

## 【表紙】

|  |  |
|--|--|
| 【提出書類】                                   | 有価証券届出書  |
| 【提出先】                                    | 関東財務局長殿  |
| 【提出日】                                    | 2019年4月26日提出   |
| 【発行者名】                                   | 三菱UFJ国際投信株式会社  |
| 【代表者の役職氏名】                               | 取締役社長 松田 通   |
| 【本店の所在の場所】                               | 東京都千代田区有楽町一丁目12番1号   |
| 【事務連絡者氏名】                                | 伊藤 晃   |
| 【電話番号】                                   | 03-6250-4740   |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券に係るファンドの名称】 | eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）<br>eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）<br>eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）<br>eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）<br>eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）  |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券の金額】        | eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）<br>1兆円を上限とします。<br>eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）<br>1兆円を上限とします。<br>eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）<br>1兆円を上限とします。<br>eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）<br>1兆円を上限とします。<br>eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）<br>1兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】                               | 該当事項はありません。  |

## 第一部【証券情報】

## (1)【ファンドの名称】

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<br>（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<br>（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<br>（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<br>（マイフォワード）    | マイフォワード    |                |
| eMAXIS 最適化バランス<br>（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国際投信株式会社

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

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

（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】

2019年 4月27日から2020年 4月24日まで

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

( 8 ) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社によっては、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国際投信株式会社

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

( 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經由して、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<br>(収益の源泉) | 独立区分 | 補足分類       |
|---------|--------|-------------------|------|------------|
| 単位型     | 国内     | 株式<br>債券          | MMF  | インデックス型    |
|         | 海外     | 不動産投信             | MRF  | 特殊型<br>( ) |
| 追加型     | 内外     | その他資産<br>( )      | ETF  |            |
|         |        | 資産複合              |      |            |

## 属性区分表

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

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容に

については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://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せん。

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

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

#### 属性区分の定義

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

|        |  |  |
|--------|--|--|
|        | 中小型株   | 信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。  |
| 債券     | 一般   | 次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。   |
|        | 公債   | 信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。  |
|        | 社債   | 信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。  |
|        | その他債券  | 信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。  |
|        | クレジット属性  | 目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（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（BBB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・特色 ]

## ファンドの目的

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

## ファンドの特色

特色

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

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

なお、各指数の資産クラス別比率の決定は、原則として年1回行います。

\*最適化バランス指数を算出するために参照したファンドは以下のとおりです。

<最適化バランス(6%)指数>

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

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

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

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

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

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

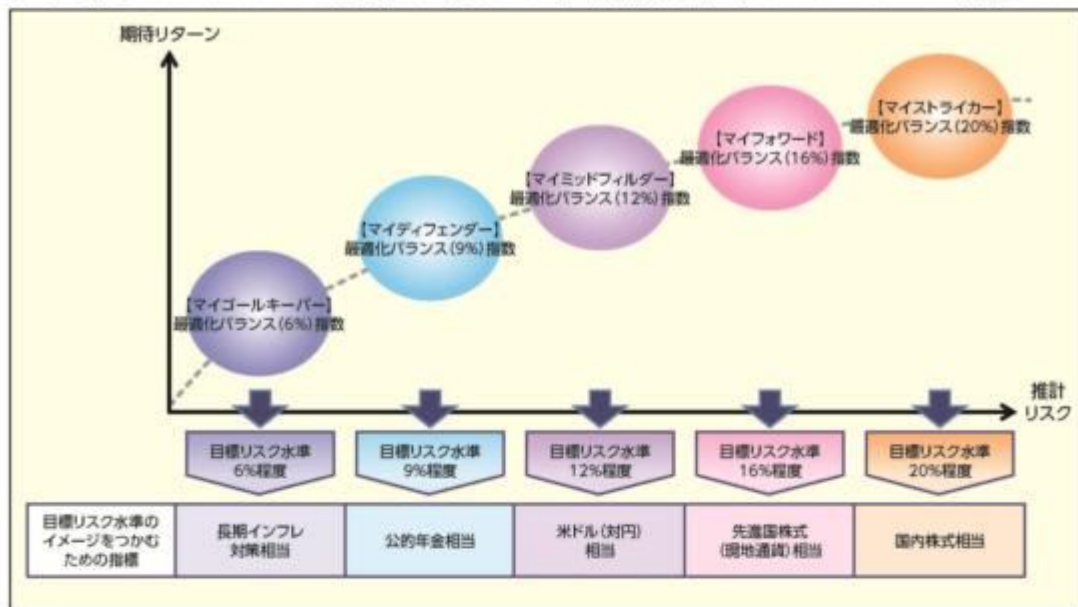
- 1 各ファンドの実際の基準価額の変動の大きさが、必ずしも目標リスク水準の順になることを保証するものではありません。

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

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

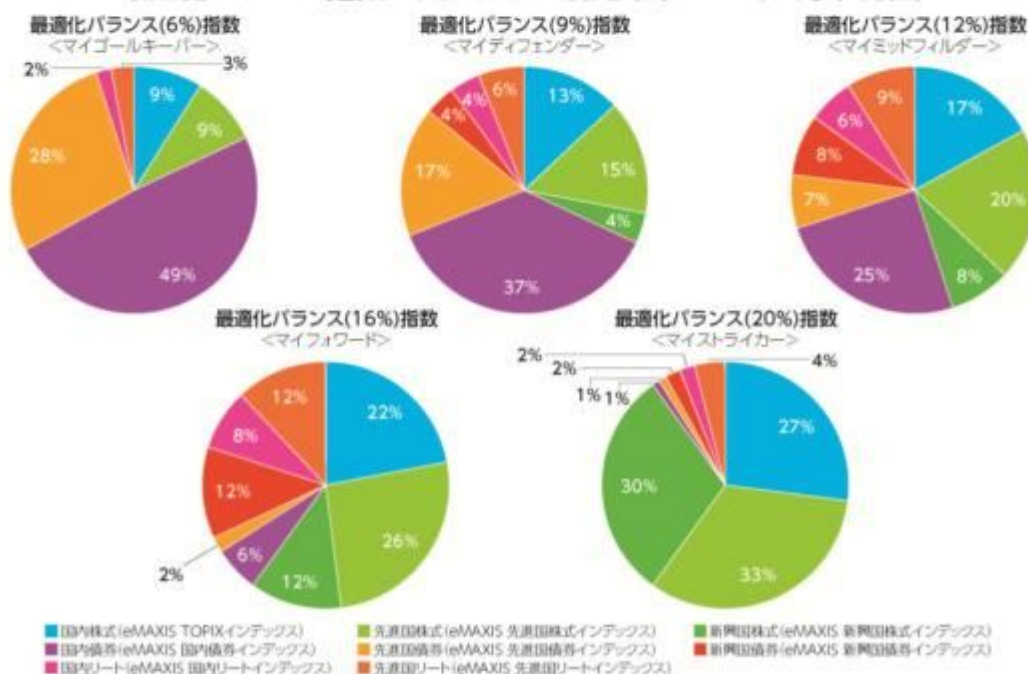


## <(ご参考)各ファンドおよび各指数の目標リスク水準(標準偏差)とリスク・リターン特性のイメージ>



- 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(2018年12月末)のリスク水準
  - ミドル(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(2019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。

