608円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	17,019,451,149円
つみたて8資産均等バランス	8,379,537,851円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,520,803円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,834,032円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	1,617,811円
ラップ向けインデックスf 新興国債券	2,179,237,577円
eMAXIS 新興国債券インデックス	3,108,700,752円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	12,067,881,762円

eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	90,816,773 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	540,095,515 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	429,232,924 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	204,942,771 円
アドバンスト・バランスⅠ (FOFs用) (適格機関投資家限定)	6,099,084 円
アドバンスト・バランスⅡ (FOFs用) (適格機関投資家限定)	10,364,781 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	36,342,096 円
合計	49,510,869,131 円
2. 受益権の総数	49,510,869,131 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 1 月 27 日 至 2024 年 1 月 26 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、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。
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 1 月 26 日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 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 1月 26日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	
国債証券	1,571,642,902	
合計	1,571,642,902	

(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 1月 26日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	81,465,841	—	81,048,869	△416,972
	メキシコペソ	17,155,000	—	17,150,600	△4,400
	ハンガリーフォリント	6,238,365	—	6,230,790	△7,575
	ポーランドズロチ	10,977,240	—	10,974,330	△2,910
	南アフリカランド	4,687,800	—	4,687,380	△420
	売建				
	メキシコペソ	12,850,500	—	12,867,450	△16,950
	チリペソ	31,668,981	—	31,660,592	8,389
	チェココルナ	9,706,050	—	9,706,800	△750
	コロンビアペソ	49,796,860	—	49,403,678	393,182
	ポーランドズロチ	11,010,420	—	10,976,340	34,080
	南アフリカランド	3,906,875	—	3,907,100	△225
合計	239,463,932	—	238,613,929	△14,551	

(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1月26日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7722円 (17,722円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
マレーシア リング ット	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	21,700,000.00	20,180,490.91	
		3.502MALAYSIAGOV 270531	14,600,000.00	14,599,790.78	
		3.582 MALAYSIAGOV 320715	14,700,000.00	14,398,255.45	
		3.733 MALAYSIAGO 280615	11,450,000.00	11,500,595.26	
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	13,700,000.00	13,185,384.02	
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	11,570,000.00	11,540,556.08	
		3.882 MALAYSIAGOV 250314	8,400,000.00	8,456,091.84	
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	25,550,000.00	25,830,462.35	
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	13,200,000.00	13,357,408.68	
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	10,720,000.00	10,847,141.34	
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	19,100,000.00	19,320,142.78	
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	25,600,000.00	25,819,486.72	
		4.065 MALAYSIAGOV 500615	9,400,000.00	9,149,476.93	
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	9,550,000.00	9,803,600.25	
		4.369 MALAYSIA IN 281031	12,800,000.00	13,210,636.80	
		4.457 MALAYSIAGOV 530331	3,400,000.00	3,528,483.28	
		4.504 MALAYSIAGOV 290430	2,800,000.00	2,913,326.08	
		4.696 MALAYSIAGOV 421015	14,740,000.00	15,889,450.25	
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	12,400,000.00	13,346,082.80	
4.893 MALAYSIAGOV 380608	8,200,000.00	9,003,348.26			
4.921 MALAYSIAGOV 480706	6,100,000.00	6,744,129.50			
マレーシアリングット合計			269,680,000.00	272,624,340.36 (8,496,010,418)	

タイバーツ	国債証券	0.75 THAILAND 240917	51,300,000.00	50,787,729.48	
		0.95 THAILAND 250617	89,000,000.00	87,371,402.35	
		1 THAILAND 270617	114,200,000.00	109,229,499.81	
		1.45 THAILAND 241217	120,600,000.00	119,656,172.34	
		1.585 THAILAND 351217	78,900,000.00	69,521,956.25	
		1.6 THAILAND 291217	90,700,000.00	86,364,875.59	
		1.6 THAILAND 350617	38,200,000.00	33,966,465.13	
		2 THAILAND 311217	127,900,000.00	122,346,305.73	
		2 THAILAND 420617	57,500,000.00	49,027,812.57	
		2.125 THAILAND 261217	96,300,000.00	95,754,019.44	
		2.25 THAILAND 270317	45,800,000.00	45,680,598.02	
		2.35 THAILAND 260617	95,300,000.00	95,380,919.23	
		2.4 THAILAND 290317	38,000,000.00	37,936,581.04	
		2.65 THAILAND 280617	98,600,000.00	99,633,101.22	
		2.875 THAILAND 281217	84,900,000.00	86,703,997.65	
		2.875 THAILAND 460617	67,200,000.00	62,004,973.63	
		3.3 THAILAND 380617	97,000,000.00	101,761,642.70	
		3.35 THAILAND 330617	88,800,000.00	93,473,117.76	
		3.39 THAILAND 370617	72,900,000.00	77,231,331.63	
		3.4 THAILAND 360617	74,000,000.00	78,150,993.00	
3.45 THAILAND 430617	61,300,000.00	64,329,844.45			
3.65 THAILAND 310620	78,100,000.00	83,903,353.27			
3.775 THAILAND 320625	88,600,000.00	96,191,221.42			
3.85 THAILAND 251212	74,700,000.00	76,778,221.23			
4.875 THAILAND 290622	76,300,000.00	85,618,045.94			
タイバーツ合計			2,006,100,000.00	2,008,804,180.88	(8,316,449,308)
フィリピンペソ	国債証券	6.25 PHILIPPI (GL) 360114	20,000,000.00	18,790,990.00	
フィリピンペソ合計			20,000,000.00	18,790,990.00	(49,074,549)
インドネシアルピア	国債証券	10.5 INDONESIA 300815	7,050,000,000.00	8,520,344,475.00	
		11 INDONESIA 250915	8,250,000,000.00	8,842,395,375.00	
		5.125 INDONESIA 270415	31,300,000,000.00	30,244,003,417.00	
		5.5 INDONESIA 260415	44,700,000,000.00	44,110,236,246.00	
		6.125 INDONESIA 280515	29,000,000,000.00	28,733,610,060.00	

		6. 25 INDONESIA 360615	12,000,000,000.00	11,613,626,400.00	
		6. 375 INDONESIA 280815	25,000,000,000.00	24,911,999,000.00	
		6. 375 INDONESIA 320415	48,200,000,000.00	47,564,546,624.00	
		6. 375 INDONESIA 370715	4,000,000,000.00	3,922,448,520.00	
		6. 5 INDONESIA 250615	29,900,000,000.00	29,962,790,000.00	
		6. 5 INDONESIA 310215	47,600,000,000.00	47,072,019,372.00	
		6. 625 INDONESIA 330515	24,400,000,000.00	24,278,000,000.00	
		6. 625 INDONESIA 340215	11,500,000,000.00	11,500,460,000.00	
		6. 875 INDONESIA 290415	9,000,000,000.00	9,144,180,000.00	
		7 INDONESIA 270515	32,450,000,000.00	33,119,242,310.00	
		7 INDONESIA 300915	44,700,000,000.00	45,797,358,180.00	
		7 INDONESIA 330215	41,100,000,000.00	42,214,722,420.00	
		7. 125 INDONESIA 380615	13,700,000,000.00	14,175,253,000.00	
		7. 125 INDONESIA 420615	30,600,000,000.00	31,303,800,000.00	
		7. 125 INDONESIA 430615	13,500,000,000.00	13,828,252,500.00	
		7. 5 INDONESIA 320815	8,400,000,000.00	8,823,564,960.00	
		7. 5 INDONESIA 350615	44,800,000,000.00	47,663,280,000.00	
		7. 5 INDONESIA 380515	23,200,000,000.00	24,687,952,880.00	
		7. 5 INDONESIA 400415	29,400,000,000.00	31,202,937,360.00	
		8. 25 INDONESIA 290515	35,200,000,000.00	37,993,996,480.00	
		8. 25 INDONESIA 320615	19,000,000,000.00	20,845,281,900.00	
		8. 25 INDONESIA 360515	26,600,000,000.00	29,966,855,100.00	
		8. 375 INDONESIA 260915	38,930,000,000.00	40,895,237,009.00	
		8. 375 INDONESIA 340315	46,700,000,000.00	52,586,007,290.00	
		8. 375 INDONESIA 390415	23,200,000,000.00	26,529,220,880.00	
		8. 75 INDONESIA 310515	18,400,000,000.00	20,638,838,400.00	
		9 INDONESIA 290315	24,600,000,000.00	27,261,970,920.00	
		9. 5 INDONESIA 310715	15,700,000,000.00	18,336,621,890.00	
		インドネシアルピア合計	862,080,000,000.00	898,291,052,968.00 (8,443,935,897)	
メキシコ ペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	68,700,000.00	68,301,904.79	
		10 MEXICAN BONOS 361120	15,700,000.00	16,601,808.00	
		5 MEXICAN BONOS 250306	56,000,000.00	53,299,680.00	
		5. 5 MEXICAN BONOS 270304	86,200,000.00	77,147,276.00	
		5. 75 MEXICAN BONO 260305	120,200,000.00	111,021,875.37	
		7 MEXICAN BONOS 260903	27,000,000.00	25,332,210.00	

		7. 5 MEXICAN BONOS 270603	98,200,000.00	93,032,716.00	
		7. 5 MEXICAN BONOS 330526	68,800,000.00	61,343,456.00	
		7. 75 MEXICAN BONO 310529	108,500,000.00	100,118,375.00	
		7. 75 MEXICAN BONO 341123	24,400,000.00	21,874,356.00	
		7. 75 MEXICAN BONO 421113	81,600,000.00	69,936,912.00	
		8 MEXICAN BONOS 240905	24,000,000.00	23,535,285.12	
		8 MEXICAN BONOS 350524	10,000,000.00	9,122,352.70	
		8 MEXICAN BONOS 471107	66,400,000.00	57,789,248.00	
		8 MEXICAN BONOS 530731	51,200,000.00	44,066,304.00	
		8. 5 MEXICAN BONOS 290301	22,000,000.00	21,359,140.00	
		8. 5 MEXICAN BONOS 290531	75,100,000.00	73,193,211.00	
		8. 5 MEXICAN BONOS 381118	57,500,000.00	53,728,000.00	
メキシコペソ合計			1,061,500,000.00	980,804,109.98	(8,422,655,294)
ブラジル リアル	国債証券	10 (IN)BRAZIL NT 270101	40,270,000.00	40,609,323.87	
		10 (IN)BRAZIL NTN 250101	30,900,000.00	31,069,805.38	
		10 (IN)BRAZIL NTN 310101	12,600,000.00	12,378,378.60	
		10 (IN)BRAZIL NTN 330101	20,700,000.00	20,191,557.07	
		10(IN) BRAZIL NTN 290101	42,300,000.00	42,164,193.73	
		BRAZIL-LTN 250701	33,300,000.00	29,156,951.49	
		BRAZIL-LTN 260101	52,700,000.00	44,027,018.16	
		BRAZIL-LTN 260701	61,800,000.00	49,247,721.02	
		BRAZIL-LTN 270701	29,200,000.00	21,027,180.73	
ブラジルリアル合計			323,770,000.00	289,872,130.05	(8,699,932,239)
チリペソ	国債証券	2. 3 BONOS TESORER 281001	480,000,000.00	426,360,000.00	
		2. 5 BONOS TESORER 250301	1,860,000,000.00	1,817,127,000.00	
		4. 5 BONOS TESORER 260301	1,420,000,000.00	1,427,455,000.00	
		4. 7 BONOS TESORER 300901	1,570,000,000.00	1,544,016,500.00	
		5 BONOS TESORERIA 281001	410,000,000.00	411,156,909.00	
		5 BONOS TESORERIA 350301	1,470,000,000.00	1,445,018,202.00	
		6 BONOS TESORERIA 330401	950,000,000.00	1,010,712,457.00	
		6 BONOS TESORERIA 430101	1,315,000,000.00	1,424,342,250.00	
		7 BONOS TESORERIA 340501	350,000,000.00	398,982,650.00	
チリペソ合計			9,825,000,000.00	9,905,170,968.00	(1,607,361,618)

チェコ コ ル ナ	国債証券	0.05 CZECH REPUB 291129	83,000,000.00	66,888,704.00	
		0.25 CZECH REPUB 270210	143,500,000.00	128,822,820.00	
		1.5 CZECH REPUB 400424	20,500,000.00	14,391,000.00	
		1.75 CZECH REPUB 320623	119,200,000.00	101,267,552.00	
		1.95 CZECH REPUB 370730	24,300,000.00	19,183,878.00	
		3.5 CZECH REPUB 350530	81,500,000.00	78,158,500.00	
		4.5 CZECH REPUB 321111	21,000,000.00	21,897,750.00	
		4.9 CZECH REPUB 340414	32,000,000.00	34,561,600.00	
		5 CZECH REPUBLIC 300930	79,700,000.00	84,992,877.00	
		5.5 CZECH REPUB 281212	108,000,000.00	116,316,000.00	
		6 CZECH REPUBLIC 260226	138,500,000.00	144,923,353.00	
6.2 CZECH REPUB 310616	5,000,000.00	5,768,000.00			
チェココルナ合計			856,200,000.00	817,172,034.00	(5,291,270,637)
コロン ビ ア ペ ソ	国債証券	13.25 TITULOS DE 330209	7,900,000,000.00	9,535,673,749.00	
		5.75 TITULOS DE T 271103	6,900,000,000.00	6,203,379,036.00	
		6 TITULOS DE TESO 280428	11,980,000,000.00	10,729,133,098.60	
		6.25 TITULOS DE T 251126	6,690,000,000.00	6,428,670,871.50	
		6.25 TITULOS DE T 360709	4,900,000,000.00	3,669,331,925.00	
		7 TITULOS DE TESO 310326	12,080,000,000.00	10,662,043,801.60	
		7 TITULOS DE TESO 320630	11,700,000,000.00	10,020,114,936.00	
		7.25 TITULOS DE T 341018	10,000,000,000.00	8,419,269,300.00	
		7.25 TITULOS DE T 501026	9,400,000,000.00	7,008,575,892.00	
		7.5 TITULOS DE TE 260826	11,120,000,000.00	10,751,066,533.60	
		7.75 TITULOS DE T 300918	8,340,000,000.00	7,754,790,790.20	
		9.25 TITULOS DE T 420528	12,100,000,000.00	11,200,835,206.00	
コロンビアペソ合計			113,110,000,000.00	102,382,885,139.50	(3,833,624,751)
ハンガ リ ー フ ォ リ ン ト	国債証券	1 HUNGARY 251126	427,000,000.00	392,248,092.60	
		1.5 HUNGARY 260422	560,000,000.00	511,196,000.00	
		1.5 HUNGARY 260826	270,000,000.00	241,683,750.00	
		2 HUNGARY 290523	330,000,000.00	274,543,500.00	
		2.25 HUNGARY 330420	505,000,000.00	376,277,722.00	
		2.25 HUNGARY 340622	150,000,000.00	108,870,300.00	
		2.5 HUNGARY 241024	290,000,000.00	281,453,642.00	
		2.75 HUNGARY 261222	373,000,000.00	341,340,021.10	

		3 HUNGARY 271027	541,000,000.00	491,868,760.40	
		3 HUNGARY 300821	518,000,000.00	440,245,195.60	
		3 HUNGARY 381027	392,000,000.00	271,885,280.80	
		3 HUNGARY 410425	205,000,000.00	136,058,500.00	
		3.25 HUNGARY 311022	618,000,000.00	520,870,299.60	
		4.5 HUNGARY 280323	360,000,000.00	343,131,120.00	
		4.75 HUNGARY 321124	440,000,000.00	405,064,167.20	
		5.5 HUNGARY 250624	492,000,000.00	489,581,918.40	
		6.75 HUNGARY 281022	582,000,000.00	603,613,792.20	
		9.5 HUNGARY 261021	180,000,000.00	194,978,232.00	
ハンガリーフォリント合計			7,233,000,000.00	6,424,910,293.90	(2,672,062,367)
ペルーヌ エボソル	国債証券	5.35 PERU 400812	3,250,000.00	2,784,805.69	
		5.4 PERU 340812	5,200,000.00	4,716,694.32	
		5.94 PERU 290212	6,600,000.00	6,728,965.78	
		6.15 PERU 320812	6,900,000.00	6,783,228.19	
		6.35 PERU 280812	4,900,000.00	5,105,919.02	
		6.9 PERU 370812	7,000,000.00	7,039,493.16	
		6.95 PERU 310812	6,800,000.00	7,098,976.75	
		7.3 PERU 330812	6,400,000.00	6,740,675.45	
		8.2 PERU 260812	3,000,000.00	3,216,326.58	
ペルーヌエボソル合計			50,050,000.00	50,215,084.94	(1,968,325,877)
ポーランド ドズロチ	国債証券	0 POLAND 251025	10,700,000.00	9,849,981.39	
		0.25 POLAND 261025	12,200,000.00	10,750,542.40	
		0.75 POLAND 250425	12,500,000.00	11,876,875.00	
		1.25 POLAND 301025	15,100,000.00	11,808,939.90	
		1.75 POLAND 320425	14,100,000.00	10,853,136.60	
		2.25 POLAND 241025	8,500,000.00	8,332,805.00	
		2.5 POLAND 260725	17,000,000.00	16,027,991.00	
		2.5 POLAND 270725	10,900,000.00	10,044,033.90	
		2.75 POLAND 280425	14,750,000.00	13,467,649.75	
		2.75 POLAND 291025	17,200,000.00	15,233,403.60	
		3.25 POLAND 250725	14,500,000.00	14,135,557.00	
		3.75 POLAND 270525	12,900,000.00	12,413,876.40	
		6 POLAND 331025	12,500,000.00	13,087,825.00	

		7.5 POLAND 280725	17,000,000.00	18,577,659.50	
ポーランドズロチ合計			189,850,000.00	176,460,276.44 (6,459,822,507)	
南アフリ カランド	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	105,600,000.00	110,388,960.00	
		11.625 SOUTH AFRI 530331	12,200,000.00	11,615,992.10	
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	39,800,000.00	26,238,150.00	
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	35,300,000.00	21,326,495.00	
		7 SOUTH AFRICA 310228	71,000,000.00	59,629,350.00	
		8 SOUTH AFRICA 300131	135,300,000.00	125,003,670.00	
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	120,700,000.00	105,389,205.00	
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	103,400,000.00	80,838,120.00	
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	97,200,000.00	71,947,440.00	
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	146,200,000.00	107,530,100.00	
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	112,500,000.00	94,950,000.00	
		9 SOUTH AFRICA 400131	88,900,000.00	69,386,450.00	
南アフリカランド合計			1,068,100,000.00	884,243,932.10 (6,914,787,549)	
ウルグアイ ペソ	国債証券	8.25 URUGUAY 310521	17,000,000.00	16,150,666.74	
		8.5 URUGUAY(GL) 280315	7,000,000.00	6,761,439.09	
		9.75 URUGUAY 330720	17,000,000.00	17,552,500.00	
ウルグアイペソ合計			41,000,000.00	40,464,605.83 (153,223,276)	
中国元	国債証券	1.99 CHINA GOVT 250409	14,000,000.00	13,975,314.64	
		2.18 CHINA GOVT 250825	3,000,000.00	2,999,433.69	
		2.18 CHINA GOVT 260815	8,000,000.00	7,990,636.48	
		2.24 CHINA GOVT 250525	3,000,000.00	3,002,873.10	
		2.26 CHINA GOVT 250224	6,000,000.00	6,010,859.40	
		2.28 CHINA GOVT 251125	4,000,000.00	4,006,997.60	
		2.3 CHINA GOVT 260515	5,000,000.00	5,005,520.50	
		2.37 CHINA GOVT 270120	8,000,000.00	8,025,675.20	
		2.4 CHINA GOVT 280715	5,000,000.00	5,002,370.00	
		2.44 CHINA GOVT 271015	5,000,000.00	5,018,624.50	
		2.46 CHINA GOVT 260215	8,000,000.00	8,041,025.60	
		2.48 CHINA GOVT 270415	5,000,000.00	5,020,897.00	
		2.48 CHINA GOVT 280925	3,000,000.00	3,014,713.20	
		2.5 CHINA GOVT 270725	7,000,000.00	7,039,258.10	

2.52 CHINA GOVT 330825	9,000,000.00	8,985,137.76	
2.55 CHINA GOVT 281015	6,000,000.00	6,055,955.40	
2.6 CHINA GOVT 300915	7,000,000.00	7,051,919.00	
2.6 CHINA GOVT 320901	6,000,000.00	6,016,253.40	
2.62 CHINA GOVT 280415	7,000,000.00	7,084,623.70	
2.62 CHINA GOVT 290925	6,000,000.00	6,062,739.00	
2.62 CHINA GOVT 300625	5,000,000.00	5,040,303.50	
2.64 CHINA GOVT 280115	7,000,000.00	7,080,840.20	
2.67 CHINA GOVT 330525	8,000,000.00	8,077,725.60	
2.67 CHINA GOVT 331125	7,000,000.00	7,090,783.00	
2.68 CHINA GOVT 300521	16,000,000.00	16,194,305.60	
2.69 CHINA GOVT 260812	10,000,000.00	10,112,034.00	
2.69 CHINA GOVT 320815	7,000,000.00	7,074,574.50	
2.75 CHINA GOVT 290615	3,000,000.00	3,053,419.20	
2.75 CHINA GOVT 320217	7,000,000.00	7,117,208.70	
2.76 CHINA GOVT 320515	5,000,000.00	5,082,915.50	
2.79 CHINA GOVT 291215	4,000,000.00	4,076,497.60	
2.8 CHINA GOVT 290324	2,000,000.00	2,040,035.20	
2.8 CHINA GOVT 300325	4,000,000.00	4,074,566.00	
2.8 CHINA GOVT 321115	6,000,000.00	6,112,263.00	
2.85 CHINA GOVT 270604	12,000,000.00	12,214,293.60	
2.88 CHINA GOVT 330225	7,000,000.00	7,195,867.70	
2.89 CHINA GOVT 311118	5,000,000.00	5,136,295.00	
2.91 CHINA GOVT 281014	4,000,000.00	4,100,139.60	
2.94 CHINA GOVT 241017	4,000,000.00	4,026,287.60	
3 CHINA GOVT 531015	1,000,000.00	1,057,842.70	
3.01 CHINA GOVT 280513	12,000,000.00	12,348,663.60	
3.02 CHINA GOVT 251022	15,000,000.00	15,238,374.00	
3.02 CHINA GOVT 310527	10,000,000.00	10,349,781.00	
3.03 CHINA GOVT 260311	7,000,000.00	7,131,924.80	
3.12 CHINA GOVT 261205	7,000,000.00	7,180,182.80	
3.12 CHINA GOVT 521025	4,000,000.00	4,246,778.00	
3.13 CHINA GOVT 291121	14,000,000.00	14,557,148.20	
3.19 CHINA GOVT 530415	4,000,000.00	4,356,556.00	
3.22 CHINA GOVT 251206	9,000,000.00	9,188,791.20	
3.25 CHINA GOVT 260606	12,200,000.00	12,517,916.14	

		3. 25 CHINA GOVT 281122	10,000,000.00	10,448,946.00	
		3. 27 CHINA GOVT 301119	10,000,000.00	10,530,776.00	
		3. 28 CHINA GOVT 271203	11,000,000.00	11,438,647.00	
		3. 29 CHINA GOVT 290523	15,000,000.00	15,712,041.00	
		3. 32 CHINA GOVT 520415	5,000,000.00	5,546,898.50	
		3. 53 CHINA GOVT 511018	4,000,000.00	4,566,136.80	
		3. 72 CHINA GOVT 510412	5,000,000.00	5,929,099.00	
		3. 81 CHINA GOVT 500914	8,000,000.00	9,518,552.00	
中国元合計			411,200,000.00	422,176,237.11 (8,687,035,995)	
ドミニカ ペソ	国債証券	11. 25 DOMINICAN 350915	32,000,000.00	34,604,758.40	
		13. 625 DOMINICAN 330203	16,000,000.00	19,495,551.20	
ドミニカペソ合計			48,000,000.00	54,100,309.60 (135,651,116)	
セルビア ディナール	国債証券	4. 5 SERBIA TREASU 260111	61,000,000.00	60,351,570.00	
		4. 5 SERBIA TREASU 320820	74,000,000.00	66,877,500.00	
		5. 875 SERBIA TREA 280208	50,000,000.00	51,125,000.00	
セルビアディナール合計			185,000,000.00	178,354,070.00 (243,553,897)	
ルーマニ アレイ	国債証券	2. 5 ROMANIA GOVER 271025	4,000,000.00	3,535,226.12	
		3. 25 ROMANIA GOVE 260624	3,200,000.00	3,020,936.89	
		3. 5 ROMANIA GOVER 251125	4,500,000.00	4,326,826.36	
		3. 65 ROMANIA GOVE 250728	4,000,000.00	3,887,353.52	
		3. 65 ROMANIA GOVE 310924	5,500,000.00	4,634,650.57	
		3. 7 ROMANIA GOVER 241125	1,000,000.00	984,192.49	
		4. 15 ROMANIA GOVE 280126	5,200,000.00	4,848,332.89	
		4. 15 ROMANIA GOVE 301024	5,000,000.00	4,437,900.00	
		4. 25 ROMANIA GOVE 360428	3,800,000.00	3,122,571.56	
		4. 75 ROMANIA GOVE 250224	6,900,000.00	6,816,514.41	
		4. 75 ROMANIA GOVE 341011	5,200,000.00	4,548,038.14	
		4. 85 ROMANIA GOVE 260422	4,900,000.00	4,787,792.35	
		4. 85 ROMANIA GOVE 290725	4,800,000.00	4,498,464.00	
		5 ROMANIA GOVERN 290212	6,260,000.00	5,936,519.69	
		5. 8 ROMANIA GOV 270726	5,800,000.00	5,746,676.94	
		6. 7 ROMANIA GOVER 320225	5,900,000.00	6,039,884.28	
7. 2 ROMANIA GOVER 261028	3,200,000.00	3,299,161.28			

		7. 2 ROMANIA GOVER 270531	1, 500, 000. 00	1, 551, 759. 75	
		7. 2 ROMANIA GOVER 331030	2, 200, 000. 00	2, 321, 726. 00	
		7. 35 ROMANIA GOVE 310428	2, 800, 000. 00	2, 954, 112. 00	
		7. 9 ROMANIA GOVER 380224	3, 900, 000. 00	4, 425, 096. 00	
		8 ROMANIA GOVERN 300429	2, 900, 000. 00	3, 145, 659. 00	
		8. 25 ROMANIA GOVE 320929	5, 200, 000. 00	5, 825, 948. 96	
		8. 75 ROMANIA GOVE 281030	5, 500, 000. 00	6, 053, 781. 25	
ルーマニアレイ合計			103, 160, 000. 00	100, 749, 124. 45 (3, 242, 116, 899)	
トルコリラ	国債証券	10. 5 TURKEY GOVT 270811	23, 900, 000. 00	15, 570, 850. 00	
		10. 6 TURKEY GOVT 260211	9, 600, 000. 00	6, 412, 800. 00	
		11 TURKEY GOVT 270224	4, 500, 000. 00	2, 866, 500. 00	
		11. 7 TURKEY GOVT 301113	14, 100, 000. 00	9, 038, 100. 00	
		12. 4 TURKEY GOVT 280308	29, 100, 000. 00	19, 409, 700. 00	
		12. 6 TURKEY GOVT 251001	14, 600, 000. 00	10, 077, 650. 00	
		16. 9 TURKEY GOVT 260902	17, 200, 000. 00	12, 805, 400. 00	
		17. 3 TURKEY GOVT 280719	48, 000, 000. 00	36, 816, 000. 00	
		17. 8 TURKEY GOVT 330713	28, 000, 000. 00	20, 888, 000. 00	
		8 TURKEY GOVT 250312	6, 300, 000. 00	4, 737, 600. 00	
トルコリラ合計			195, 300, 000. 00	138, 622, 600. 00 (676, 104, 006)	
合計				84, 312, 998, 200 (84, 312, 998, 200)	

(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
マレーシアリングット	国債証券 21 銘柄	100. 00%	10. 08%
タイバーツ	国債証券 25 銘柄	100. 00%	9. 86%
フィリピンペソ	国債証券 1 銘柄	100. 00%	0. 06%
インドネシアルピア	国債証券 33 銘柄	100. 00%	10. 01%
メキシコペソ	国債証券 18 銘柄	100. 00%	9. 99%
ブラジルリアル	国債証券 9 銘柄	100. 00%	10. 32%
チリペソ	国債証券 9 銘柄	100. 00%	1. 91%
チェココルナ	国債証券 12 銘柄	100. 00%	6. 28%

コロンビアペソ	国債証券	12 銘柄	100.00%	4.55%
ハンガリーフォリント	国債証券	18 銘柄	100.00%	3.17%
ペルーヌエボソル	国債証券	9 銘柄	100.00%	2.33%
ポーランドズロチ	国債証券	14 銘柄	100.00%	7.66%
南アフリカランド	国債証券	12 銘柄	100.00%	8.20%
ウルグアイペソ	国債証券	3 銘柄	100.00%	0.18%
中国元	国債証券	58 銘柄	100.00%	10.30%
ドミニカペソ	国債証券	2 銘柄	100.00%	0.16%
セルビアディナール	国債証券	3 銘柄	100.00%	0.29%
ルーマニアレイ	国債証券	24 銘柄	100.00%	3.85%
トルコリラ	国債証券	10 銘柄	100.00%	0.80%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

東証REIT指数マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年1月26日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,019,994,112
投資証券	100,546,877,425
派生商品評価勘定	1,883,400
未収配当金	749,152,064
未収利息	109,013
前払金	8,907,650
その他未収収益	231,550
差入委託証拠金	106,347,456
流動資産合計	112,433,502,670
資産合計	112,433,502,670
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,800,810
未払金	580,943,276
未払解約金	67,188,016
未払利息	2,816
受入担保金	9,576,322,875
流動負債合計	10,232,257,793
負債合計	10,232,257,793
純資産の部	

元本等	
元本	28,967,583,332
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	73,233,661,545
元本等合計	102,201,244,877
純資産合計	102,201,244,877
負債純資産合計	112,433,502,670

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年1月26日現在]
1. 期首	2023年1月27日
期首元本額	22,777,413,306円
期中追加設定元本額	9,412,859,047円
期中一部解約元本額	3,222,689,021円
元本の内訳※	
eMAXIS 国内リートインデックス	4,005,255,931円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,695,074,917円
eMAXIS バランス(波乗り型)	150,884,725円
三菱UFJ <DC>J-REITインデックスファンド	698,361,080円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	438,307,742円
J-REITインデックスファンド(ラップ向け)	84,480,105円
オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け)	1,157,018,741円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	8,498,954,748円
つみたて8資産均等バランス	4,160,894,592円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	759,099円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,427,207円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	538,674円
eMAXIS Slim 国内リートインデックス	4,416,581,169円
ラップ向けインデックスf 国内リート	513,469,091円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型)	104,487,466円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型)	865,517,622円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型)	105,723,123円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	3,885,032円
三菱UFJ 国内リートインデックスファンド	36,663,864円
アクティブアロケーションファンド(ラップ向け)	4,977,713円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	2,964,387円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	22,277,579円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	27,504,631円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	45,142,333円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	201,173,222円

eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	171,204,247 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	70,532,341 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)	13,433,589 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)	243,749 円
MUKAM 3資産インカムバランスファンド (適格機関投資家転売制限付)	377,898,956 円
日本リートインデックスファンドS	397,889,264 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	36,872,615 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	36,352,853 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	36,383,347 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	36,098,235 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	36,247,289 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	36,375,423 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)	35,735,992 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	35,712,758 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	36,183,882 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	36,150,033 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	41,025,580 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	40,524,225 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	41,189,187 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	40,129,598 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	41,380,171 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	43,683,780 円
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)	42,265,508 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定)	41,745,917 円
合計	28,967,583,332 円
2. 貸付有価証券 貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っており ます。 投資証券	9,053,501,950 円
3. 受益権の総数	28,967,583,332 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 1 月 27 日 至 2024 年 1 月 26 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和 26 年法律第 198 号)第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、不動産投信指数先物取引を利用しております。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>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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 1月 26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 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 1月 26日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
投資証券	△1,323,836,122
合計	△1,323,836,122

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

投資証券関連

[2024年 1月 26日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	1,798,195,150	—	1,792,290,500	△5,904,650
合計		1,798,195,150	—	1,792,290,500	△5,904,650

(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。

(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1月26日現在]
1口当たり純資産額	3,5281円
(1万口当たり純資産額)	(35,281円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	エスコンジヤパンリート投資法人	1,982	242,200,400	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,124	288,032,800	貸付有価証券 283口
	S O S i L A物流リート投資法人	4,865	583,313,500	貸付有価証券 258口
	東海道リート投資法人	1,447	185,939,500	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,367	2,047,136,000	貸付有価証券 384口
	森ヒルズリート投資法人	11,467	1,609,966,800	
	産業ファンド投資法人	14,878	2,060,603,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	9,567	3,166,677,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,116	2,092,444,000	貸付有価証券 580口
	G L P投資法人	32,938	4,354,403,600	貸付有価証券 3,326口
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,795	1,515,220,000	
	日本プロロジスリート投資法人	16,987	4,588,188,700	貸付有価証券 1,750口
	星野リゾート・リート投資法人	1,799	948,073,000	貸付有価証券 176口
	O n e リート投資法人	1,701	463,352,400	貸付有価証券 180口