特色2

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

#### ◆マイゴールキーパー

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

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

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

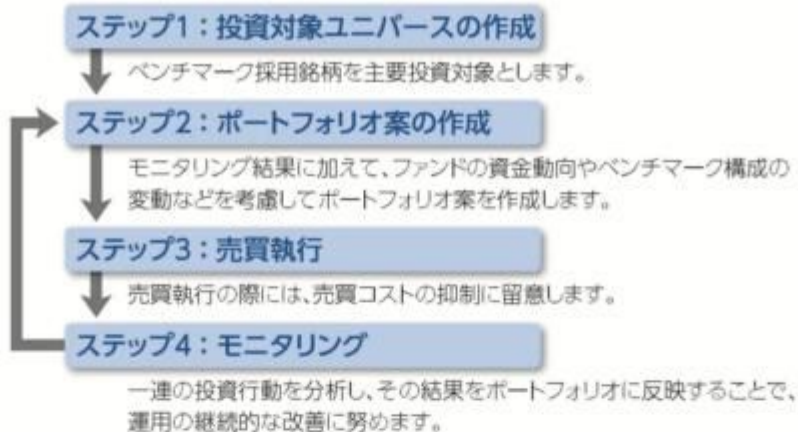
※実際の運用は各マザーファンドを通じて行います。

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 資金動向および取引コスト等を勘案し、上場投資信託証券に直接投資することがあります。

### <各マザーファンドの運用目標>

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

## &lt;各マザーファンドの運用プロセス&gt;



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

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

特色 **3**

原則として、為替ヘッジは行いません。

- 為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

## ■ ファンドの仕組み

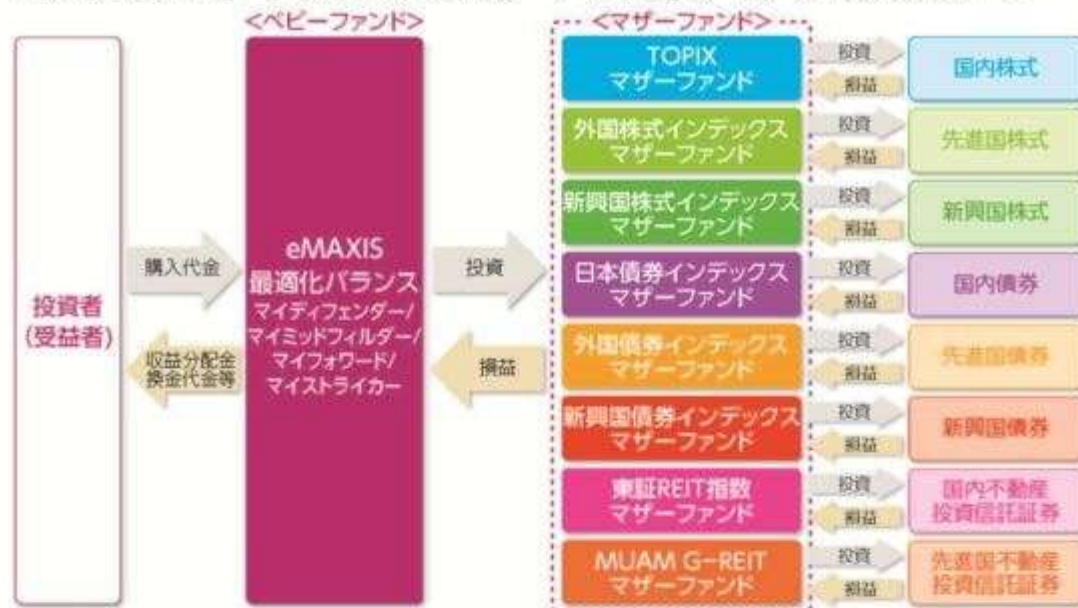
運用は主に各マザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債（マイゴールキーパーは、新興国株式、新興国債券を除く）および不動産投資信託証券へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。

<マイゴールキーパー>





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



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

## ■主な投資制限

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

## ■分配方針

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

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## ibbotson イボットソン・アソシエイツ・ジャパンについて

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社は、米国シカゴに本社があるモーニングスター・グループの日本人です。

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。



## 指数について

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

### <最適化バランス指数の名称と目標リスク水準>

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

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

・東証株価指数(TOPIX)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの高標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

・MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)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 Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)は、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(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 Kokusai Index(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(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(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、野村證券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)・データに基づき当社が計算したものです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

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

東証REIT指数の高標に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は東証REIT指数の内容の変更、公表の停止または高標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。東京証券取引所は東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対して、責任を負いません。

・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国際投信株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC([S&P])の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC([Dow Jones])の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスが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国際投信株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、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、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S&P先進国REITインデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任を負いません。

## (2)【ファンドの沿革】

2016年3月30日

設定日、信託契約締結、運用開始

## (3)【ファンドの仕組み】



## 委託会社およびファンドの関係法人の役割

|  |  |
|--|--|
| 投資家（受益者）   |  |
| お申込金 収益分配金、解約代金等   |  |
| 販売会社   | 募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。 |
| お申込金 収益分配金、解約代金等   |  |
| 受託会社（受託者）<br>三菱UFJ信託銀行株式会社<br>（再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社） | 委託会社（委託者）<br>三菱UFJ国際投信株式会社             |
| 信託財産の保管・管理等を行います。  | 信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。               |
| 投資 損益  |  |
| マザーファンド  |  |
| 投資 損益  |  |
| 有価証券等  |  |