イオンリート投資法人	11,961	1,703,246,400	
ヒューリックリート投資法人	9,123	1,427,749,500	貸付有価証券 931 口
日本リート投資法人	3,167	1,086,281,000	貸付有価証券 376 口
積水ハウス・リート投資法人	29,301	2,300,128,500	貸付有価証券 3,402 口
トーセイ・リート投資法人	2,053	288,035,900	貸付有価証券 256 口
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,404	331,752,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,657	294,661,300	
野村不動産マスターファンド投資法人	31,533	5,073,659,700	貸付有価証券 3,740 口
いちごホテルリート投資法人	1,615	194,123,000	
ラサールロジポート投資法人	12,465	1,873,489,500	貸付有価証券 1,081 口
スターアジア不動産投資法人	15,028	892,663,200	
マリモ地方創生リート投資法人	1,503	186,822,900	貸付有価証券 108 口
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,056	1,877,928,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,491	112,570,500	貸付有価証券 187 口
投資法人みらい	13,382	605,535,500	貸付有価証券 1,249 口
三菱地所物流リート投資法人	3,367	1,269,359,000	貸付有価証券 230 口
CRE ロジスティクスファンド投資法人	4,198	645,232,600	貸付有価証券 316 口
ザイマックス・リート投資法人	1,582	190,156,400	貸付有価証券 177 口
タカラレーベン不動産投資法人	4,623	485,415,000	貸付有価証券 347 口
アドバンス・ロジスティクス投資法人	4,273	549,935,100	貸付有価証券 365 口
日本ビルファンド投資法人	11,375	6,756,750,000	貸付有価証券 1,120 口
ジャパンリアルエステイト投資法人	10,016	5,669,056,000	貸付有価証券 1,157 口
日本都市ファンド投資法人	46,740	4,678,674,000	貸付有価証券 5,787 口
オリックス不動産投資法人	19,429	3,316,530,300	貸付有価証券 2,304 口
日本プライムリアルティ投資法人	6,669	2,364,160,500	貸付有価証券 720 口
N T T都市開発リート投資法人	9,886	1,248,601,800	貸付有価証券 1,045 口

東急リアル・エステート投資法人	6,538	1,154,610,800	
グローバル・ワン不動産投資法人	7,200	790,560,000	貸付有価証券 803 口
ユナイテッド・アーバン投資法人	21,813	3,295,944,300	貸付有価証券 2,473 口
森トラストリート投資法人	18,795	1,403,986,500	貸付有価証券 2,114 口
インヴィンシブル投資法人	47,213	2,875,271,700	貸付有価証券 4,836 口
フロンティア不動産投資法人	3,618	1,555,740,000	貸付有価証券 384 口
平和不動産リート投資法人	7,285	1,008,244,000	貸付有価証券 720 口
日本ロジスティクスファンド投資法人	6,246	1,768,242,600	
福岡リート投資法人	5,043	874,960,500	貸付有価証券 598 口
KDX不動産投資法人	28,062	4,534,819,200	貸付有価証券 3,156 口
いちごオフィスリート投資法人	7,990	660,773,000	貸付有価証券 959 口
大和証券オフィス投資法人	2,020	1,242,300,000	貸付有価証券 247 口
阪急阪神リート投資法人	4,649	675,964,600	貸付有価証券 522 口
スタートプロシード投資法人	1,690	344,253,000	貸付有価証券 180 口
大和ハウスリート投資法人	14,698	3,742,110,800	貸付有価証券 1,650 口
ジャパン・ホテル・リート投資法人	32,642	2,480,792,000	貸付有価証券 3,726 口
大和証券リビング投資法人	14,359	1,532,105,300	貸付有価証券 1,459 口
ジャパンエクセレント投資法人	8,474	1,028,743,600	貸付有価証券 1,073 口
東海道リート投資法人（新）	75	9,387,225	
合計	616,340	100,546,877,425	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

MUAM G-R E I Tマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[2024年1月26日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	1,689,286,206
コール・ローン	63,549,592
投資証券	114,243,194,378
派生商品評価勘定	1,143,085
未収配当金	121,253,203
差入委託証拠金	976,900,976
流動資産合計	117,095,327,440
資産合計	117,095,327,440
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	76,042,068
未払金	4,932,000
未払解約金	21,936,492
未払利息	16
流動負債合計	102,910,576
負債合計	102,910,576
純資産の部	
元本等	
元本	45,744,488,251
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	71,247,928,613
元本等合計	116,992,416,864
純資産合計	116,992,416,864
負債純資産合計	117,095,327,440

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1月26日現在]
1. 期首	2023年1月27日
期首元本額	41,064,470,321円

期中追加設定元本額	10,702,168,351円
期中一部解約元本額	6,022,150,421円
元本の内訳※	
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	106,582,570円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	95,500,282円
三菱UFJ 資産設計ファンド(分配型)	28,829,170円
三菱UFJ 資産設計ファンド(バランス型)	54,285,579円
三菱UFJ 資産設計ファンド(株式重視型)	25,656,879円
eMAXIS 先進国リートインデックス	5,942,148,124円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,335,075,502円
eMAXIS バランス(波乗り型)	210,075,177円
三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド	3,258,768,710円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	600,883,350円
オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け)	1,567,691,742円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	11,694,445,104円
つみたて8資産均等バランス	5,744,131,977円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,574,407円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,949,479円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	1,115,972円
eMAXIS Slim 先進国リートインデックス	10,101,239,116円
三菱UFJ 先進国リートインデックスファンド	97,475,181円
ラップ向けインデックスf 先進国リート	875,051,316円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型)	64,670,216円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型)	777,967,410円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型)	300,321,949円
ラップ向けインデックスf 先進国リート(為替ヘッジあり)	303,009円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	3,944,730円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	34,400,995円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	57,075,291円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	93,671,219円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	417,450,558円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	356,143,118円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	141,510,853円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	18,416,331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)	151,675円
海外リートインデックスファンドS	734,981,260円
合計	45,744,488,251円
2. 受益権の総数	45,744,488,251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1月27日 至 2024年1月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、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、不動産投信指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リ

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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>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 1月 26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 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 1月 26日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	△2,021,629,380
合計	△2,021,629,380

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

投資証券関連

[2024年 1月 26日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	3,324,406,491	—	3,249,540,315	△74,866,176
合計		3,324,406,491	—	3,249,540,315	△74,866,176

(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1月26日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	397,095,922	—	397,069,206	△26,716
	オーストラリアドル	34,303,509	—	34,305,351	1,842
	イギリスポンド	24,378,919	—	24,376,225	△2,694
	シンガポールドル	15,972,168	—	15,967,582	△4,586
	ユーロ	17,130,700	—	17,130,047	△653
合計		488,881,218	—	488,848,411	△32,807

(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1月26日現在]
1口当たり純資産額	2,5575円
(1万口当たり純資産額)	(25,575円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
アメリカ ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	54,731	962,718.29	
		AGREE REALTY CORP	58,629	3,498,392.43	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	42,082	753,688.62	
		ALEXANDER' S INC	1,131	259,225.20	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	90,567	11,177,779.14	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	8,816	140,967.84	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	29,861	709,198.75	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	184,085	6,413,521.40	
		AMERICOLD REALTY TRUST INC	153,871	4,396,094.47	
		APARTMENT INCOME REIT CO	83,510	2,774,202.20	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	84,829	649,790.14	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	127,458	2,091,585.78	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	38,034	460,972.08	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15,953	22,653.26	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	82,502	14,530,252.24	
		BOSTON PROPERTIES INC	83,248	5,952,232.00	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	34,741	83,378.40	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	96,861	491,085.27	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	176,710	4,032,522.20	
		BROADSTONE NET LEASE INC	111,165	1,833,110.85	
		BRT APARTMENTS CORP	8,081	143,599.37	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	61,631	5,907,947.66	
		CARETRUST REIT INC	71,487	1,532,681.28	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	15,865	384,091.65	
		CENTERSPACE	8,971	505,964.40	
		CHATHAM LODGING TRUST	29,966	326,030.08	
		CITY OFFICE REIT INC	25,899	146,070.36	
		CLIPPER REALTY INC	11,551	58,448.06	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	14,982	391,030.20	
		COPT DEFENSE PROPERTIES	67,568	1,652,037.60	
		COUSINS PROPERTIES INC	90,985	2,111,761.85	
		CTO REALTY GROWTH INC	12,027	202,294.14	
CUBESMART	130,093	5,894,513.83			
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	126,684	1,162,959.12			

DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	423,000	262,260.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	176,078	25,036,530.82	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	131,456	381,222.40	
DOUGLAS EMMETT INC	95,343	1,383,426.93	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	202,000	—	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	57,051	731,393.82	
EASTGROUP PROPERTIES INC	27,135	4,845,225.60	
ELME COMMUNITIES	51,661	756,833.65	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	78,964	808,591.36	
EPR PROPERTIES	45,244	2,017,882.40	
EQUINIX INC	54,575	44,495,543.25	
EQUITY COMMONWEALTH	63,262	1,210,202.06	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	108,343	7,188,558.05	
EQUITY RESIDENTIAL	200,612	11,808,022.32	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	92,599	2,307,567.08	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	37,274	8,719,134.08	
EXTRA SPACE STORAGE INC	122,744	18,267,989.52	
FARMLAND PARTNERS INC	29,083	335,617.82	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	42,267	4,381,819.89	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	77,849	4,073,059.68	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	52,314	1,242,457.50	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	64,997	159,892.62	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	155,102	7,142,447.10	
GETTY REALTY CORP	27,482	763,449.96	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	24,371	325,109.14	
GLADSTONE LAND CORP	18,797	262,594.09	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	36,267	372,462.09	
GLOBAL NET LEASE INC	115,380	1,026,882.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	227,647	3,767,557.85	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	316,762	6,132,512.32	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	63,623	1,433,426.19	
HOST HOTELS & RESORTS INC	408,175	7,987,984.75	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	78,151	687,728.80	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	130,032	1,976,486.40	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	36,445	150,882.30	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	17,158	1,606,675.12	

INVENTRUST PROPERTIES CORP	39,857	1,028,709.17	
INVITATION HOMES INC	333,726	11,099,726.76	
IRON MOUNTAIN INC	169,544	11,601,895.92	
JBG SMITH PROPERTIES	51,300	859,275.00	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	477,700	157,641.00	
KILROY REALTY CORP	62,598	2,435,688.18	
KIMCO REALTY CORP	384,072	8,015,582.64	
KITE REALTY GROUP TRUST	125,382	2,744,611.98	
LTC PROPERTIES INC	24,391	776,609.44	
LXP INDUSTRIAL TRUST	174,052	1,636,088.80	
MACERICH CO/THE	121,861	2,026,548.43	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	1,011,020	65,716.30	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	365,098	1,244,984.18	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	67,585	8,919,868.30	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	44,841	1,738,485.57	
NATL HEALTH INVESTORS INC	24,630	1,330,758.90	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	8,717	217,401.98	
NETSTREIT CORP	39,142	720,604.22	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	16,397	114,287.09	
NEXPOINT RESIDENTIAL	13,180	426,109.40	
NNN REIT INC	105,455	4,361,618.80	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	30,313	112,461.23	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	141,919	4,102,878.29	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	9,253	196,348.66	
ORION OFFICE REIT INC	36,842	198,209.96	
PARAMOUNT GROUP INC	102,100	514,584.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	123,544	1,918,638.32	
PEAKSTONE REALTY TRUST	21,921	352,708.89	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	74,248	1,159,753.76	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	69,835	2,497,997.95	
PHYSICIANS REALTY TRUST	140,351	1,802,106.84	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	73,777	544,474.26	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	20,594	470,984.78	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	11,862	171,880.38	
PRIME US REIT	348,400	65,150.80	
PROLOGIS INC	537,478	67,829,723.60	

		PUBLIC STORAGE	92,010	26,837,476.80	
		REALTY INCOME CORP	482,968	26,766,086.56	
		REGENCY CENTERS CORP	95,124	6,085,082.28	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	72,391	1,020,713.10	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	122,123	6,571,438.63	
		RLJ LODGING TRUST	95,326	1,124,846.80	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	35,313	3,884,783.13	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	131,793	1,742,303.46	
		SAFEHOLD INC	27,619	567,570.45	
		SAUL CENTERS INC	8,150	326,326.00	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	100,591	785,615.71	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	189,649	27,087,566.67	
		SITE CENTERS CORP	107,265	1,485,620.25	
		SL GREEN REALTY CORP	36,506	1,714,686.82	
		STAG INDUSTRIAL INC	104,417	3,946,962.60	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	61,291	412,488.43	
		SUN COMMUNITIES INC	72,217	9,017,014.62	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	113,652	1,209,257.28	
		TANGER INC	62,667	1,750,289.31	
		TERRENO REALTY CORP	49,857	3,003,385.68	
		UDR INC	174,913	6,389,571.89	
		UMH PROPERTIES INC	35,545	550,947.50	
		UNITI GROUP INC	146,642	802,131.74	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,436	314,096.64	
		URBAN EDGE PROPERTIES	69,540	1,237,812.00	
		VENTAS INC	233,648	11,084,261.12	
		VERIS RESIDENTIAL INC	47,834	742,383.68	
		VICI PROPERTIES INC	601,464	18,356,681.28	
		VORNADO REALTY TRUST	93,353	2,671,762.86	
		WELLTOWER INC	322,009	28,085,624.98	
		WHITESTONE REIT	27,990	357,152.40	
		WP CAREY INC	126,967	8,058,595.49	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	64,037	868,341.72	
		アメリカドル合計	15,539,109	604,021,220.78 (89,213,934,309)	
カナダ	投資証券	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	36,000	744,120.00	

ル		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	36,990	249,682.50	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	13,410	940,309.20	
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	13,300	210,007.00	
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	52,400	164,012.00	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	48,780	2,277,050.40	
		CHOICE PROPERTIES REIT	92,687	1,308,740.44	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	30,230	417,476.30	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	29,700	436,887.00	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	79,000	1,068,870.00	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	12,310	135,779.30	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	64,500	979,755.00	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	18,200	1,342,796.00	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	74,409	742,601.82	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	41,700	552,942.00	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	34,500	638,940.00	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	12,300	201,597.00	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	10,800	165,456.00	
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	14,500	119,770.00	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	66,500	334,495.00	
		PRIMARIS REIT	31,077	431,970.30	
		PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	13,000	72,800.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	76,170	1,397,719.50	
		SLATE GROCERY REIT-CL U	20,200	256,944.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	41,700	1,022,484.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5,182	48,399.88		
カナダドル合計			969,545	16,261,604.64 (1,782,271,868)	
オーストラリアドル	投資証券	ABACUS GROUP	258,313	272,520.21	
		ABACUS STORAGE KING	349,661	379,382.18	
		ARENA REIT	193,872	684,368.16	
		BWP TRUST	286,513	971,279.07	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	502,926	809,710.86	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	327,007	1,039,882.26	
		CENTURIA OFFICE REIT	223,021	284,351.77	
		CHARTER HALL GROUP	270,715	3,080,736.70	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	398,836	1,423,844.52	

		CHARTER HALL RETAIL REIT	320,766	1,145,134.62	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	195,853	526,844.57	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	821,364	320,331.96	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	114,607	311,731.04	
		DEXUS/AU	623,225	4,599,400.50	
		GDI PROPERTY GROUP	148,753	97,433.21	
		GOODMAN GROUP	1,004,916	25,042,506.72	
		GPT GROUP	1,092,975	4,820,019.75	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	156,679	358,794.91	
		HEALTHCO REIT	303,509	391,526.61	
		HMC CAPITAL LTD	151,349	885,391.65	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	1,044,796	1,232,859.28	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	115,529	332,723.52	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	236,027	1,014,916.10	
		MIRVAC GROUP	2,346,665	4,904,529.85	
		NATIONAL STORAGE REIT	744,264	1,644,823.44	
		REGION RE LTD	703,188	1,539,981.72	
		RURAL FUNDS GROUP	228,339	465,811.56	
		SCENTRE GROUP	2,989,451	8,669,407.90	
		STOCKLAND	1,373,704	5,948,138.32	
		VICINITY CENTRES	2,220,258	4,329,503.10	
		WAYPOINT REIT	384,457	915,007.66	
		オーストラリアドル合計	20,131,538	78,442,893.72 (7,627,002,556)	
イギリス ポンド	投資証券	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	189,691	102,433.14	
		AEW UK REIT PLC	118,804	114,527.05	
		ASSURA PLC	1,769,948	795,768.62	
		BALANCED COMM PROPERTY TRUST	417,405	308,879.70	
		BIG YELLOW GROUP PLC	112,854	1,253,807.94	
		BRITISH LAND CO PLC	533,482	1,985,086.52	
		CLS HOLDINGS PLC	90,000	85,680.00	
		CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	291,411	207,193.22	
		DERWENT LONDON PLC	63,419	1,320,383.58	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	372,068	343,046.69	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	155,948	636,891.63	
		HAMMERSON PLC	2,333,062	617,794.81	

		HELICAL PLC	60,734	126,326.72	
		HOME REIT PLC	398,800	151,743.40	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	246,077	213,348.75	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	440,897	2,883,466.38	
		LIFE SCIENCE REIT PLC	209,200	125,520.00	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	623,621	1,164,300.40	
		LXI REIT PLC	989,382	1,014,116.55	
		NEWRIVER REIT PLC	188,335	146,336.29	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	360,527	236,505.71	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	742,515	712,443.14	
		PRS REIT PLC/THE	310,645	266,222.76	
		REGIONAL REIT LTD	125,644	37,441.91	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	121,233	988,655.11	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	308,300	140,276.50	
		SEGRO PLC	711,005	6,052,074.56	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	1,105,659	1,439,568.01	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	754,928	604,697.32	
		TARGET HEALTHCARE REIT PLC	371,700	310,741.20	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	175,846	109,903.75	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,083,502	1,734,686.70	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	464,477	287,511.26	
		UNITE GROUP PLC/THE	231,814	2,306,549.30	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	260,093	319,394.20	
		WAREHOUSE REIT PLC	260,780	219,576.76	
		WORKSPACE GROUP PLC	72,738	377,510.22	
イギリスポンド合計			17,066,544	29,740,409.80 (5,579,895,686)	
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	1,129,000	2,167,680.00	
		FORTUNE REIT	855,000	3,890,250.00	
		LINK REIT	1,487,500	58,310,000.00	
		PROSPERITY REIT	760,000	995,600.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	635,000	1,244,600.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	1,304,000	1,434,400.00	
香港ドル合計			6,170,500	68,042,530.00 (1,285,323,391)	
シンガポ	投資証券	AIMS APAC REIT	411,000	538,410.00	

ールドル		CAPITALAND ASCENDAS REIT	2,052,000	5,971,320.00	
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,381,074	1,291,304.19	
		CAPITALAND CHINA TRUST	703,900	577,198.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	2,909,132	5,701,898.72	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	427,700	436,254.00	
		EC WORLD REIT	199,400	55,832.00	
		ESR-LOGOS REIT	3,783,668	1,172,937.08	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	677,200	430,022.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	653,900	1,490,892.00	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERC	1,768,966	1,945,862.60	
		KEPPEL DC REIT	758,200	1,364,760.00	
		KEPPEL REIT	1,267,700	1,159,945.50	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	1,007,000	619,305.00	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,217,200	2,969,968.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,896,000	2,957,760.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	1,393,200	1,992,276.00	
		PARAGON REIT	719,700	615,343.50	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	234,000	835,380.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	272,500	182,575.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	704,300	355,671.50	
	SUNTEC REIT	1,267,600	1,533,796.00		
シンガポールドル合計			25,705,340	34,198,711.09	(3,767,672,000)
ニュージーランドドル	投資証券	ARGOSY PROPERTY LTD	451,499	528,253.83	
		GOODMAN PROPERTY TRUST	596,091	1,335,243.84	
		KIWI PROPERTY GROUP LTD	876,670	753,936.20	
		PRECINCT PROPERTIES GROUP	831,046	1,030,497.04	
ニュージーランドドル合計			2,755,306	3,647,930.91	(329,043,368)
韓国ウォン	投資証券	D&D PLATFORM REIT CO LTD	42,272	135,270,400.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	96,143	351,402,665.00	
		JR REIT XXVII	87,237	352,873,665.00	
		KORAMCO LIFE INFRA REIT	18,324	92,169,720.00	
		LOTTE REIT CO LTD	80,098	242,296,450.00	
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	32,547	106,591,425.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	44,672	291,708,160.00	

		SK REITS CO LTD	62,600	235,689,000.00
韓国ウォン合計			463,893	1,808,001,485.00 (199,964,964)
イスラエル シエケ ル	投資証券	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	406,762	716,307.88
		REIT 1 LTD	109,796	1,824,809.52
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	113,370	905,259.45
イスラエルシエケル合計			629,928	3,446,376.85 (137,354,660)
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	28,472	1,661,341.20
		ALTAREA	2,731	219,572.40
		CARE PROPERTY INVEST	16,132	206,812.24
		CARMILA	31,800	517,704.00
		COFINIMMO	21,277	1,414,920.50
		COVIVIO	27,358	1,237,675.92
		CROMWELL REIT EUR	199,500	281,295.00
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	24,838	524,081.80
		GECINA SA	30,773	3,194,237.40
		HAMBORNER REIT AG	43,259	287,672.35
		ICADE	18,221	601,657.42
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	22,501	50,064.72
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	170,569	978,213.21
		INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	17,880	372,798.00
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	229,201	271,832.38
		KLEPIERRE	116,653	2,757,676.92
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	32,964	207,673.20
		MERCIALYS	54,648	598,942.08
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	194,326	1,834,437.44
		MONTEA NV	9,378	755,866.80
		NSI NV	12,706	251,578.80
		RETAIL ESTATES	6,890	420,290.00
		SHURGARD SELF STORAGE LTD	19,000	816,525.00
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	58,209	3,916,301.52
VASTNED RETAIL NV	6,082	125,289.20		
WAREHOUSES DE PAUW SCA	100,885	2,661,346.30		
WERELDHAVE NV	24,111	337,554.00		
XIOR STUDENT HOUSING NV	16,907	472,550.65		

ユーロ合計	1,537,271	26,975,910.45 (4,320,731,576)	
合計		114,243,194,378 (114,243,194,378)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入投資証券 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	投資証券 139 銘柄	100.00%	78.09%
カナダドル	投資証券 26 銘柄	100.00%	1.56%
オーストラリアドル	投資証券 31 銘柄	100.00%	6.68%
イギリスポンド	投資証券 37 銘柄	100.00%	4.88%
香港ドル	投資証券 6 銘柄	100.00%	1.13%
シンガポールドル	投資証券 22 銘柄	100.00%	3.30%
ニュージーランドドル	投資証券 4 銘柄	100.00%	0.29%
韓国ウォン	投資証券 8 銘柄	100.00%	0.18%
イスラエルシェケル	投資証券 3 銘柄	100.00%	0.12%
ユーロ	投資証券 28 銘柄	100.00%	3.78%

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】

- 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。
- 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1月27日から2024年7月26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10月2日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwC Japan 有限責任監査法人

東京事務所
指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員

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eMAXIS最適化バランス（マイゴールキーパー）の2024年1月27日から2024年7月26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、eMAXIS最適化バランス（マイゴールキーパー）の2024年7月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年1月27日から2024年7月26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。

【eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第 8 期 [2024 年 1 月 26 日現在]	第 9 期中間計算期間末 [2024 年 7 月 26 日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	65,368,130	74,189,659
親投資信託受益証券	4,835,642,260	5,583,599,223
未収入金	7,326,721	2,425,498
未収利息	-	133
流動資産合計	4,908,337,111	5,660,214,513
資産合計	4,908,337,111	5,660,214,513
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,626,275	5,089,586
未払受託者報酬	1,583,469	1,745,104
未払委託者報酬	11,612,033	12,797,292
未払利息	16	-
その他未払費用	94,942	104,648
流動負債合計	23,916,735	19,736,630
負債合計	23,916,735	19,736,630
純資産の部		
元本等		
元本	3,952,438,503	4,452,569,944
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	931,981,873	1,187,907,939
(分配準備積立金)	347,272,170	316,032,341
元本等合計	4,884,420,376	5,640,477,883
純資産合計	4,884,420,376	5,640,477,883
負債純資産合計	4,908,337,111	5,660,214,513

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 8 期中間計算期間 自 2023 年 1 月 27 日 至 2023 年 7 月 26 日	第 9 期中間計算期間 自 2024 年 1 月 27 日 至 2024 年 7 月 26 日
営業収益		
受取利息	204	15,786
有価証券売買等損益	306,164,462	137,278,972
営業収益合計	306,164,666	137,294,758
営業費用		
支払利息	11,610	418
受託者報酬	1,445,874	1,745,104
委託者報酬	10,603,029	12,797,292

その他費用	86,689	104,648
営業費用合計	12,147,202	14,647,462
営業利益又は営業損失(△)	294,017,464	122,647,296
経常利益又は経常損失(△)	294,017,464	122,647,296
中間純利益又は中間純損失(△)	294,017,464	122,647,296
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(△)	18,734,041	11,056,656
期首剰余金又は期首欠損金(△)	485,265,722	931,981,873
剰余金増加額又は欠損金減少額	105,906,832	238,072,419
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	105,906,832	238,072,419
剰余金減少額又は欠損金増加額	61,897,574	93,736,993
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	61,897,574	93,736,993
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	804,558,403	1,187,907,939

(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8期 [2024年1月26日現在]	第9期中間計算期間末 [2024年7月26日現在]
1. 期首元本額	3,664,571,956円	3,952,438,503円
期中追加設定元本額	1,287,202,647円	894,190,897円
期中一部解約元本額	999,336,100円	394,059,456円
2. 受益権の総数	3,952,438,503口	4,452,569,944口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期中間計算期間 自2023年1月27日 至2023年7月26日	第9期中間計算期間 自2024年1月27日 至2024年7月26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8期 [2024年1月26日現在]	第9期中間計算期間末 [2024年7月26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	(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	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。	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8期 [2024年1月26日現在]	第9期中間計算期間末 [2024年7月26日現在]
1口当たり純資産額	1,2358円	1,2668円
(1万口当たり純資産額)	(12,358円)	(12,668円)

独立監査人の中間監査報告書

2024年10月2日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwC Japan 有限責任監査法人

東京事務所
指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員

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eMAXIS最適化バランス（マイディフェンダー）の2024年1月27日から2024年7月26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、eMAXIS最適化バランス（マイディフェンダー）の2024年7月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年1月27日から2024年7月26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。

【eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第 8 期 [2024 年 1 月 26 日現在]	第 9 期中間計算期間末 [2024 年 7 月 26 日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	64,458,238	65,061,571
親投資信託受益証券	3,989,981,441	4,603,823,617
未収入金	2,752,245	350,916
未収利息	-	117
流動資産合計	4,057,191,924	4,669,236,221
資産合計	4,057,191,924	4,669,236,221
負債の部		
流動負債		
未払解約金	16,213,892	6,219,426
未払受託者報酬	1,281,534	1,444,876
未払委託者報酬	9,397,859	10,595,668
未払利息	16	-
その他未払費用	76,829	86,631
流動負債合計	26,970,130	18,346,601
負債合計	26,970,130	18,346,601
純資産の部		
元本等		
元本	2,793,595,429	3,080,186,319
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,236,626,365	1,570,703,301
（分配準備積立金）	514,777,623	475,490,063
元本等合計	4,030,221,794	4,650,889,620
純資産合計	4,030,221,794	4,650,889,620
負債純資産合計	4,057,191,924	4,669,236,221

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 8 期中間計算期間 自 2023 年 1 月 27 日 至 2023 年 7 月 26 日	第 9 期中間計算期間 自 2024 年 1 月 27 日 至 2024 年 7 月 26 日
営業収益		
受取利息	147	13,295
有価証券売買等損益	309,165,359	200,611,389
営業収益合計	309,165,506	200,624,684
営業費用		
支払利息	9,130	369
受託者報酬	1,090,982	1,444,876
委託者報酬	8,000,450	10,595,668

その他費用	65,393	86,631
営業費用合計	9,165,955	12,127,544
営業利益又は営業損失(△)	299,999,551	188,497,140
経常利益又は経常損失(△)	299,999,551	188,497,140
中間純利益又は中間純損失(△)	299,999,551	188,497,140
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(△)	10,780,020	11,787,055
期首剰余金又は期首欠損金(△)	668,284,347	1,236,626,365
剰余金増加額又は欠損金減少額	149,058,682	260,463,855
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	149,058,682	260,463,855
剰余金減少額又は欠損金増加額	62,774,360	103,097,004
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	62,774,360	103,097,004
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	1,043,788,200	1,570,703,301

(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8期 [2024年1月26日現在]	第9期中間計算期間末 [2024年7月26日現在]
1. 期首元本額	2,426,160,228円	2,793,595,429円
期中追加設定元本額	862,948,815円	518,160,912円
期中一部解約元本額	495,513,614円	231,570,022円
2. 受益権の総数	2,793,595,429口	3,080,186,319口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期中間計算期間 自2023年1月27日 至2023年7月26日	第9期中間計算期間 自2024年1月27日 至2024年7月26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8期 [2024年1月26日現在]	第9期中間計算期間末 [2024年7月26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	(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>等) は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	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8期 [2024年1月26日現在]	第9期中間計算期間末 [2024年7月26日現在]
1口当たり純資産額	1,4427円	1,5099円
(1万口当たり純資産額)	(14,427円)	(15,099円)

独立監査人の中間監査報告書

2024年10月2日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwC Japan 有限責任監査法人

東京事務所
指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員

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eMAXIS最適化バランス（マイミッドフィルダー）の2024年1月27日から2024年7月26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、eMAXIS最適化バランス（マイミッドフィルダー）の2024年7月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年1月27日から2024年7月26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。

【eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第 8 期 [2024 年 1 月 26 日現在]	第 9 期中間計算期間末 [2024 年 7 月 26 日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	184,228,395	205,839,789
親投資信託受益証券	11,894,803,890	14,346,142,043
未収入金	11,255,749	-
未収利息	-	371
流動資産合計	12,090,288,034	14,551,982,203
資産合計	12,090,288,034	14,551,982,203
負債の部		
流動負債		
未払解約金	44,122,583	21,006,760
未払受託者報酬	3,745,613	4,435,525
未払委託者報酬	27,467,771	32,527,097
未払利息	47	-
その他未払費用	224,677	266,066
流動負債合計	75,560,691	58,235,448
負債合計	75,560,691	58,235,448
純資産の部		
元本等		
元本	7,293,300,360	8,235,601,646
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	4,721,426,983	6,258,145,109
(分配準備積立金)	2,084,981,198	1,933,980,027
元本等合計	12,014,727,343	14,493,746,755
純資産合計	12,014,727,343	14,493,746,755
負債純資産合計	12,090,288,034	14,551,982,203

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 8 期中間計算期間 自 2023 年 1 月 27 日 至 2023 年 7 月 26 日	第 9 期中間計算期間 自 2024 年 1 月 27 日 至 2024 年 7 月 26 日
営業収益		
受取利息	442	41,844
有価証券売買等損益	1,092,932,111	869,328,497
営業収益合計	1,092,932,553	869,370,341
営業費用		
支払利息	26,400	1,153
受託者報酬	3,145,261	4,435,525
委託者報酬	23,065,175	32,527,097

その他費用	188,655	266,066
営業費用合計	26,425,491	37,229,841
営業利益又は営業損失(△)	1,066,507,062	832,140,500
経常利益又は経常損失(△)	1,066,507,062	832,140,500
中間純利益又は中間純損失(△)	1,066,507,062	832,140,500
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(△)	34,039,187	48,142,935
期首剰余金又は期首欠損金(△)	2,584,950,524	4,721,426,983
剰余金増加額又は欠損金減少額	490,874,953	1,131,454,499
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	490,874,953	1,131,454,499
剰余金減少額又は欠損金増加額	215,777,705	378,733,938
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	215,777,705	378,733,938
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	3,892,515,647	6,258,145,109

(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8期 [2024年1月26日現在]	第9期中間計算期間末 [2024年7月26日現在]
1. 期首元本額	6,250,452,127円	7,293,300,360円
期中追加設定元本額	2,219,666,001円	1,522,899,730円
期中一部解約元本額	1,176,817,768円	580,598,444円
2. 受益権の総数	7,293,300,360口	8,235,601,646口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期中間計算期間 自2023年1月27日 至2023年7月26日	第9期中間計算期間 自2024年1月27日 至2024年7月26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8期 [2024年1月26日現在]	第9期中間計算期間末 [2024年7月26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	(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	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。	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8期 [2024年1月26日現在]	第9期中間計算期間末 [2024年7月26日現在]
1口当たり純資産額	1,6474円	1,7599円
(1万口当たり純資産額)	(16,474円)	(17,599円)

独立監査人の中間監査報告書

2024年10月2日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwC Japan 有限責任監査法人

東京事務所
指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員

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eMAXIS最適化バランス（マイフォワード）の2024年1月27日から2024年7月26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、eMAXIS最適化バランス（マイフォワード）の2024年7月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年1月27日から2024年7月26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。

【eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第 8 期 [2024 年 1 月 26 日現在]	第 9 期中間計算期間末 [2024 年 7 月 26 日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	126,743,348	135,530,927
親投資信託受益証券	7,575,621,574	9,323,033,721
未収入金	63,432	-
未収利息	-	244
流動資産合計	7,702,428,354	9,458,564,892
資産合計	7,702,428,354	9,458,564,892
負債の部		
流動負債		
未払解約金	30,943,812	14,848,949
未払受託者報酬	2,321,251	2,873,415
未払委託者報酬	17,022,445	21,071,685
未払利息	32	-
その他未払費用	139,211	172,345
流動負債合計	50,426,751	38,966,394
負債合計	50,426,751	38,966,394
純資産の部		
元本等		
元本	3,937,514,952	4,423,148,691
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	3,714,486,651	4,996,449,807
(分配準備積立金)	1,654,547,478	1,533,253,823
元本等合計	7,652,001,603	9,419,598,498
純資産合計	7,652,001,603	9,419,598,498
負債純資産合計	7,702,428,354	9,458,564,892

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 8 期中間計算期間 自 2023 年 1 月 27 日 至 2023 年 7 月 26 日	第 9 期中間計算期間 自 2024 年 1 月 27 日 至 2024 年 7 月 26 日
営業収益		
受取利息	281	27,684
有価証券売買等損益	833,005,705	771,129,843
営業収益合計	833,005,986	771,157,527
営業費用		
支払利息	17,154	759
受託者報酬	1,929,846	2,873,415
委託者報酬	14,152,128	21,071,685