## 委託会社と関係法人との契約の概要

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

## 委託会社の概況（2019年1月末現在）

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

| 株主名           | 住所                | 所有株式数    | 所有比率   |
|---------------|-------------------|----------|--------|
| 三菱UFJ信託銀行株式会社 | 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号 | 211,581株 | 100.0% |

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### 「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として各マザーファンドの対象インデックスに採用されている、日本を含む先進国の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を最適化バランス（6%）指数の変動率に連動させることを目的とした運用を行います。なお、各マザーファンドは、東証株価指数（TOPIX）、MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（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）、MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（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MUAMG-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）、MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、JPモルガンGBI EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）およびS&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）を対象インデックスとし、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を各対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行うものです。このほか、日本を含む世界各国の株式（DR（預託証書）を含みます。以下同じ。）、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に直接投資することがあります。

国内株式、先進国株式、新興国株式、国内債券、先進国債券、新興国債券、国内不動産投資信託証券および先進国不動産投資信託証券への実質的な投資割合は、目標リスク水準（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MUAMG-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）、MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、JPモルガンGBI EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）およびS&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）を対象インデックスとし、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を各対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行うものです。このほか、日本を含む世界各国の株式（DR（預託証書）を含みます。以下同じ。）、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に直接投資することがあります。

国内株式、先進国株式、新興国株式、国内債券、先進国債券、新興国債券、国内不動産投資信託証券および先進国不動産投資信託証券への実質的な投資割合は、目標リスク水準（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MUAMG-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）、MSCI Kokusa i Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、JPモルガンGBI EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）およびS&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）を対象インデックスとし、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を各対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行うものです。このほか、日本を含む世界各国の株式（DR（預託証書）を含みます。以下同じ。）、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に直接投資することがあります。

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

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

## （2）【投資対象】

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

有価証券の指図範囲

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

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

1．株券または新株引受権証書

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せん。）

19．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

20．外国法人が発行する譲渡性預金証書

21．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。

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

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）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）

##### 投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

##### 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）

株式への投資割合に制限を設けません。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

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

#### 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 Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（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）

###### 投資対象

MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（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。

###### 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）

株式への投資割合に制限を設けません。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

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

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

#### 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（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）

###### 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。

###### 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）

株式への投資割合に制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

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。

外国為替予約取引を行うことができます。

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

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

### 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 - B P I 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）

投資対象

NOMURA - B P I 総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。

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）

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスクおよ

び金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

#### 外国債券インデックスマザーファンド

##### （基本方針）

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

##### （運用方法）

###### 投資対象

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

###### 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、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）

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

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

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

#### 新興国債券インデックスマザーファンド

##### （基本方針）

この投資信託は、JPモルガン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。

##### （運用方法）

###### 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。

###### 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。

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）

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

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。

外国為替予約取引を行うことができます。

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

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

### 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）

##### 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。

##### 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）

株式への投資は行いません。

投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

外貨建資産への投資は行いません。

不動産投信指数先物取引を行うことができます。

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

### 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）



**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。

**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。

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）**

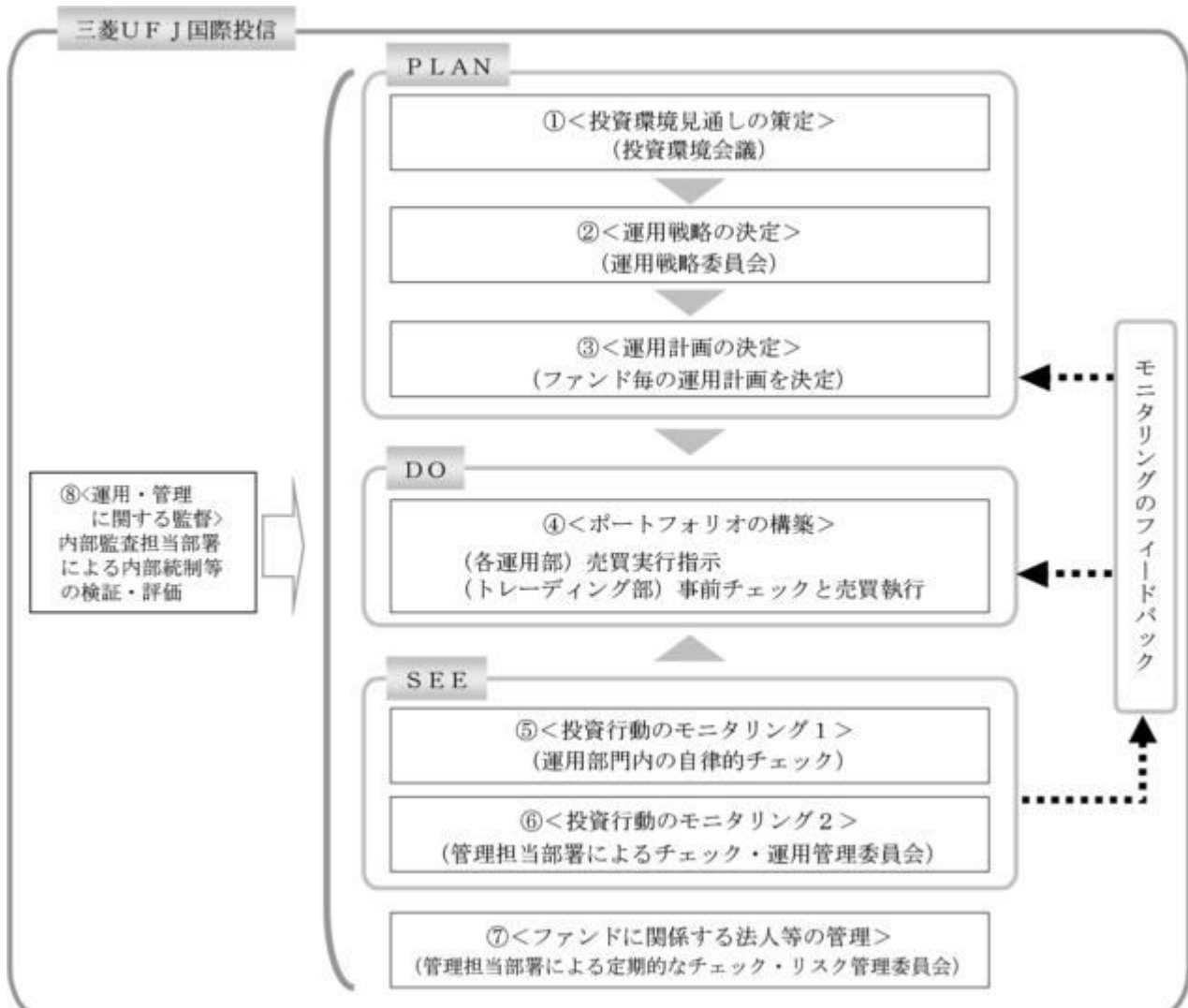
株式への直接投資は行いません。

投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

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

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

**（3）【運用体制】****投資環境見通しの策定**

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

#### 運用戦略の決定

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

#### 運用計画の決定

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

#### ポートフォリオの構築

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

#### 投資行動のモニタリング1

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、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