その他費用	115,730	172,345
営業費用合計	16,214,858	24,118,204
営業利益又は営業損失(△)	816,791,128	747,039,323
経常利益又は経常損失(△)	816,791,128	747,039,323
中間純利益又は中間純損失(△)	816,791,128	747,039,323
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(△)	33,998,854	40,982,141
期首剰余金又は期首欠損金(△)	2,020,887,202	3,714,486,651
剰余金増加額又は欠損金減少額	381,737,656	876,102,652
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	381,737,656	876,102,652
剰余金減少額又は欠損金増加額	218,602,027	300,196,678
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	218,602,027	300,196,678
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	2,966,815,105	4,996,449,807

(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8期 [2024年1月26日現在]	第9期中間計算期間末 [2024年7月26日現在]
1. 期首元本額	3,413,012,304円	3,937,514,952円
期中追加設定元本額	1,299,340,431円	801,669,536円
期中一部解約元本額	774,837,783円	316,035,797円
2. 受益権の総数	3,937,514,952口	4,423,148,691口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期中間計算期間 自2023年1月27日 至2023年7月26日	第9期中間計算期間 自2024年1月27日 至2024年7月26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8期 [2024年1月26日現在]	第9期中間計算期間末 [2024年7月26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	(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	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。	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8期 [2024年1月26日現在]	第9期中間計算期間末 [2024年7月26日現在]
1口当たり純資産額	1,9434円	2,1296円
(1万口当たり純資産額)	(19,434円)	(21,296円)

独立監査人の中間監査報告書

2024年10月2日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwC Japan 有限責任監査法人

東京事務所
指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員

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eMAXIS最適化バランス（マイストライカー）の2024年1月27日から2024年7月26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、eMAXIS最適化バランス（マイストライカー）の2024年7月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年1月27日から2024年7月26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。

【eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第 8 期 [2024 年 1 月 26 日現在]	第 9 期中間計算期間末 [2024 年 7 月 26 日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	208,946,726	234,480,000
親投資信託受益証券	12,142,185,589	16,031,981,492
未収入金	51,932	108,588,698
未収利息	-	423
流動資産合計	12,351,184,247	16,375,050,613
資産合計	12,351,184,247	16,375,050,613
負債の部		
流動負債		
未払解約金	56,261,290	135,928,775
未払受託者報酬	3,670,687	4,831,608
未払委託者報酬	26,918,313	35,431,759
未払利息	53	-
その他未払費用	220,180	289,832
流動負債合計	87,070,523	176,481,974
負債合計	87,070,523	176,481,974
純資産の部		
元本等		
元本	5,643,614,820	6,649,437,018
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	6,620,498,904	9,549,131,621
(分配準備積立金)	2,720,261,092	2,475,062,623
元本等合計	12,264,113,724	16,198,568,639
純資産合計	12,264,113,724	16,198,568,639
負債純資産合計	12,351,184,247	16,375,050,613

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 8 期中間計算期間 自 2023 年 1 月 27 日 至 2023 年 7 月 26 日	第 9 期中間計算期間 自 2024 年 1 月 27 日 至 2024 年 7 月 26 日
営業収益		
受取利息	496	48,262
有価証券売買等損益	1,404,889,137	1,563,050,954
営業収益合計	1,404,889,633	1,563,099,216
営業費用		
支払利息	26,575	1,291
受託者報酬	2,979,524	4,831,608
委託者報酬	21,849,765	35,431,759

その他費用	178,711	289,832
営業費用合計	25,034,575	40,554,490
営業利益又は営業損失(△)	1,379,855,058	1,522,544,726
経常利益又は経常損失(△)	1,379,855,058	1,522,544,726
中間純利益又は中間純損失(△)	1,379,855,058	1,522,544,726
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(△)	58,512,711	113,275,427
期首剰余金又は期首欠損金(△)	3,571,739,234	6,620,498,904
剰余金増加額又は欠損金減少額	759,544,380	2,210,602,977
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	759,544,380	2,210,602,977
剰余金減少額又は欠損金増加額	422,253,427	691,239,559
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	422,253,427	691,239,559
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	5,230,372,534	9,549,131,621

(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8期 [2024年1月26日現在]	第9期中間計算期間末 [2024年7月26日現在]
1. 期首元本額	4,760,733,943円	5,643,614,820円
期中追加設定元本額	2,077,699,068円	1,586,649,700円
期中一部解約元本額	1,194,818,191円	580,827,502円
2. 受益権の総数	5,643,614,820口	6,649,437,018口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期中間計算期間 自2023年1月27日 至2023年7月26日	第9期中間計算期間 自2024年1月27日 至2024年7月26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8期 [2024年1月26日現在]	第9期中間計算期間末 [2024年7月26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	(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	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。	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8期 [2024年1月26日現在]	第9期中間計算期間末 [2024年7月26日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,1731円 (21,731円)	2,4361円 (24,361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7月26日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	38,576,069,392
株式	1,469,855,967,560
派生商品評価勘定	14,298,700
未収入金	16,883,038,503
未収配当金	1,792,043,787
未収利息	69,669
前払金	975,538,000
その他未収収益	10,581,780
差入委託証拠金	872,315,080
流動資産合計	1,528,979,922,471
資産合計	1,528,979,922,471
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	989,414,950

未払解約金	5,924,811,003
未払利息	650,619
受入担保金	19,414,577,222
流動負債合計	26,329,453,794
負債合計	26,329,453,794
純資産の部	
元本等	
元本	453,266,096,216
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	1,049,384,372,461
元本等合計	1,502,650,468,677
純資産合計	1,502,650,468,677
負債純資産合計	1,528,979,922,471

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7月26日現在]
1. 期首	2024年1月27日
期首元本額	417,817,127,461円
期中追加設定元本額	111,359,486,723円
期中一部解約元本額	75,910,517,968円
元本の内訳※	
三菱UFJ トピックスインデックスオープン	6,469,545,180円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	742,353,184円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	3,639,373,600円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	3,836,478,940円
三菱UFJ トピックスオープン(確定拠出年金)	3,720,573,583円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	5,459,130,148円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	32,639,817,546円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	42,015,419,604円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	81,101,644円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	228,254,039円
ファンド・マネジャー(国内株式)	408,834,236円
eMAXIS TOPIXインデックス	7,880,344,623円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,922,273,570円
eMAXIS バランス(波乗り型)	124,283,671円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	2,755,781,597円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	799,047,877円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	1,107,448,258円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	1,109,603,438円
eMAXIS Slim 国内株式(TOPIX)	59,779,378,917円
国内株式セレクション(ラップ向け)	5,844,794,677円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	10,547,129,163円

つみたて日本株式 (TOPIX)	11,232,643,913 円
つみたて8資産均等バランス	5,314,838,146 円
つみたて4資産均等バランス	2,022,819,268 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	3,132,725 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	5,217,272 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	10,012,565 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	695,433,087 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	949,169,980 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	692,548,758 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	506,116,544 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	1,767,327,215 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	4,513,620,058 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	1,657,555,434 円
三菱UFJ DC年金インデックス (国内株式)	5,237,073,530 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	652,759,109 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	148,986,391 円
国内株式インデックス・オープン (ラップ向け)	21,903,306,326 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	320,280,034 円
ラップ向けインデックスf 国内株式	4,052,059,212 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	150,798,956 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	4,013,855,895 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	2,604,317,127 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	65,796,298 円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	2,732,444,058 円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	83,342,762 円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	23,146,436 円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	35,666,650 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	5,539,793 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	3,146,634 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	63,520,015 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	945,778,964 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	2,192,935,488 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	224,866,398 円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	1,417,137,340 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	255,396,951 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	16,790,705 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	129,340,605 円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	823,813,511 円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	146,834,614 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	189,359,823 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	808,792,462 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	670,813,962 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	1,262,147,703 円
三菱UFJ トピックスオープン	915,791,064 円
三菱UFJ DCトピックスオープン	8,005,353,047 円
三菱UFJ トピックスオープンVA (適格機関投資家限定)	40,848,655 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	3,627,081,712 円

家限定)		
三菱UFJ	バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	6,960,877円
三菱UFJ	バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,304,361,206円
三菱UFJ	バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	53,479,491円
三菱UFJ	バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,102,555,662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)	57,127,835,429円
三菱UFJ	バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	171,620,475円
三菱UFJ	バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	201,843円
三菱UFJ	バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	117,599円
三菱UFJ	バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	173,412,640円
三菱UFJ	バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	304,610,774円
MUAM	インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)	4,024,519,267円
MUKAM	バランス・イノベーション (株式抑制型) (適格機関投資家転売制限付)	3,075,021,951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)	933,126,492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)	334,372,701円
	世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	90,555,885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)	2,579,289,802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)	140,884,285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)	3,773,536,391円
MUKAM	スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	236,842,446円
MUKAM	下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド (適格機関投資家限定)	4,355,108,795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)	28,584,727円
	マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	269,377円
	日米コアバランス (FOFs用) (適格機関投資家限定)	74,756,404円
	日本株式インデックスファンドS	4,114,154,444円
	グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定)	4,767,431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2021-01 (適格機関投資家限定)	34,742,713円
MUKAM	アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	34,935,203円
MUKAM	アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	35,058,940円
MUKAM	日米コアバランス 2021-07 (適格機関投資家限定)	200,861,027円
MUKAM	アセットアロケーションファンド2021-07 (適	34,450,377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2021-09 (適格機関投資家限定)	34,305,177円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	34,874,281円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	35,762,664円
MUKAM 日米コアバランス (除く米国株) 2022-03 (適格機関投資家限定)	372,299,051円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	37,565,083円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	38,774,804円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	39,792,135円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	39,241,585円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	39,102,095円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	39,096,327円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)	39,100,255円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定)	39,088,327円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	5,463,020,035円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	2,442,916円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	5,958,788円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	1,400,790円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	5,411,622円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	437,782,436円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	61,977,288円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	2,743,591円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	23,896,120円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	1,316,306円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	13,954,272円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,575,274,528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)	288,220,084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)	1,261,437,625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)	1,226,031,660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)	1,203,234,891円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	60,318,628,075円
合計	453,266,096,216円
2. 貸付有価証券 貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っております。 株式	18,106,712,280円
3. 受益権の総数	453,266,096,216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7月26日現在]
----	----------------

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 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7月26日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	20,283,298,000	—	19,308,575,000	△974,723,000
合計		20,283,298,000	—	19,308,575,000	△974,723,000

(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7月26日現在]
1口当たり純資産額	3.3152円
(1万口当たり純資産額)	(33,152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7月26日現在]

資産の部

流動資産

預金

43,899,715,992

コール・ローン	862,322,643
株式	5,760,642,070,763
投資証券	111,186,711,986
派生商品評価勘定	137,625,067
未収入金	23,755,056
未収配当金	3,520,566,206
未収利息	1,557
差入委託証拠金	107,039,102,239
流動資産合計	6,027,311,871,509
資産合計	6,027,311,871,509
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,057,599,280
未払解約金	3,693,972,420
流動負債合計	7,751,571,700
負債合計	7,751,571,700
純資産の部	
元本等	
元本	841,155,258,516
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	5,178,405,041,293
元本等合計	6,019,560,299,809
純資産合計	6,019,560,299,809
負債純資産合計	6,027,311,871,509

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7月26日現在]
1. 期首	2024年1月27日
期首元本額	660,378,109,832円
期中追加設定元本額	212,088,946,453円
期中一部解約元本額	31,311,797,769円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	159,709,870円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	857,118,389円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	876,967,097円
MAXIS 海外株式(MSCIコクサイ)上場投信	3,121,627,877円
MAXIS 全世界株式(オール・カントリー)上場投信	6,431,622,422円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,174,470,248円

三菱UFJ プライムバランス (安定成長型) (確定拠出年金)	7,687,066,999 円
三菱UFJ プライムバランス (成長型) (確定拠出年金)	9,604,115,328 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)	37,480,985 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型)	106,371,926 円
ファンド・マネジャー (海外株式)	776,741 円
eMAXIS 先進国株式インデックス	14,207,375,154 円
eMAXIS バランス (8資産均等型)	901,465,305 円
eMAXIS バランス (波乗り型)	147,437,104 円
三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	1,574,834,120 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	185,210,807 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	268,397,482 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	251,759,108 円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	107,253,072,526 円
海外株式セレクション (ラップ向け)	2,031,905,184 円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	4,948,246,986 円
つみたて先進国株式	36,983,806,824 円
つみたて8資産均等バランス	2,480,394,359 円
つみたて4資産均等バランス	942,179,940 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,878,700 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,339,544 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	7,571,514 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	161,413,145 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	221,288,020 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	157,837,130 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	57,845,394 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	484,784,588 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	1,466,172,459 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本)	65,423,215,056 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	775,334,515 円
三菱UFJ DC年金インデックス (先進国株式)	5,067,319,198 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カントリー)	453,270,313,831 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	154,965,599 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	38,312,113 円
つみたて全世界株式	3,930,788,129 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	76,246,298 円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	2,492,627,633 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	66,176,807 円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	2,198,617,761 円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	67,411,446 円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	4,289,873 円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	6,631,342 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	1,316,173 円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	34,212,054,018 円
eMAXIS 全世界株式インデックス	7,057,314,867 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	443,065,236 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	1,019,077,020 円

三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	166,931,269円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	670,705,945円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	116,694,125円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	384,217,003円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	75,973,449円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	113,497,395円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	514,570,451円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	442,253,309円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	946,985,346円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA (適格機関投資家限定)	1,045,880,790円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	3,975,653円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	2,546,400,579円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	24,911,379円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	515,538,516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)	8,286,379,968円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	53,811円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	404,996,946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)	4,159,135,599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)	1,447,849,566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)	439,880,202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)	108,569,803円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	51,749,371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)	1,419,865,475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)	65,573,408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)	2,569,983,634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)	77,065,196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)	6,728,825,608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)	13,460,605円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	199,817円
海外株式インデックスファンドS	9,940,180,533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)	314,710,363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)	169,242,050円
グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定)	1,972,885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)	57,634,025円
MUAM グローバルバランス (退職給付信託向け) (適格機関投資家限定)	4,776,531,798円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,985,320,662円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	569,114円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	1,387,441円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	372,582円

インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	1,567,352円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	19,911,252円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	631,740円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	5,523,319円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	611,354円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	6,482,956円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	7,345,576,554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）	67,146,637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）	292,294,014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）	325,339,441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）	349,194,495円
合計	841,155,258,516円
2. 受益権の総数	841,155,258,516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7月26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。
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つた場合、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7月26日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	151,428,541,286	—	147,523,239,944	△3,905,301,342
合計		151,428,541,286	—	147,523,239,944	△3,905,301,342

（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7月26日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカドル	2,220,431,488	—	2,231,869,547	△11,438,059
	カナダドル	88,105,416	—	88,513,849	△408,433
	オーストラリアドル	65,053,262	—	65,244,968	△191,706
	イギリスポンド	105,162,568	—	105,370,473	△207,905
	スイスフラン	79,537,815	—	80,238,983	△701,168
	スウェーデンクローネ	28,760,928	—	28,763,354	△2,426
	イスラエルシケル	32,228,121	—	32,108,236	119,885
ユーロ	289,798,736	—	291,641,795	△1,843,059	
合計		2,909,078,334	—	2,923,751,205	△14,672,871

(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7月26日現在]
1口当たり純資産額	7.1563円
(1万口当たり純資産額)	(71,563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7月26日現在]

資産の部

流動資産	
預金	10,892,100,974
コール・ローン	3,132,261,686
株式	871,613,950,721
投資証券	974,127,626
派生商品評価勘定	14,928,221
未収入金	26,712,404
未収配当金	4,421,715,886
未収利息	5,656
差入委託証拠金	6,266,108,269
流動資産合計	897,341,911,443
資産合計	897,341,911,443
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	676,909,196
未払金	4,894,054,681
未払解約金	346,994,731
流動負債合計	5,917,958,608
負債合計	5,917,958,608
純資産の部	
元本等	
元本	224,974,798,088
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	666,449,154,747
元本等合計	891,423,952,835
純資産合計	891,423,952,835
負債純資産合計	897,341,911,443

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7月26日現在]
1. 期首	2024年1月27日
期首元本額	179,683,584,344円
期中追加設定元本額	48,767,330,310円
期中一部解約元本額	3,476,116,566円
元本の内訳※	
MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信	1,381,422,293円
eMAXIS 新興国株式インデックス	10,210,420,387円

eMAXIS バランス (8資産均等型)	1,635,542,717 円
eMAXIS バランス (波乗り型)	117,740,676 円
三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	571,999,163 円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	8,955,525,836 円
eMAXIS Slim 新興国株式インデックス つみたて新興国株式	42,250,937,183 円
つみたて8資産均等バランス	9,365,155,962 円
つみたて8資産均等バランス	4,484,354,133 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	565,309 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,392,624 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	7,502,646 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本)	14,308,705,717 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	1,407,503,495 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カントリー)	98,946,458,952 円
新興国株式インデックス・オープン (ラップ向け)	4,155,197,194 円
つみたて全世界株式	861,137,604 円
ラップ向けインデックスf 新興国株式	987,233,020 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	32,396,019 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	1,400,322,620 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	1,631,455,340 円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	17,395,905,192 円
新興国株式インデックスオープン	420,446,779 円
eMAXIS 全世界株式インデックス	1,540,619,838 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	286,124,095 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	34,078,014 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	214,681,412 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	234,891,295 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	945,084,375 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)	899,826,620 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	18,796,172 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)	36,534,431 円
グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定)	430,918 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)	12,589,862 円
MUKAM バランスファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	46,603,672 円
MUKAM バランスファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	46,280,543 円
MUKAM バランスファンド2020-10 (適格機関投資家限定)	46,049,309 円
MUKAM バランスファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	40,750,531 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	224,974,798,088 円
2. 受益権の総数	224,974,798,088 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)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年7月26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 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>
	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(有価証券に関する注記)
 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7月26日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	19,755,383,096	—	19,079,356,585	△676,026,511
合計		19,755,383,096	—	19,079,356,585	△676,026,511

(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7月26日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカドル	3,008,823,971	—	3,022,882,507	14,058,536
	売建 オフショア元	1,784,151	—	1,797,151	△13,000
合計		3,010,608,122	—	3,024,679,658	14,045,536

(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7月26日現在]
1口当たり純資産額	3.9623円
(1万口当たり純資産額)	(39,623円)

(追加情報)

自 2024年1月27日 至 2024年7月26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た以降、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>

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年7月26日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,663,968,144
国債証券	800,586,951,440
地方債証券	49,697,647,040
特殊債券	39,499,997,602
社債券	59,009,483,000
未収入金	3,035,924,000
未収利息	1,642,465,948
前払金	15,760,000
前払費用	100,328,008
差入委託証拠金	34,226,646
流動資産合計	959,286,751,828

資産合計	959,286,751,828
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,941,505
未払金	1,290,557,000
未払解約金	1,351,380,419
流動負債合計	2,655,878,924
負債合計	2,655,878,924
純資産の部	
元本等	
元本	768,502,608,869
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	188,128,264,035
元本等合計	956,630,872,904
純資産合計	956,630,872,904
負債純資産合計	959,286,751,828

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7月26日現在]
1. 期首	2024年1月27日
期首元本額	608,533,464,538円
期中追加設定元本額	200,687,788,854円
期中一部解約元本額	40,718,644,523円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	8,112,589,418円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	12,843,684,803円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	3,616,867,627円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	59,660,204,015円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	115,190,396,348円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	39,611,166,477円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	223,700,644円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	212,210,476円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	1,679,579,109円
eMAXIS 国内債券インデックス	6,148,661,704円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	4,947,233,289円
eMAXIS バランス(波乗り型)	94,565,296円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	20,058,461,598円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	42,913,042,699円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	12,211,995,410円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	6,100,528,283円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	2,872,206,485円

eMAXIS Slim 国内債券インデックス	19,022,703,775 円
国内債券セレクション (ラップ向け)	5,608,998,231 円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	27,323,106,124 円
つみたて8資産均等バランス	13,736,620,772 円
つみたて4資産均等バランス	5,479,716,370 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	22,316,531 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	16,384,194 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	541,682 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	7,218,991,651 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	3,365,316,628 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	1,368,669,715 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	7,835,672,623 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	8,232,779,300 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	5,599,049,335 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	1,064,248,025 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	1,471,915,639 円
国内債券インデックスファンド (ラップ向け)	934,440,964 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	524,387,742 円
ラップ向けインデックスf 国内債券	6,812,013,292 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	2,344,764,362 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	14,595,052 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	8,917,049 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	6,027,635 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	56,719,654 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	91,833,237 円
eMAXIS 債券バランス (2資産均等型)	78,063,593 円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	2,245,105,987 円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	2,265,951,217 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	1,346,683,181 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	2,542,521,377 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	159,100,660 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	68,125,914 円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA (適格機関投資家限定)	5,572,978,877 円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	28,850,401 円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	9,202,447,087 円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	609,779,981 円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	4,674,595,732 円
MUAM 日本債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)	183,461,651,089 円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	475,934,550 円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,673,192 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	320,173 円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,452,127,567 円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	2,486,108,246 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)	2,373,014,600 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)	659,139,418円
MUKAM 日本債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	31,261,308,084円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	1,680,407,460円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	2,156,260円
日本債券インデックスファンドS	6,103,935,191円
グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定)	12,971,101円
国内債券インデックスオープンV (適格機関投資家限定)	9,088,555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)	24,503,259,248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)	554,334,205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)	546,840,063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)	547,010,780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)	543,756,712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)	546,757,835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)	548,694,334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)	539,198,394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)	536,900,992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)	545,804,051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)	559,816,343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)	587,761,901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)	606,830,601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)	622,785,795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)	627,454,324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)	628,202,232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)	628,183,105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)	628,165,479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)	628,207,051円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	19,691,951円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	23,549,907円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	3,620,358円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	10,249,957円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	19,156,054円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	50,128,541円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	9,801,149円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	32,954,991円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4,230,893,174円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)	2,323,320,110円

三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	4,942,244,229 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)	3,173,006,368 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)	2,302,165,879 円
合計	768,502,608,869 円
2. 受益権の総数	768,502,608,869 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7月26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はあります。
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

債券関連

[2024年7月26日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	3,298,780,000	—	3,284,860,000	△13,920,000
合計		3,298,780,000	—	3,284,860,000	△13,920,000

(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7月26日現在]
1口当たり純資産額	1.2448 円
(1万口当たり純資産額)	(12,448 円)

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7月26日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	3,328,388,967
コール・ローン	3,642,490,967
国債証券	646,764,907,362
派生商品評価勘定	108
未収入金	1,713,840
未収利息	5,239,743,486
前払費用	658,789,630
流動資産合計	659,636,034,360
資産合計	659,636,034,360
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	132,330,646
未払金	156,437,693
未払解約金	658,242,724
流動負債合計	947,011,063
負債合計	947,011,063
純資産の部	
元本等	
元本	242,154,492,738
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	416,534,530,559
元本等合計	658,689,023,297
純資産合計	658,689,023,297
負債純資産合計	659,636,034,360

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7月26日現在]
1. 期首	2024年1月27日
期首元本額	206,647,867,531円
期中追加設定元本額	51,824,637,279円

期中一部解約元本額	16,318,012,072 円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定型)	268,377,806 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型)	677,796,769 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (成長型)	471,570,755 円
三菱UFJ 外国債券オープン	794,251,205 円
三菱UFJ プライムバランス (安定型) (確定拠出年金)	1,973,624,085 円
三菱UFJ プライムバランス (安定成長型) (確定拠出年金)	6,078,868,984 円
三菱UFJ プライムバランス (成長型) (確定拠出年金)	5,164,477,696 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)	509,119,898 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型)	95,644,770 円
ファンド・マネジャー (海外債券)	638,383,364 円
eMAXIS 先進国債券インデックス	6,645,549,623 円
eMAXIS バランス (8資産均等型)	2,420,957,247 円
eMAXIS バランス (波乗り型)	211,680,514 円
三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	1,058,546,509 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	418,291,508 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	258,779,849 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	178,893,666 円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	53,949,249,983 円
海外債券セレクション (ラップ向け)	3,197,362,310 円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	13,247,320,894 円
つみたて8資産均等バランス	6,649,056,451 円
つみたて4資産均等バランス	2,534,085,959 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	5,111,272 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,814,563 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	725,841 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	243,403,396 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	175,723,189 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	102,093,719 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	777,641,057 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	1,303,412,772 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	2,190,019,408 円
三菱UFJ DC年金インデックス (先進国債券)	2,768,952,198 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	91,121,005 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	171,694,469 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	44,995,591 円
ラップ向けインデックスf 先進国債券	3,345,395,052 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	48,524,799 円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	35,994,638 円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	55,713,257 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	772,848 円
三菱UFJ 外国債券オープン (確定拠出年金)	3,199,614,761 円
三菱UFJ 外国債券オープン (毎月分配型)	15,905,541,724 円
ワールド・インカムオープン	937,503,256 円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	15,420,579,974 円

三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (毎月分配型)	381,454,854円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (年1回決算型)	2,442,171,795円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	1,038,201,380円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	553,429,410円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	307,044,915円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	588,303,290円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	246,390,714円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	91,443,063円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA (適格機関投資家限定)	947,590,132円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2 (適格機関投資家限定)	8,774,645円
MUAM 世界債券オープン (適格機関投資家限定)	761,398,330円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	10,709,156円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,384,658,755円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,047,735,900円
MUAM 外国債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)	48,891,841,064円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	432,088,393円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	372,713円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	100,210円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	1,138,939,018円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	29,936,841円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	55,568,872円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)	735,473,134円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	34,784,432円
MUKAM 外国債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	4,360,027,365円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	531,396,236円
外国債券インデックスファンドV (適格機関投資家限定)	33,906,959円
海外債券インデックスファンドS	6,355,392,493円
グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定)	5,986,410円
MUAM グローバルバランス (退職給付信託向け) (適格機関投資家限定)	12,357,414,449円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	1,533,506円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	2,504,478円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	500,819円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	848,319円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	4,217,231円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	3,423,562円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	7,479,279円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	3,309,681円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	8,819,715円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,743,666,878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)	181,156,325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)	526,644,328円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)	439,087,959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)	188,527,096円
合計	242,154,492,738円

2. 受益権の総数	242,154,492,738 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7月26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。
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つた場合、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7月26日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	3,207,660,000	—	3,077,954,000	△129,706,000
	オフショア元	74,951,530	—	74,317,950	△633,580
	売建				
	アメリカドル	285,551,850	—	286,537,774	△985,924
	カナダドル	8,916,960	—	8,917,160	△200
	オーストラリアドル	8,066,320	—	8,066,376	△56
	イギリスポンド	33,626,120	—	33,669,318	△43,198
	ユーロ	211,408,670	—	212,370,250	△961,580
	合計	3,830,181,450	—	3,701,832,828	△132,330,538

(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7月26日現在]
1口当たり純資産額	2.7201円
(1万口当たり純資産額)	(27,201円)

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7月26日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	1,564,984,737
コール・ローン	92,023,434
国債証券	97,371,353,852
派生商品評価勘定	617,304
未収入金	252,602,388
未収利息	1,431,779,194
前払費用	178,179,780
流動資産合計	100,891,540,689
資産合計	100,891,540,689
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	62,402
前受収益	99,558
未払金	123,655,505
未払解約金	25,668,385
流動負債合計	149,485,850
負債合計	149,485,850
純資産の部	
元本等	
元本	54,769,397,082
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	45,972,657,757
元本等合計	100,742,054,839
純資産合計	100,742,054,839
負債純資産合計	100,891,540,689

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7月26日現在]
1. 期首	2024年1月27日
期首元本額	49,510,869,131円
期中追加設定元本額	6,455,730,682円
期中一部解約元本額	1,197,202,731円
元本の内訳※	
eMAXIS バランス (8資産均等型)	3,545,559,839円
eMAXIS バランス (波乗り型)	311,563,916円
三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	1,261,308,348円
海外債券セレクション (ラップ向け)	722,068,741円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	19,504,428,016円
つみたて8資産均等バランス	9,798,392,908円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,250,067円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,038,896円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	1,427,886円
ラップ向けインデックスf 新興国債券	3,089,396,931円
eMAXIS 新興国債券インデックス	3,178,712,726円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	12,415,196,820円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	75,309,781円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	314,987,693円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	310,524,324円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	179,319,046円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	6,099,084円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	10,364,781円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	41,447,279円
合計	54,769,397,082円
2. 受益権の総数	54,769,397,082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7月26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 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
通貨関連

[2024年7月26日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	インドネシアルピア	47,471,183	—	47,747,617	276,434
	メキシコペソ	26,681,970	—	26,729,470	47,500
	チェココルナ	13,073,600	—	13,184,000	110,400
	ハンガリーフォリント	5,586,100	—	5,537,298	△48,802
	ポーランドズロチ	15,456,920	—	15,602,240	145,320
	南アフリカランド	16,734,000	—	16,766,120	32,120
	中国元	36,126,700	—	36,127,380	680
	トルコリラ	3,253,040	—	3,244,290	△8,750
合計		164,383,513	—	164,938,415	554,902

(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7月26日現在]
1口当たり純資産額	1.8394円
(1万口当たり純資産額)	(18,394円)

東証REIT指数マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年7月26日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,748,086,069
投資証券	118,084,178,030
未収配当金	828,565,212
未収利息	4,963
前払金	7,265,000
その他未収収益	220,033
差入委託証拠金	83,411,336
流動資産合計	121,751,730,643
資産合計	121,751,730,643
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,819,250
未払解約金	17,530,132
未払利息	120,632
受入担保金	2,103,881,325
流動負債合計	2,124,351,339
負債合計	2,124,351,339
純資産の部	
元本等	
元本	35,077,782,712
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	84,549,596,592
元本等合計	119,627,379,304
純資産合計	119,627,379,304
負債純資産合計	121,751,730,643

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年7月26日現在]
1. 期首	2024年1月27日
期首元本額	28,967,583,332円
期中追加設定元本額	7,733,346,108円
期中一部解約元本額	1,623,146,728円
元本の内訳※	
eMAXIS 国内リートインデックス	4,193,487,518円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,946,854,717円
eMAXIS バランス(波乗り型)	171,049,950円
三菱UFJ <DC> J-REITインデックスファンド	761,249,504円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	518,620,285円
J-REITインデックスファンド(ラップ向け)	62,480,022円
オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け)	889,269,208円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	10,737,610,316円

つみたて8資産均等バランス	5,394,555,339円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	914,802円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,699,200円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	781,173円
eMAXIS Slim 国内リートインデックス	5,602,919,227円
ラップ向けインデックスf 国内リート	685,378,837円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	137,186,187円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	1,299,823,062円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	190,872,755円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	4,660,971円
三菱UFJ 国内リートインデックスファンド	65,370,680円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	7,718,798円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス (為替リスク軽減型) コンサバティブコース	1,554,509円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス (為替リスク軽減型) スタンダードコース	12,606,656円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	2,964,387円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	16,263,810円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	33,520,254円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	55,865,294円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	263,516,964円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	230,466,125円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	98,851,896円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	17,042,278円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	241,171円
MUKAM 3資産インカムバランスファンド (適格機関投資家転売制限付)	383,566,480円
日本リートインデックスファンドS	597,917,684円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	36,726,590円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	36,230,204円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	36,241,552円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	36,025,976円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	36,223,712円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	36,352,007円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)	35,722,908円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	35,571,556円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	36,160,507円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	37,092,372円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	38,938,060円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	40,203,912円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	41,261,256円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	41,579,926円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	41,642,416円

格機関投資家限定)	
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	41,643,078 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)	41,636,571 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定)	41,650,050 円
合計	35,077,782,712 円
2. 貸付有価証券 貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っております。 投資証券	1,997,284,100 円
3. 受益権の総数	35,077,782,712 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)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年7月26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 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

投資証券関連

[2024年7月26日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	1,519,114,000	—	1,516,314,000	△2,800,000
合計		1,519,114,000	—	1,516,314,000	△2,800,000

(注) 時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報)

	[2024年7月26日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.4103円 (34,103円)

MUAM G-REITマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年7月26日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	2,504,929,335
コール・ローン	129,736,336
投資証券	134,309,695,812
派生商品評価勘定	177,033,909
未収配当金	209,884,956
未収利息	234
差入委託証拠金	881,054,594
流動資産合計	138,212,335,176
資産合計	138,212,335,176
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,843,681
未払解約金	151,499,164
流動負債合計	153,342,845
負債合計	153,342,845
純資産の部	
元本等	
元本	48,758,929,467
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	89,300,062,864
元本等合計	138,058,992,331
純資産合計	138,058,992,331
負債純資産合計	138,212,335,176

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。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7月26日現在]
1. 期首	2024年1月27日
期首元本額	45,744,488,251円
期中追加設定元本額	4,955,754,780円
期中一部解約元本額	1,941,313,564円
元本の内訳※	
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	99,603,258円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	92,925,886円
三菱UFJ 資産設計ファンド(分配型)	25,613,843円
三菱UFJ 資産設計ファンド(バランス型)	50,169,379円
三菱UFJ 資産設計ファンド(株式重視型)	23,224,114円
eMAXIS 先進国リートインデックス	5,845,764,963円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,324,051,665円
eMAXIS バランス(波乗り型)	199,903,563円
三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド	3,278,090,233円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	630,053,740円
オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け)	2,027,973,131円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	12,915,748,068円
つみたて8資産均等バランス	6,479,399,381円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,086,019円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,012,501円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	912,946円
eMAXIS Slim 先進国リートインデックス	10,768,225,193円
三菱UFJ 先進国リートインデックスファンド	109,160,875円
ラップ向けインデックスf 先進国リート	935,936,431円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型)	31,626,896円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型)	763,559,488円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型)	336,673,531円
ラップ向けインデックスf 先進国リート(為替ヘッジあり)	259,898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	230,564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	5,474,045円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	12,475,937円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	36,211,802円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	39,827,224円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	66,474,622円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	313,807,503円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	274,819,422円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	114,991,663円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	20,703,718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)	87,011円
海外リートインデックスファンドS	918,551,326円
先進国リートインデックスオープンV(適格機関投資家限定)	13,299,628円
合計	48,758,929,467円
2. 受益権の総数	48,758,929,467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)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年7月26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ん。