#### 投資行動のモニタリング2

運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、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、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、必要に応じて是正を指示します。

#### ファンドに関係する法人等の管理

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

#### 運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

「運用担当者に係る事項」 <https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>

#### （４）【配分方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

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

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

#### （５）【投資制限】

##### < 信託約款に定められた投資制限 >

##### 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。

##### 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。

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。

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。

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せん。))の行使により取得可能な株券
  6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(5. に定めるものを除きます。))の行使により取得可能な株券

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。

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。

## 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。

## 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。

## 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。

## 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。

## 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。

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。

#### 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。

#### 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。

#### 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。

#### 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。

#### 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。

（主なりスクであり、以下に限定されるものではありません。）

### 価格変動リスク

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。

### 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。

### 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。

### 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。

### 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。

- ・ 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小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・ 当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・ 当ファンドは、最適化バランス指数の動きに連動することをめざして運用を行います。信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因によりカイ離を生じることがあります。
- ・ 不動産投資信託証券および不動産投資信託証券が保有する不動産に係る法律、税制、会計などの制度変更が、不動産投資信託証券の価格や配当率に影響を及ぼすことがあります。不動産投資信託証券の投資口数が増加する場合、1口当たりの不動産投資信託証券の収益性が低下することがあります。

## (2) 投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っています。また、定期的開催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。この内容は運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

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。

### トレーディング担当部署

有価証券等の売買執行および発注に係る法令等の遵守および監視・牽制を行います。

### コンプライアンス担当部署

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

### リスク管理担当部署

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

### 内部監査担当部署

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

## <流動性リスクに対する管理体制>

流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立したリスク管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行い、この結果はリスク管理に関する会議体等に報告されます。

\* 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。



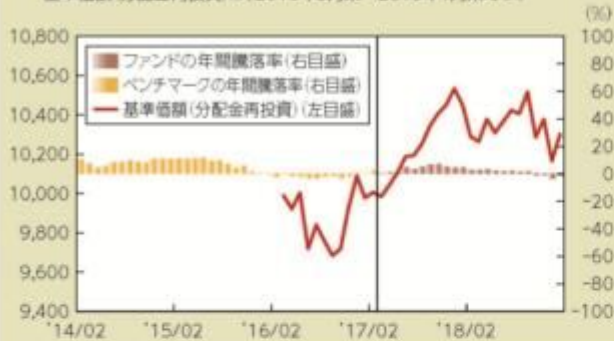
## ■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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

## ● ファンドの年間騰落率および基準価額（分配金再投資）の推移

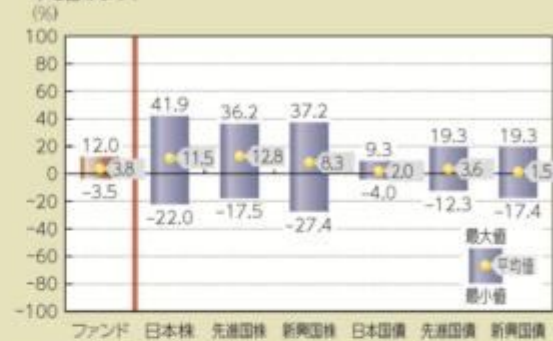
ファンドの年間騰落率は、2017年3月～2019年1月です。  
ベンチマークの年間騰落率は、2014年2月～2017年2月です。  
基準価額（分配金再投資）は、2016年3月末～2019年1月末です。



## ● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2014年2月末～2019年1月末)

ファンドの年間騰落率はベンチマーク(2017年2月以前)の年間騰落率を含みます。

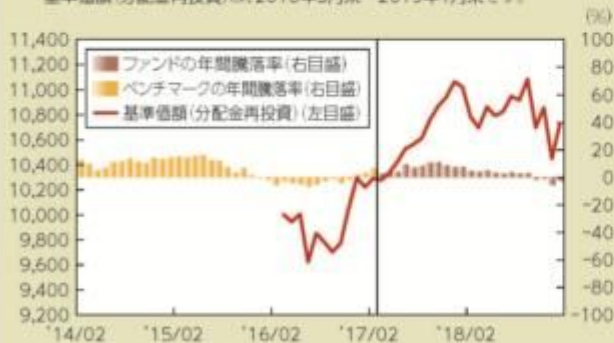


- 基準価額（分配金再投資）は分配金（税引前）を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

## マイディフェンダー

## ● ファンドの年間騰落率および基準価額（分配金再投資）の推移

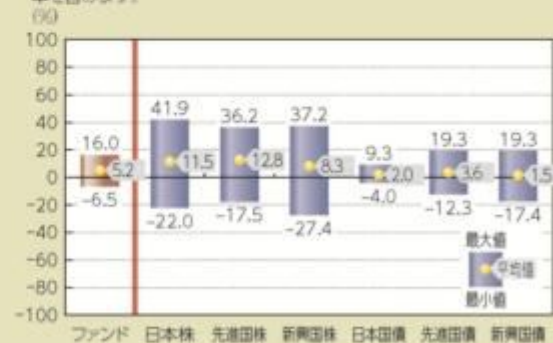
ファンドの年間騰落率は、2017年3月～2019年1月です。  
ベンチマークの年間騰落率は、2014年2月～2017年2月です。  
基準価額（分配金再投資）は、2016年3月末～2019年1月末です。



## ● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2014年2月末～2019年1月末)

ファンドの年間騰落率はベンチマーク(2017年2月以前)の年間騰落率を含みます。



- 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。

ベンチマークの年間騰落率は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

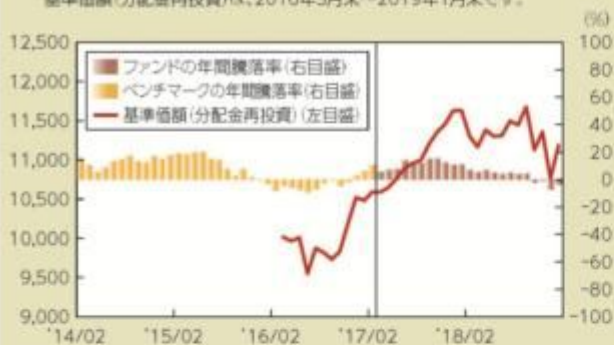
上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。



## マイミッドフィルダー

### ● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

ファンドの年間騰落率は、2017年3月～2019年1月です。  
ベンチマークの年間騰落率は、2014年2月～2017年2月です。  
基準価額(分配金再投資)は、2016年3月末～2019年1月末です。

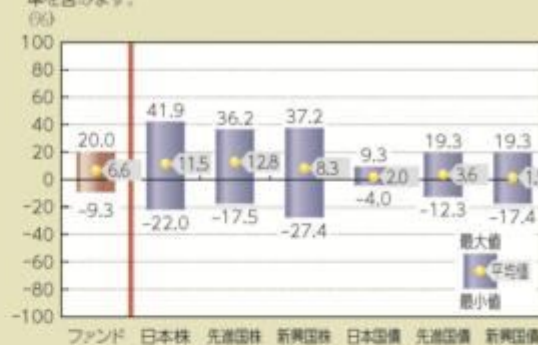


- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したのものとして計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

### ● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2014年2月末～2019年1月末)

ファンドの年間騰落率はベンチマーク(2017年2月以前)の年間騰落率を含みます。

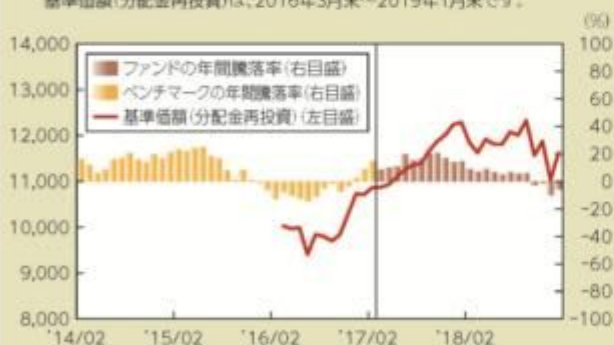


(注)全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## マイフォワード

### ● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

ファンドの年間騰落率は、2017年3月～2019年1月です。  
ベンチマークの年間騰落率は、2014年2月～2017年2月です。  
基準価額(分配金再投資)は、2016年3月末～2019年1月末です。



- 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のものとして計算しており、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。

### ● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2014年2月末～2019年1月末)

ファンドの年間騰落率はベンチマーク(2017年2月以前)の年間騰落率を含みます。



(注)全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

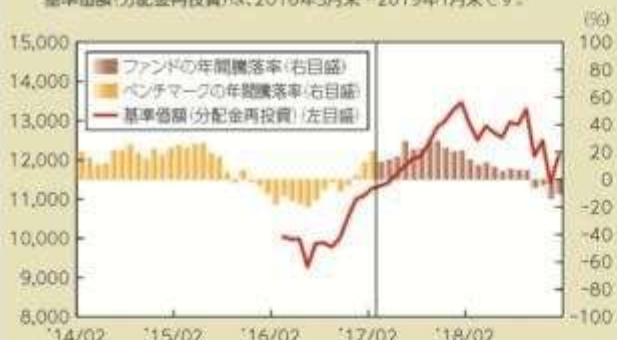
ベンチマークの年間騰落率は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

## マイストライカー

### ● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

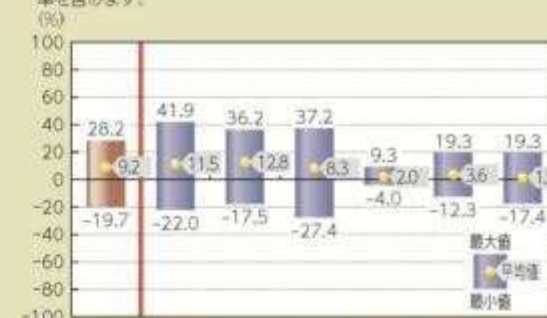
ファンドの年間騰落率は、2017年3月～2019年1月です。  
ベンチマークの年間騰落率は、2014年2月～2017年2月です。  
基準価額(分配金再投資)は、2016年3月末～2019年1月末です。



### ● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2014年2月末～2019年1月末)

ファンドの年間騰落率はベンチマーク(2017年2月以前)の年間騰落率を含みます。



ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債  
(注)全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

ベンチマークの年間騰落率は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

### 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   | TOPIX(配当込み)                   | TOPIX(配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数(TOPIX)に、現金配当による権利落ちの修正を加えた株価指数です。TOPIX(配当込み)に関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の停止またはTOPIX(配当込み)の商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。   |
| 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の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の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、野村證券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0.54%（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。消費税率が10%となった場合は、年0.55%（税抜0.5%）以内となります。

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（税抜）の合計ならびに配分（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（年率） |                 |       |
|---------------------|-----------|-----------------|-------|
|                     | 合計        | 委託会社および<br>販売会社 | 受託会社  |
| 500億円未満の部分          | 0.5%      | 0.44%           | 0.06% |
| 500億円以上1,000億円未満の部分 | 0.48%     | 0.43%           | 0.05% |
| 1,000億円以上の部分        | 0.46%     | 0.42%           | 0.04% |

委託会社および販売会社への配分（税抜）は、次の通りです。

| 各販売会社における取扱純資産総額に応じて | 委託会社                                      | 販売会社  |
|----------------------|---|-------|
| 50億円未満の部分            | 信託報酬率から<br>販売会社および<br>受託会社の配分率を<br>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% |

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

各支払先が信託報酬の対価として提供する役務の内容は以下の通りです。

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



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

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

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

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

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

##### １．収益分配金の課税

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

原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。

##### ２．解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。ファンドは「つみたてNISA（非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISA、ジュニアNISAおよびつみたてNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

い。

法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

- (\*) 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。

個別元本について

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

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

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

収益分配金について

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

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

上記は2019年1月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## 5【運用状況】

### 【eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）】

#### (1)【投資状況】

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国/地域 | 時価合計        | 投資比率(%) |
|--------------------------|------|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券                | 日本   | 901,025,086 | 97.89   |
| コール・ローン、その他資産<br>(負債控除後) |      | 19,401,629  | 2.11    |
| 純資産総額                    |      | 920,426,715 | 100.00  |