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)
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
投資証券関連

[2024年7月26日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	3,602,572,968	—	3,777,943,623	175,370,655
合計		3,602,572,968	—	3,777,943,623	175,370,655

(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7月26日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカドル	28,035,644	—	28,034,752	△892
	売建 アメリカドル	11,648,596	—	11,708,582	△59,986
	オーストラリアドル	8,445,990	—	8,470,753	△24,763
	ニュージーランドドル	3,084,310	—	3,084,119	191
	ユーロ	14,955,345	—	15,050,322	△94,977

合計	66,169,885	—	66,348,528	△180,427
----	------------	---	------------	----------

(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7月26日現在]
1口当たり純資産額	2.8315円
(1万口当たり純資産額)	(28,315円)

2【ファンドの現況】

【eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）】

【純資産額計算書】

2024年7月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	5,653,932,885
II 負債総額	7,811,788
III 純資産総額 (I - II)	5,646,121,097
IV 発行済口数	4,453,339,356口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.2678
(10,000口当たり)	(12,678)

【eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）】

【純資産額計算書】

2024年7月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	4,682,919,146
II 負債総額	3,808,018
III 純資産総額 (I - II)	4,679,111,128
IV 発行済口数	3,089,946,814口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.5143

(10,000 口当たり)	(15,143)
---------------	----------

【eMAX I S 最適化バランス（マイミッドフィルダー）】

【純資産額計算書】

2024年7月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	14,613,159,050
II 負債総額	13,221,255
III 純資産総額（I - II）	14,599,937,795
IV 発行済口数	8,254,440,304口
V 1口当たり純資産価額（III/IV）	1.7687
(10,000 口当たり)	(17,687)

【eMAX I S 最適化バランス（マイフォワード）】

【純資産額計算書】

2024年7月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	9,518,819,502
II 負債総額	10,235,525
III 純資産総額（I - II）	9,508,583,977
IV 発行済口数	4,434,673,878口
V 1口当たり純資産価額（III/IV）	2.1441
(10,000 口当たり)	(21,441)

【eMAX I S 最適化バランス（マイストライカー）】

【純資産額計算書】

2024年7月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	16,365,065,667
II 負債総額	35,553,357
III 純資産総額（I - II）	16,329,512,310
IV 発行済口数	6,670,421,827口
V 1口当たり純資産価額（III/IV）	2.4480
(10,000 口当たり)	(24,480)

(参考)

TOPIXマザーファンド

純資産額計算書

2024年7月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	1,601,497,667,234
II 負債総額	51,538,500,564
III 純資産総額 (I - II)	1,549,959,166,670
IV 発行済口数	451,652,779,706口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	3.4317
(10,000口当たり)	(34,317)

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7月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	6,018,604,062,820
II 負債総額	3,950,196,949
III 純資産総額 (I - II)	6,014,653,865,871
IV 発行済口数	843,820,834,651口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	7.1279
(10,000口当たり)	(71,279)

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7月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	886,663,843,107
II 負債総額	1,193,253,891
III 純資産総額 (I - II)	885,470,589,216
IV 発行済口数	226,079,280,822口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	3.9166
(10,000口当たり)	(39,166)

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年7月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	963,209,864,827
II 負債総額	6,876,083,743
III 純資産総額 (I - II)	956,333,781,084
IV 発行済口数	769,145,686,189口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.2434
(10,000口当たり)	(12,434)

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7月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	656,256,655,600
II 負債総額	1,534,964,404
III 純資産総額 (I - II)	654,721,691,196
IV 発行済口数	242,296,010,466口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	2.7022
(10,000口当たり)	(27,022)

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7月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	100,286,822,961
II 負債総額	172,537,109
III 純資産総額 (I - II)	100,114,285,852
IV 発行済口数	54,920,108,709口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.8229
(10,000口当たり)	(18,229)

東証REIT指数マザーファンド

純資産額計算書

2024年7月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	124,171,588,046
II 負債総額	3,028,318,652

Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	121, 143, 269, 394
Ⅳ 発行済口数	35, 133, 369, 489口
Ⅴ 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	3. 4481
（10, 000口当たり）	（34, 481）

MUAM G-R E I Tマザーファンド

純資産額計算書

2024年7月31日現在

（単位：円）

Ⅰ 資産総額	140, 421, 983, 098
Ⅱ 負債総額	142, 618, 964
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	140, 279, 364, 134
Ⅳ 発行済口数	48, 840, 395, 663口
Ⅴ 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	2. 8722
（10, 000口当たり）	（28, 722）

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7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ファンドに係る法人等の管理

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

⑧運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

2024年7月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	829	35,602,157
追加型公社債投資信託	16	1,535,876
単位型株式投資信託	94	419,510
単位型公社債投資信託	48	101,839
合計	987	37,659,382

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まいります。

2. 会計処理の概要

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

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

建物の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3. 当該資産除去債務の総額の増減

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

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

収益及び契約から生じるキャッシュ・フローの性質、金額、時期及び不確実性に影響を及ぼす主要な要因に基づく区分に当該収益を分解した情報については、重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

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

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注5)	科目	期末残高(注5)
親会社	㈱三菱UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税等	連結納税等に 伴う支払 (注1)	3,947,200 千円	その他未払金	77,007 千円
親会社	三菱UFJ 信託銀行㈱	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	4,893,312 千円	未払手数料	790,279 千円
						投資の助言 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通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ④委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ⑤上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5【その他】

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

約款

追加型証券投資信託

eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)

約 款

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）

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、最適化バランス（6%）指数に連動する投資成果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、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、日本を含む先進国の株式、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に直接投資することがあります。

(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、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として各マザーファンドの対象インデックスに採用されている、日本を含む先進国の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を最適化バランス（6%）指数の変動率に連動させることを目的とした運用を行います。なお、各マザーファンドは、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）およびS&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）を対象インデックスとし、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を各対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行うものです。
- ② 国内株式、先進国株式、国内債券、先進国債券、国内不動産投資信託証券および先進国不動産投資信託証券への実質的な投資割合は、目標リスク水準（6%程度）に対し過去の市場データを用いて最適化を行い決定される、最適化バランス（6%）指数の各資産の構成比率となるよう運用を行います。
- ③ 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。
- ④ 最適化バランス（6%）指数との連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。
- ⑤ 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ⑥ 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。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④ 外貨建資産への実質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。

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
『eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)』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、第18条第1項および第2項ならびに第29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1,000万円を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第45条第8項、第46条第1項、第47条第1項、第48条第1項および第50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1,000万口に、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26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「外貨建価値証券」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28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。

(信託日時の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、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(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。
- ③ 委託者ならびに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2項による受益権の取得申込みに応じないものとします。
- ④ 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項および第2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

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。

- ⑤ 委託者は、前2項の規定にかかわらず、受益者が第43条第3項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合または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。
- ⑥ 第1項および第2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円とします。
- ⑦ 前項の規定にかかわらず、受益者が第43条第3項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合または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37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項および第2項の取得申込者は、委託者、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（第43条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、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6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、日本債券インデックスマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、東証REIT指数マザーファンドおよびMUAMG-REIT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. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

なお、第1号の証券または証券ならびに第13号および第19号の証券または証券のうち第1号の証券または証券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号の証券または証券のうち第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. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
7. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、前各号に該当するものを除きます。）
8. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
9. 合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第2条第2項第3号で定めるものをいいます。）
10. 外国法人の社員権で前号の権利の性質を有するもの
11. 投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利（金融商品取引法第2条第2項第5号で定めるものをいいます。）
12. 外国の法令に基づく権利であって、前号の権利に類するもの

- 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。）の時価総額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

（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つて行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第29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26条、第28条、第32条から第34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26条、第28条、第32条から第34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51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の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券

4. 売出しにより取得する株券

5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債（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、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、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。

（有価証券の貸付の指図および範囲）

第25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、投資信託証券（金融商品取引所に上場されているものに限り、以下本条において同じ。）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. 投資信託証券の貸付は、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。

3. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

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。

(公社債の借入れ)

第26条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

② 前項の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

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27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)

第28条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

(信託業務の委託等)

第29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30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31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32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33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34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35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36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37条 この信託の計算期間は、毎年1月27日から翌年1月26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計算期間は信託契約締結日から2017年1月26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38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39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40条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第37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応じて以下の率を乗じて得た額とします。

- 500億円未満の部分 年10,000分の50
- 500億円以上1,000億円未満の部分 年10,000分の48
- 1,000億円以上の部分 年10,000分の46

- 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41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42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43条第4項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第45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43条第5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43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（第43条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、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ます。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 委託者は、第1項の規定にかかわらず、委託者の自らの募集に係る受益権に帰属する収益分配金（受益者が自己に帰属する受益権の全部もしくは一部の口数について、委託者に対し、この信託の収益分配金の再投資に係る受益権の取得申込みをしないことをあらかじめ申し出た場合において、委託者が当該申出を受け付けた受益権に帰属する収益分配金を除きます。）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ます。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。

- ④ 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（第43条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、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。

- ⑤ 一部解約金は、第45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、5営業日目から当該受益者に支払います。
- ⑥ 前各項（第2項および第3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、委託者ならびに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ます。
- ⑦ 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ます。

（委託者の自らの募集に係る受益権の口座管理機関）

第43条の2 委託者は、委託者の自らの募集に係る受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または登録等に関する業務を委任することができます。

（収益分配金および償還金の時効）

第44条 受益者が、収益分配金については第43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第43条第4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45条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者ならびに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。なお、委託者の自らの募集に係る受益権については、1口の整数倍をもって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、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10億口を下回るものとなった場合には、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46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46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、対象インデックスが改廃されたときまたはやむを得ない事情が発生したときは、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47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51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48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51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49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50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51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51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、

- 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52条 第46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45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。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第53条 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つた場合には、これを交付します。

(公告)

第54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55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56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43条第7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。

第5条 運用の基本方針における「最適化バランス（6%）指数」とは、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンが目標リスク水準（6%程度）に合わせ、下記の投資信託証券を参照して算出する指数です。指数は下記の投資信託証券におけるベンチマークの長期間にわたるデータを用いて期待収益率、リスク（標準偏差）等をそれぞれ推計した上で最適化（目標リスク水準に対してリターンが最大化される）を行い決定される資産クラス別比率に応じて、下記の投資信託証券の基準価額（分配金再投資）の騰落率を乗じることで算出されます。指数の資産クラス別比率の決定は、原則として年1回行われます。

eMAXIS TOPIXインデックス

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

信託契約締結日 2016年3月30日

(付表)

1. 約款第13条第3項および第45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

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

追加型証券投資信託

eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)

約 款

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)

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、最適化バランス(9%)指数に連動する投資成果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、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、日本を含む世界各国の株式(DR(預託証券)を含みます。以下同じ。)、公社債および上場投資信託証券(不動産投資信託証券を含みます。)に直接投資することがあります。

(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、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として各マザーファンドの対象インデックスに採用されている、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を最適化バランス(9%)指数の変動率に連動させることを目的とした運用を行います。なお、各マザーファンドは、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)、東証REIT指数(配当込み)およびS&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)を対象インデックスとし、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を各対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行うものです。

② 国内株式、先進国株式、新興国株式、国内債券、先進国債券、新興国債券、国内不動産投資信託証券および先進国不動産投資信託証券への実質的な投資割合は、目標リスク水準(9%程度)に対し過去の市場データを用いて最適化を行い決定される、最適化バランス(9%)指数の各資産の構成比率となるよう運用を行います。

③ 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。

④ 最適化バランス(9%)指数との連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

⑤ 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

⑥ 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。)への投資割合は、信託財産の純資産総額

の5%以下とします。

- ④外貨建資産への実質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、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことができます。
- 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。

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
『eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）』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、第18条第1項および第2項ならびに第30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1,000万円を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第46条第8項、第47条第1項、第48条第1項、第49条第1項および第51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1,000万口に、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27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「外貨建価値証券」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29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。

(信託日時の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、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(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。
- ③ 委託者ならびに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2項による受益権の取得申込みに応じないものとします。
- ④ 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・地域における非常事態(金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む

規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等)による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等)があるときは、第1項および第2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。

- ⑤ 委託者は、前2項の規定にかかわらず、受益者が第44条第3項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合または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。
- ⑥ 第1項および第2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円とします。
- ⑦ 前項の規定にかかわらず、受益者が第44条第3項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合または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38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項および第2項の取得申込者は、委託者、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(第44条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。)、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6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、日本債券インデックスマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、新興国債券インデックスマザーファンド、東証REIT指数マザーファンドおよびMUAMGRIT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. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

なお、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. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
 7. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、前各号に該当するものを除きます。）
 8. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
 9. 合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第2条第2項第3号で定めるものをいいます。）
 10. 外国法人の社員権で前号の権利の性質を有するもの
 11. 投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利（金融商品取引法第2条第2項第5号で定めるものをいいます。）
 12. 外国の法令に基づく権利であって、前号の権利に類するもの
- 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。）の時価総額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

（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、第30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27条、第29条、第33条から第35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27条、第29条、第33条から第35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52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の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債（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（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、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、為替先渡取引および直物為替先渡取引の運用指図）

第24条 委託者は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第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、為替先渡取引および直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額または価格情報会社の提供する価額で評価するものとします。
- ④ 委託者は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うにあたり担保の

提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第25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、投資信託証券（金融商品取引所に上場されているものに限り、以下本条において同じ。）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. 投資信託証券の貸付は、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
 3. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 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、信託財産において有しない有価証券または第27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27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28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)

第29条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- 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外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

(信託業務の委託等)

第30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31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32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33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34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35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36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37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38条 この信託の計算期間は、毎年1月27日から翌年1月26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計算期間は信託契約締結日から2017年1月26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39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40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41条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第38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応じて以下の率を乗じて得た額とします。

- 500億円未満の部分 年10,000分の50
500億円以上1,000億円未満の部分 年10,000分の48
1,000億円以上の部分 年10,000分の46

- 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42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43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44条第4項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第46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44条第5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なります。

（収益分配金、償還金および一部解約金の支払い）

第44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（第44条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、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ます。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 委託者は、第1項の規定にかかわらず、委託者の自らの募集に係る受益権に帰属する収益分配金（受益者が自己に帰属する受益権の全部もしくは一部の口数について、委託者に対し、この信託の収益分配金の再投資に係る受益権の取得申込みをしないことをあらかじめ申し出た場合において、委託者が当該申出を受け付けた受益権に帰属する収益分配金を除きます。）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ます。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。
- ④ 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（第44条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、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。
- ⑤ 一部解約金は、第46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。
- ⑥ 前各項（第2項および第3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、委託者ならびに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ます。
- ⑦ 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ます。

（委託者の自らの募集に係る受益権の口座管理機関）

第44条の2 委託者は、委託者の自らの募集に係る受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または登録等に関する業務を委任することができます。

（収益分配金および償還金の時効）

第45条 受益者が、収益分配金については第44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第44条第4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46条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者ならびに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。なお、委託者の自らの募集に係る受益権については、1口の整数倍をもって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

から当該基準価額に0.05%の率を乗じて得た信託財産留保額を控除した価額とします。

- 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、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・地域における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、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47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47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、対象インデックスが改廃されたときまたはやむを得ない事情が発生したときは、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48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52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49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52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50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51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52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52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であっても、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53条 第47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46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。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第54条 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55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56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57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られます。

(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44条第7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。

第5条 第24条に規定する「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、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の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

第6条 運用の基本方針における「最適化バランス(9%)指数」とは、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンが目標リスク水準(9%程度)に合わせ、下記の投資信託証券を参照して算出する指数です。指数は下記の投資信託証券におけるベンチマークの長期間にわたるデータを用いて期待収益率、リスク(標準偏差)等をそれぞれ推計した上で最適化(目標リスク水準に対してリターンが最大化される)を行い決定される資産クラス別比率に応じて、下記の投資信託証券の基準価額(分配金再投資)の騰落率を乗じることで算出されます。指数の資産クラス別比率の決定は、原則として年1回行われます。

eMAXIS TOPIXインデックス

eMAXIS 国内債券インデックス

eMAXIS 国内リートインデックス

eMAXIS 先進国株式インデックス

eMAXIS 先進国債券インデックス

eMAXIS 先進国リートインデックス

eMAXIS 新興国株式インデックス

eMAXIS 新興国債券インデックス

信託契約締結日 2016年3月30日

(付表)

1. 約款第13条第3項および第46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

香港取引所の休業日

香港の銀行の休業日

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

追加型証券投資信託

eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）

約 款

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）

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、最適化バランス（12%）指数に連動する投資成果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、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、日本を含む世界各国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に直接投資することがあります。

(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、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として各マザーファンドの対象インデックスに採用されている、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を最適化バランス（12%）指数の変動率に連動させることを目的とした運用を行います。なお、各マザーファンドは、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）およびS&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）を対象インデックスとし、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を各対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行うものです。
- ② 国内株式、先進国株式、新興国株式、国内債券、先進国債券、新興国債券、国内不動産投資信託証券および先進国不動産投資信託証券への実質的な投資割合は、目標リスク水準（12%程度）に対し過去の市場データを用いて最適化を行い決定される、最適化バランス（12%）指数の各資産の構成比率となるよう運用を行います。
- ③ 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。
- ④ 最適化バランス（12%）指数との連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。
- ⑤ 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ⑥ 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。）への投資割合は、信託財産の純資産総額

の5%以下とします。

- ④外貨建資産への実質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、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことができます。
- 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。

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
『eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)』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、第18条第1項および第2項ならびに第30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1,000万円を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第46条第8項、第47条第1項、第48条第1項、第49条第1項および第51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1,000万口に、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27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「外貨建価値証券」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29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。

(信託日時の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、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(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。
- ③ 委託者ならびに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2項による受益権の取得申込みに応じないものとします。
- ④ 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・地域における非常事態(金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む

規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等)による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等)があるときは、第1項および第2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。

- ⑤ 委託者は、前2項の規定にかかわらず、受益者が第44条第3項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合または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。
- ⑥ 第1項および第2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円とします。
- ⑦ 前項の規定にかかわらず、受益者が第44条第3項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合または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38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項および第2項の取得申込者は、委託者、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(第44条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。)、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6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、日本債券インデックスマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、新興国債券インデックスマザーファンド、東証REIT指数マザーファンドおよびMUAMGR-EIT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. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

なお、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. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
 7. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、前各号に該当するものを除きます。）
 8. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
 9. 合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第2条第2項第3号で定めるものをいいます。）
 10. 外国法人の社員権で前号の権利の性質を有するもの
 11. 投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利（金融商品取引法第2条第2項第5号で定めるものをいいます。）
 12. 外国の法令に基づく権利であって、前号の権利に類するもの
- 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。）の時価総額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

（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、第30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27条、第29条、第33条から第35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27条、第29条、第33条から第35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52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の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債（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（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、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、為替先渡取引および直物為替先渡取引の運用指図）

第24条 委託者は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第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、為替先渡取引および直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額または価格情報会社の提供する価額で評価するものとします。
- ④ 委託者は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うにあたり担保の

提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第25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、投資信託証券（金融商品取引所に上場されているものに限り、以下本条において同じ。）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. 投資信託証券の貸付は、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
 3. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 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、信託財産において有しない有価証券または第27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27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28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)

第29条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- 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外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

(信託業務の委託等)

第30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31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32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33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34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35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36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37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38条 この信託の計算期間は、毎年1月27日から翌年1月26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計算期間は信託契約締結日から2017年1月26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39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40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41条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第38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応じて以下の率を乗じて得た額とします。

- 500億円未満の部分 年10,000分の50
500億円以上1,000億円未満の部分 年10,000分の48
1,000億円以上の部分 年10,000分の46

- 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42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43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44条第4項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第46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44条第5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なります。

（収益分配金、償還金および一部解約金の支払い）

第44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（第44条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、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ます。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 委託者は、第1項の規定にかかわらず、委託者の自らの募集に係る受益権に帰属する収益分配金（受益者が自己に帰属する受益権の全部もしくは一部の口数について、委託者に対し、この信託の収益分配金の再投資に係る受益権の取得申込みをしないことをあらかじめ申し出た場合において、委託者が当該申出を受け付けた受益権に帰属する収益分配金を除きます。）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ます。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。
- ④ 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（第44条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、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。
- ⑤ 一部解約金は、第46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。
- ⑥ 前各項（第2項および第3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、委託者ならびに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ます。
- ⑦ 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ます。

（委託者の自らの募集に係る受益権の口座管理機関）

第44条の2 委託者は、委託者の自らの募集に係る受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または登録等に関する業務を委任することができます。

（収益分配金および償還金の時効）

第45条 受益者が、収益分配金については第44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第44条第4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46条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者ならびに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。なお、委託者の自らの募集に係る受益権については、1口の整数倍をもって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

から当該基準価額に0.05%の率を乗じて得た信託財産留保額を控除した価額とします。

- 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、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・地域における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、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10億口を下回るようになった場合には、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47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47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、対象インデックスが改廃されたときまたはやむを得ない事情が発生したときは、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48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52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49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52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50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51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52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52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であっても、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53条 第47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46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。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第54条 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55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56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57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られます。

(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44条第7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。

第5条 第24条に規定する「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、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の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

第6条 運用の基本方針における「最適化バランス(12%)指数」とは、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンが目標リスク水準(12%程度)に合わせ、下記の投資信託証券を参照して算出する指数です。指数は下記の投資信託証券におけるベンチマークの長期間にわたるデータを用いて期待収益率、リスク(標準偏差)等をそれぞれ推計した上で最適化(目標リスク水準に対してリターンが最大化される)を行い決定される資産クラス別比率に応じて、下記の投資信託証券の基準価額(分配金再投資)の騰落率を乗じることで算出されます。指数の資産クラス別比率の決定は、原則として年1回行われます。

eMAXIS TOPIXインデックス

eMAXIS 国内債券インデックス

eMAXIS 国内リートインデックス

eMAXIS 先進国株式インデックス

eMAXIS 先進国債券インデックス

eMAXIS 先進国リートインデックス

eMAXIS 新興国株式インデックス

eMAXIS 新興国債券インデックス

信託契約締結日 2016年3月30日

(付表)

1. 約款第13条第3項および第46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

香港取引所の休業日

香港の銀行の休業日

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

追加型証券投資信託

eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）

約 款

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)

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、最適化バランス(16%)指数に連動する投資成果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、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、日本を含む世界各国の株式(DR(預託証券)を含みます。以下同じ。)、公社債および上場投資信託証券(不動産投資信託証券を含みます。)に直接投資することがあります。

(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、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として各マザーファンドの対象インデックスに採用されている、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を最適化バランス(16%)指数の変動率に連動させることを目的とした運用を行います。なお、各マザーファンドは、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)、東証REIT指数(配当込み)およびS&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)を対象インデックスとし、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を各対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行うものです。

② 国内株式、先進国株式、新興国株式、国内債券、先進国債券、新興国債券、国内不動産投資信託証券および先進国不動産投資信託証券への実質的な投資割合は、目標リスク水準(16%程度)に対し過去の市場データを用いて最適化を行い決定される、最適化バランス(16%)指数の各資産の構成比率となるよう運用を行います。

③ 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。

④ 最適化バランス(16%)指数との連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

⑤ 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

⑥ 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。)への投資割合は、信託財産の純資産総額

の5%以下とします。

- ④外貨建資産への実質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、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことができます。
- 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。

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
『eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)』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、第18条第1項および第2項ならびに第30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1,000万円を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第46条第8項、第47条第1項、第48条第1項、第49条第1項および第51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1,000万口に、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27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「外貨建価値証券」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29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、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(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。

- ③ 委託者ならびに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2項による受益権の取得申込みに応じないものとします。

- ④ 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・地域における非常事態(金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む

規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等)による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等)があるときは、第1項および第2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。

- ⑤ 委託者は、前2項の規定にかかわらず、受益者が第44条第3項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合または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。
- ⑥ 第1項および第2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円とします。
- ⑦ 前項の規定にかかわらず、受益者が第44条第3項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合または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38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項および第2項の取得申込者は、委託者、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(第44条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。)、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6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、日本債券インデックスマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、新興国債券インデックスマザーファンド、東証REIT指数マザーファンドおよびMUAMGR-EIT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. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

なお、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. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
 7. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、前各号に該当するものを除きます。）
 8. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
 9. 合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第2条第2項第3号で定めるものをいいます。）
 10. 外国法人の社員権で前号の権利の性質を有するもの
 11. 投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利（金融商品取引法第2条第2項第5号で定めるものをいいます。）
 12. 外国の法令に基づく権利であって、前号の権利に類するもの
- 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。）の時価総額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

（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、第30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27条、第29条、第33条から第35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27条、第29条、第33条から第35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52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の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債（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（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、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、為替先渡取引および直物為替先渡取引の運用指図）

第24条 委託者は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第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、為替先渡取引および直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額または価格情報会社の提供する価額で評価するものとします。
- ④ 委託者は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うにあたり担保の

提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第25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、投資信託証券（金融商品取引所に上場されているものに限り、以下本条において同じ。）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. 投資信託証券の貸付は、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
 3. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 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、信託財産において有しない有価証券または第27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27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28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)

第29条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- 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外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

(信託業務の委託等)

第30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31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32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33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34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35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36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37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38条 この信託の計算期間は、毎年1月27日から翌年1月26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計算期間は信託契約締結日から2017年1月26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39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40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41条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第38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応じて以下の率を乗じて得た額とします。

- 500億円未満の部分 年10,000分の50
500億円以上1,000億円未満の部分 年10,000分の48
1,000億円以上の部分 年10,000分の46

- 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42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43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44条第4項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第46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44条第5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なります。

（収益分配金、償還金および一部解約金の支払い）

第44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（第44条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、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ます。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 委託者は、第1項の規定にかかわらず、委託者の自らの募集に係る受益権に帰属する収益分配金（受益者が自己に帰属する受益権の全部もしくは一部の口数について、委託者に対し、この信託の収益分配金の再投資に係る受益権の取得申込みをしないことをあらかじめ申し出た場合において、委託者が当該申出を受け付けた受益権に帰属する収益分配金を除きます。）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ます。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。
- ④ 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（第44条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、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。
- ⑤ 一部解約金は、第46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。
- ⑥ 前各項（第2項および第3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、委託者ならびに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ます。
- ⑦ 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ます。

（委託者の自らの募集に係る受益権の口座管理機関）

第44条の2 委託者は、委託者の自らの募集に係る受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または登録等に関する業務を委任することができます。

（収益分配金および償還金の時効）

第45条 受益者が、収益分配金については第44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第44条第4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46条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者ならびに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。なお、委託者の自らの募集に係る受益権については、1口の整数倍をもって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

から当該基準価額に0.10%の率を乗じて得た信託財産留保額を控除した価額とします。

- 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、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・地域における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、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47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47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、対象インデックスが改廃されたときまたはやむを得ない事情が発生したときは、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48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52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49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52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50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51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52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52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であっても、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53条 第47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46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。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第54条 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55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56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57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られます。

(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44条第7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。

第5条 第24条に規定する「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、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の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

第6条 運用の基本方針における「最適化バランス(16%)指数」とは、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンが目標リスク水準(16%程度)に合わせ、下記の投資信託証券を参照して算出する指数です。指数は下記の投資信託証券におけるベンチマークの長期間にわたるデータを用いて期待収益率、リスク(標準偏差)等をそれぞれ推計した上で最適化(目標リスク水準に対してリターンが最大化される)を行い決定される資産クラス別比率に応じて、下記の投資信託証券の基準価額(分配金再投資)の騰落率を乗じることで算出されます。指数の資産クラス別比率の決定は、原則として年1回行われます。

eMAXIS TOPIXインデックス

eMAXIS 国内債券インデックス

eMAXIS 国内リートインデックス

eMAXIS 先進国株式インデックス

eMAXIS 先進国債券インデックス

eMAXIS 先進国リートインデックス

eMAXIS 新興国株式インデックス

eMAXIS 新興国債券インデックス

信託契約締結日 2016年3月30日

(付表)

1. 約款第13条第3項および第46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

香港取引所の休業日

香港の銀行の休業日

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

追加型証券投資信託

eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）

約 款

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)

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、最適化バランス (20%) 指数に連動する投資成果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、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、日本を含む世界各国の株式 (DR (預託証券) を含みます。以下同じ。)、公社債および上場投資信託証券 (不動産投資信託証券を含みます。) に直接投資することがあります。

(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、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として各マザーファンドの対象インデックスに採用されている、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を最適化バランス (20%) 指数の変動率に連動させることを目的とした運用を行います。なお、各マザーファンドは、東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)、MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円換算ベース)、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド (円換算ベース)、東証REIT指数 (配当込み) およびS&P先進国REITインデックス (除く日本、配当込み、円換算ベース) を対象インデックスとし、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を各対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行うものです。

② 国内株式、先進国株式、新興国株式、国内債券、先進国債券、新興国債券、国内不動産投資信託証券および先進国不動産投資信託証券への実質的な投資割合は、目標リスク水準 (20%程度) に対し過去の市場データを用いて最適化を行い決定される、最適化バランス (20%) 指数の各資産の構成比率となるよう運用を行います。

③ 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。

④ 最適化バランス (20%) 指数との連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

⑤ 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

⑥ 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。) への投資割合は、信託財産の純資産総額

の5%以下とします。

- ④外貨建資産への実質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、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことができます。
- 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。

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
『eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)』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、第18条第1項および第2項ならびに第30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1,000万円を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第46条第8項、第47条第1項、第48条第1項、第49条第1項および第51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1,000万口に、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27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「外貨建価値証券」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29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。

(信託日時の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、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(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。
- ③ 委託者ならびに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2項による受益権の取得申込みに応じないものとします。
- ④ 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・地域における非常事態(金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む

規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等)による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等)があるときは、第1項および第2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。

- ⑤ 委託者は、前2項の規定にかかわらず、受益者が第44条第3項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合または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。
- ⑥ 第1項および第2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円とします。
- ⑦ 前項の規定にかかわらず、受益者が第44条第3項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合または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38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項および第2項の取得申込者は、委託者、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(第44条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。)、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6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、日本債券インデックスマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、新興国債券インデックスマザーファンド、東証REIT指数マザーファンドおよびMUAMGR-EIT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. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

なお、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. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
 7. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、前各号に該当するものを除きます。）
 8. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
 9. 合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第2条第2項第3号で定めるものをいいます。）
 10. 外国法人の社員権で前号の権利の性質を有するもの
 11. 投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利（金融商品取引法第2条第2項第5号で定めるものをいいます。）
 12. 外国の法令に基づく権利であって、前号の権利に類するもの
- 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。）の時価総額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

（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、第30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27条、第29条、第33条から第35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27条、第29条、第33条から第35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52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の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債（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（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、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、為替先渡取引および直物為替先渡取引の運用指図）

第24条 委託者は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第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、為替先渡取引および直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額または価格情報会社の提供する価額で評価するものとします。
- ④ 委託者は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うにあたり担保の

提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第25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、投資信託証券（金融商品取引所に上場されているものに限り、以下本条において同じ。）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. 投資信託証券の貸付は、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
 3. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 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、信託財産において有しない有価証券または第27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27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28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)

第29条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- 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外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

(信託業務の委託等)

第30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31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32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33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34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35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36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37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38条 この信託の計算期間は、毎年1月27日から翌年1月26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計算期間は信託契約締結日から2017年1月26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39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40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41条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第38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応じて以下の率を乗じて得た額とします。

- 500億円未満の部分 年10,000分の50
500億円以上1,000億円未満の部分 年10,000分の48
1,000億円以上の部分 年10,000分の46

- 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42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43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44条第4項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第46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44条第5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なります。

（収益分配金、償還金および一部解約金の支払い）

第44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（第44条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、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ます。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 委託者は、第1項の規定にかかわらず、委託者の自らの募集に係る受益権に帰属する収益分配金（受益者が自己に帰属する受益権の全部もしくは一部の口数について、委託者に対し、この信託の収益分配金の再投資に係る受益権の取得申込みをしないことをあらかじめ申し出た場合において、委託者が当該申出を受け付けた受益権に帰属する収益分配金を除きます。）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ます。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。
- ④ 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（第44条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、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。
- ⑤ 一部解約金は、第46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。
- ⑥ 前各項（第2項および第3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、委託者ならびに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ます。
- ⑦ 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ます。

（委託者の自らの募集に係る受益権の口座管理機関）

第44条の2 委託者は、委託者の自らの募集に係る受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または登録等に関する業務を委任することができます。

（収益分配金および償還金の時効）

第45条 受益者が、収益分配金については第44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第44条第4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46条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者ならびに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。なお、委託者の自らの募集に係る受益権については、1口の整数倍をもって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

から当該基準価額に0.10%の率を乗じて得た信託財産留保額を控除した価額とします。

- 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、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・地域における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、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47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47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、対象インデックスが改廃されたときまたはやむを得ない事情が発生したときは、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 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48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52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49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52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50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51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52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52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であっても、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53条 第47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46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。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第54条 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55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56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57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られます。

(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44条第7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。

第5条 第24条に規定する「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、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の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

第6条 運用の基本方針における「最適化バランス(20%)指数」とは、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンが目標リスク水準(20%程度)に合わせ、下記の投資信託証券を参照して算出する指数です。指数は下記の投資信託証券におけるベンチマークの長期間にわたるデータを用いて期待収益率、リスク(標準偏差)等をそれぞれ推計した上で最適化(目標リスク水準に対してリターンが最大化される)を行い決定される資産クラス別比率に応じて、下記の投資信託証券の基準価額(分配金再投資)の騰落率を乗じることで算出されます。指数の資産クラス別比率の決定は、原則として年1回行われます。

eMAXIS TOPIXインデックス

eMAXIS 国内債券インデックス

eMAXIS 国内リートインデックス

eMAXIS 先進国株式インデックス

eMAXIS 先進国債券インデックス

eMAXIS 先進国リートインデックス

eMAXIS 新興国株式インデックス

eMAXIS 新興国債券インデックス

信託契約締結日 2016年3月30日

(付表)

1. 約款第13条第3項および第46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

香港取引所の休業日

香港の銀行の休業日

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

 **MUFG** 三菱UFJアセットマネジメント