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

## （２）【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### a 評価額上位30銘柄

平成31年 1月31日現在

| 国/<br>地域 | 種類        | 銘柄名                | 数量          | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|-----------|--------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本       | 親投資信託受益証券 | 日本債券インデックスマザーファンド  | 327,028,504 | 1.3410          | 438,577,552     | 1.3415          | 438,708,738     | 47.66           |
| 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  | 127,284,362 | 2.0104          | 255,892,482     | 2.0123          | 256,134,321     | 27.83           |
| 日本       | 親投資信託受益証券 | TOPIXマザーファンド       | 49,267,007  | 1.6697          | 82,261,122      | 1.6826          | 82,896,665      | 9.01            |
| 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  | 29,820,507  | 2.5646          | 76,479,833      | 2.5738          | 76,752,020      | 8.34            |
| 日本       | 親投資信託受益証券 | MUAM G-REITマザーファンド | 16,785,069  | 1.6335          | 27,418,411      | 1.6718          | 28,061,278      | 3.05            |
| 日本       | 親投資信託受益証券 | 東証REIT指数マザーファンド    | 6,200,552   | 2.9481          | 18,279,848      | 2.9791          | 18,472,064      | 2.01            |

（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

平成31年 1月31日現在

| 種類        | 投資比率 (%) |
|-----------|----------|
| 親投資信託受益証券 | 97.89    |
| 合計        | 97.89    |

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

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## （３）【運用実績】

### 【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成31年1月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

|                        | 純資産総額       |             | 基準価額<br>(1万口当たりの純資産価額) |        |
|------------------------|-------------|-------------|------------------------|--------|
|                        | (分配落)       | (分配付)       | (分配落)                  | (分配付)  |
| 第1計算期間末日 (平成29年 1月26日) | 79,528,322  | 79,528,322  | 9,992                  | 9,992  |
| 第2計算期間末日 (平成30年 1月26日) | 578,287,926 | 578,287,926 | 10,536                 | 10,536 |
| 第3計算期間末日 (平成31年 1月28日) | 913,675,754 | 913,675,754 | 10,279                 | 10,279 |
| 平成30年 1月末日             | 593,940,655 |             | 10,451                 |        |
| 2月末日                   | 609,225,427 |             | 10,290                 |        |
| 3月末日                   | 662,484,819 |             | 10,264                 |        |
| 4月末日                   | 649,140,524 |             | 10,378                 |        |
| 5月末日                   | 660,717,703 |             | 10,310                 |        |
| 6月末日                   | 674,999,000 |             | 10,366                 |        |
| 7月末日                   | 678,848,709 |             | 10,423                 |        |
| 8月末日                   | 763,985,517 |             | 10,407                 |        |
| 9月末日                   | 777,502,194 |             | 10,517                 |        |
| 10月末日                  | 781,315,255 |             | 10,287                 |        |
| 11月末日                  | 823,644,897 |             | 10,378                 |        |
| 12月末日                  | 834,863,034 |             | 10,166                 |        |
| 平成31年 1月末日             | 920,426,715 |             | 10,302                 |        |

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

|        | 収益率(%) |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 0.08   |
| 第2計算期間 | 5.44   |
| 第3計算期間 | 2.43   |

(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 |

## 【eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)】

## (1) 【投資状況】

平成31年 1月31日現在

(単位:円)

| 資産の種類                    | 国/地域 | 時価合計        | 投資比率(%) |
|--------------------------|------|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券                | 日本   | 805,570,776 | 97.89   |
| コール・ローン、その他資産<br>(負債控除後) |      | 17,399,634  | 2.11    |
| 純資産総額                    |      | 822,970,410 | 100.00  |

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

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## a 評価額上位30銘柄

平成31年 1月31日現在

| 国/地域 | 種類        | 銘柄名                | 数量          | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|-----------|--------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 日本債券インデックスマザーファンド  | 218,966,447 | 1.3410          | 293,655,713     | 1.3415          | 293,743,488     | 35.69           |
| 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  | 68,969,517  | 2.0103          | 138,656,316     | 2.0123          | 138,787,359     | 16.86           |
| 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  | 45,536,623  | 2.5650          | 116,802,621     | 2.5738          | 117,202,160     | 14.24           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | TOPIXマザーファンド       | 63,627,316  | 1.6697          | 106,238,530     | 1.6826          | 107,059,321     | 13.01           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | MUAM G-REITマザーファンド | 30,015,982  | 1.6334          | 49,028,105      | 1.6718          | 50,180,718      | 6.10            |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 東証REIT指数マザーファンド    | 11,088,032  | 2.9481          | 32,688,628      | 2.9791          | 33,032,356      | 4.01            |
| 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 | 24,660,886  | 1.3254          | 32,685,539      | 1.3299          | 32,796,512      | 3.99            |
| 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 | 13,730,354  | 2.3803          | 32,682,362      | 2.3866          | 32,768,862      | 3.98            |

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

## b 全銘柄の種類/業種別投資比率

平成31年 1月31日現在

| 種類        | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 97.89   |



|    |       |
|----|-------|
| 合計 | 97.89 |
|----|-------|

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### （3）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成31年1月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

|                      | 純資産総額       |             | 基準価額<br>（1万口当たりの純資産価額） |        |
|----------------------|-------------|-------------|------------------------|--------|
|                      | （分配落）       | （分配付）       | （分配落）                  | （分配付）  |
| 第1計算期間末日（平成29年1月26日） | 104,038,196 | 104,038,196 | 10,247                 | 10,247 |
| 第2計算期間末日（平成30年1月26日） | 546,855,605 | 546,855,605 | 11,145                 | 11,145 |
| 第3計算期間末日（平成31年1月28日） | 815,892,066 | 815,892,066 | 10,692                 | 10,692 |
| 平成30年1月末日            | 550,936,808 |             | 11,024                 |        |
| 2月末日                 | 591,269,813 |             | 10,785                 |        |
| 3月末日                 | 613,362,793 |             | 10,697                 |        |
| 4月末日                 | 634,933,164 |             | 10,864                 |        |
| 5月末日                 | 636,384,984 |             | 10,794                 |        |
| 6月末日                 | 655,194,263 |             | 10,827                 |        |
| 7月末日                 | 686,805,603 |             | 10,949                 |        |
| 8月末日                 | 727,444,594 |             | 10,919                 |        |
| 9月末日                 | 765,354,648 |             | 11,087                 |        |
| 10月末日                | 756,264,766 |             | 10,700                 |        |
| 11月末日                | 784,141,436 |             | 10,858                 |        |
| 12月末日                | 769,803,195 |             | 10,451                 |        |
| 平成31年1月末日            | 822,970,410 |             | 10,733                 |        |

#### 【分配の推移】

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

|        |    |
|--------|----|
| 第3計算期間 | 0円 |
|--------|----|

## 【収益率の推移】

|        | 収益率（％） |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 2.47   |
| 第2計算期間 | 8.76   |
| 第3計算期間 | 4.06   |

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

## （４）【設定及び解約の実績】

|        | 設定口数        | 解約口数        | 発行済口数       |
|--------|-------------|-------------|-------------|
| 第1計算期間 | 160,337,325 | 58,805,087  | 101,532,238 |
| 第2計算期間 | 549,171,328 | 160,032,694 | 490,670,872 |
| 第3計算期間 | 529,756,983 | 257,351,087 | 763,076,768 |

## 【eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）】

## （１）【投資状況】

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計          | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券                | 日本   | 2,509,974,891 | 96.95   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） |      | 78,899,996    | 3.05    |
| 純資産総額                    |      | 2,588,874,887 | 100.00  |

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

## （２）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## a 評価額上位30銘柄

平成31年 1月31日現在

| 国／地域 | 種類        | 銘柄名               | 数量          | 簿価<br>単価<br>（円） | 簿価<br>金額<br>（円） | 評価<br>単価<br>（円） | 評価<br>金額<br>（円） | 投資<br>比率<br>（％） |
|------|-----------|-------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 日本債券インデックスマザーファンド | 456,833,230 | 1.3410          | 612,659,044     | 1.3415          | 612,841,778     | 23.67           |

|    |           |                    |             |        |             |        |             |       |
|----|-----------|--------------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|-------|
| 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  | 184,398,340 | 2.5649 | 472,974,691 | 2.5738 | 474,604,447 | 18.33 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | TOPIXマザーファンド       | 261,170,490 | 1.6697 | 436,076,368 | 1.6826 | 439,445,466 | 16.97 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | MUAM G-REITマザーファンド | 141,326,988 | 1.6334 | 230,843,503 | 1.6718 | 236,270,458 | 9.13  |
| 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 | 154,821,601 | 1.3253 | 205,185,068 | 1.3299 | 205,897,247 | 7.95  |
| 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 | 86,199,120  | 2.3803 | 205,179,766 | 2.3866 | 205,722,819 | 7.95  |
| 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  | 89,283,750  | 2.0103 | 179,487,123 | 2.0123 | 179,665,690 | 6.94  |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 東証REIT指数マザーファンド    | 52,206,031  | 2.9481 | 153,908,600 | 2.9791 | 155,526,986 | 6.01  |

(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

平成31年 1月31日現在

| 種類        | 投資比率 (%) |
|-----------|----------|
| 親投資信託受益証券 | 96.95    |
| 合計        | 96.95    |

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成31年1月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位: 円)

|                        | 純資産総額         |               | 基準価額<br>(1万口当たりの純資産価額) |        |
|------------------------|---------------|---------------|------------------------|--------|
|                        | (分配落)         | (分配付)         | (分配落)                  | (分配付)  |
| 第1計算期間末日 (平成29年 1月26日) | 239,586,416   | 239,586,416   | 10,516                 | 10,516 |
| 第2計算期間末日 (平成30年 1月26日) | 1,592,675,860 | 1,592,675,860 | 11,791                 | 11,791 |
| 第3計算期間末日 (平成31年 1月28日) | 2,562,665,122 | 2,562,665,122 | 11,125                 | 11,125 |
| 平成30年 1月末日             | 1,603,491,606 |               | 11,632                 |        |
| 2月末日                   | 1,675,027,877 |               | 11,309                 |        |
| 3月末日                   | 1,785,037,461 |               | 11,164                 |        |

|            |               |  |        |
|------------|---------------|--|--------|
| 4月末日       | 1,842,913,944 |  | 11,381 |
| 5月末日       | 1,983,251,608 |  | 11,301 |
| 6月末日       | 2,090,934,739 |  | 11,310 |
| 7月末日       | 2,174,651,268 |  | 11,496 |
| 8月末日       | 2,280,098,245 |  | 11,445 |
| 9月末日       | 2,314,747,729 |  | 11,675 |
| 10月末日      | 2,276,129,283 |  | 11,128 |
| 11月末日      | 2,403,520,313 |  | 11,356 |
| 12月末日      | 2,372,679,829 |  | 10,762 |
| 平成31年 1月末日 | 2,588,874,887 |  | 11,184 |

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

|        | 収益率（％） |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 5.16   |
| 第2計算期間 | 12.12  |
| 第3計算期間 | 5.64   |

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

## （４）【設定及び解約の実績】

|        | 設定口数          | 解約口数        | 発行済口数         |
|--------|---------------|-------------|---------------|
| 第1計算期間 | 260,488,787   | 32,652,572  | 227,836,215   |
| 第2計算期間 | 1,456,517,138 | 333,642,454 | 1,350,710,899 |
| 第3計算期間 | 1,396,610,241 | 443,890,186 | 2,303,430,954 |

## 【eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）】

## （１）【投資状況】

平成31年 1月31日現在  
（単位：円）

| 資産の種類                    | 国/地域 | 時価合計          | 投資比率(%) |
|--------------------------|------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券                | 日本   | 1,433,981,634 | 97.01   |
| コール・ローン、その他資産<br>(負債控除後) |      | 44,197,051    | 2.99    |
| 純資産総額                    |      | 1,478,178,685 | 100.00  |

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

## (2) 【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### a 評価額上位30銘柄

平成31年 1月31日現在

| 国/地域 | 種類        | 銘柄名                | 数量          | 簿価単価<br>(円) | 簿価金額<br>(円) | 評価単価<br>(円) | 評価金額<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|------|-----------|--------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックスマザーファンド  | 138,455,808 | 2.5651      | 355,161,972 | 2.5738      | 356,357,558 | 24.11       |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | TOPIXマザーファンド       | 193,025,709 | 1.6697      | 322,295,027 | 1.6826      | 324,785,057 | 21.97       |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | MUAM G-REITマザーファンド | 107,618,910 | 1.6334      | 175,784,728 | 1.6718      | 179,917,293 | 12.17       |
| 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 | 73,846,697  | 2.3803      | 175,777,293 | 2.3866      | 176,242,527 | 11.92       |
| 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 | 132,433,270 | 1.3253      | 175,527,055 | 1.3299      | 176,123,005 | 11.91       |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 東証REIT指数マザーファンド    | 39,787,313  | 2.9481      | 117,296,978 | 2.9791      | 118,530,384 | 8.02        |
| 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  | 54,300,368  | 1.3410      | 72,822,222  | 1.3415      | 72,843,943  | 4.93        |
| 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  | 14,501,748  | 2.0103      | 29,154,314  | 2.0123      | 29,181,867  | 1.97        |

(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

平成31年 1月31日現在

| 種類        | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 97.01   |
| 合計        | 97.01   |

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

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## （ 3 ） 【運用実績】

## 【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成31年1月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

|                        | 純資産総額         |               | 基準価額<br>(1万口当たりの純資産価額) |        |
|------------------------|---------------|---------------|------------------------|--------|
|                        | (分配落)         | (分配付)         | (分配落)                  | (分配付)  |
| 第1計算期間末日 (平成29年 1月26日) | 188,359,324   | 188,359,324   | 10,764                 | 10,764 |
| 第2計算期間末日 (平成30年 1月26日) | 973,394,215   | 973,394,215   | 12,500                 | 12,500 |
| 第3計算期間末日 (平成31年 1月28日) | 1,462,678,215 | 1,462,678,215 | 11,535                 | 11,535 |
| 平成30年 1月末日             | 955,871,259   |               | 12,286                 |        |
| 2月末日                   | 999,736,160   |               | 11,839                 |        |
| 3月末日                   | 995,359,374   |               | 11,621                 |        |
| 4月末日                   | 1,046,304,612 |               | 11,915                 |        |
| 5月末日                   | 1,089,627,240 |               | 11,812                 |        |
| 6月末日                   | 1,139,417,457 |               | 11,803                 |        |
| 7月末日                   | 1,218,033,598 |               | 12,073                 |        |
| 8月末日                   | 1,251,765,749 |               | 12,007                 |        |
| 9月末日                   | 1,335,935,753 |               | 12,325                 |        |
| 10月末日                  | 1,298,692,758 |               | 11,562                 |        |
| 11月末日                  | 1,379,069,170 |               | 11,873                 |        |
| 12月末日                  | 1,338,546,447 |               | 11,027                 |        |
| 平成31年 1月末日             | 1,478,178,685 |               | 11,615                 |        |

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

|        | 収益率(%) |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 7.64   |
| 第2計算期間 | 16.12  |
| 第3計算期間 | 7.72   |

（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 |

#### 【eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）】

##### （１）【投資状況】

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計          | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券                | 日本   | 2,915,200,553 | 96.03   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） |      | 120,587,539   | 3.97    |
| 純資産総額                    |      | 3,035,788,092 | 100.00  |

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

##### （２）【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### a 評価額上位30銘柄

平成31年 1月31日現在

| 国／地域 | 種類        | 銘柄名                | 数量          | 簿価<br>単価<br>（円） | 簿価<br>金額<br>（円） | 評価<br>単価<br>（円） | 評価<br>金額<br>（円） | 投資<br>比率<br>（％） |
|------|-----------|--------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックスマザーファンド  | 366,829,108 | 2.5651          | 940,979,932     | 2.5738          | 944,144,758     | 31.10           |
| 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 | 379,356,121 | 2.3803          | 902,981,375     | 2.3866          | 905,371,318     | 29.82           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | TOPIXマザーファンド       | 486,814,043 | 1.6697          | 812,833,408     | 1.6826          | 819,113,308     | 26.98           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | MUAM G-REITマザーファンド | 73,712,206  | 1.6334          | 120,401,518     | 1.6718          | 123,232,065     | 4.06            |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 東証REIT指数マザーファンド    | 20,421,662  | 2.9481          | 60,205,102      | 2.9791          | 60,838,173      | 2.00            |
| 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 | 24,509,423  | 1.3254          | 32,487,050      | 1.3299          | 32,595,081      | 1.07            |
| 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  | 7,440,378   | 2.0103          | 14,958,134      | 2.0123          | 14,972,272      | 0.49            |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 日本債券インデックスマザーファンド  | 11,132,000  | 1.3410          | 14,929,124      | 1.3415          | 14,933,578      | 0.49            |



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

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成31年 1月31日現在

| 種類        | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 96.03   |
| 合計        | 96.03   |

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

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## （3）【運用実績】

### 【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成31年1月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

|                        | 純資産総額         |               | 基準価額<br>(1万口当たりの純資産価額) |        |
|------------------------|---------------|---------------|------------------------|--------|
|                        | (分配落)         | (分配付)         | (分配落)                  | (分配付)  |
| 第1計算期間末日 (平成29年 1月26日) | 182,414,441   | 182,414,441   | 11,152                 | 11,152 |
| 第2計算期間末日 (平成30年 1月26日) | 2,145,447,863 | 2,145,447,863 | 13,714                 | 13,714 |
| 第3計算期間末日 (平成31年 1月28日) | 3,008,888,114 | 3,008,888,114 | 12,038                 | 12,038 |
| 平成30年 1月末日             | 2,178,431,627 |               | 13,463                 |        |
| 2月末日                   | 2,351,101,132 |               | 12,912                 |        |
| 3月末日                   | 2,312,652,462 |               | 12,510                 |        |
| 4月末日                   | 2,534,539,155 |               | 12,864                 |        |
| 5月末日                   | 2,572,068,238 |               | 12,702                 |        |
| 6月末日                   | 2,586,742,877 |               | 12,567                 |        |
| 7月末日                   | 2,753,982,226 |               | 12,961                 |        |
| 8月末日                   | 2,830,132,806 |               | 12,903                 |        |
| 9月末日                   | 2,923,812,912 |               | 13,290                 |        |
| 10月末日                  | 2,781,020,865 |               | 12,094                 |        |
| 11月末日                  | 2,977,293,886 |               | 12,496                 |        |
| 12月末日                  | 2,773,073,280 |               | 11,412                 |        |
| 平成31年 1月末日             | 3,035,788,092 |               | 12,099                 |        |

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

|        | 収益率（％） |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 11.52  |
| 第2計算期間 | 22.97  |
| 第3計算期間 | 12.22  |

（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 |

## （参考）

## TOPIXマザーファンド

## 投資状況

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計            | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|-----------------|---------|
| 株式                       | 日本   | 220,221,128,160 | 99.28   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） |      | 1,591,982,974   | 0.72    |
| 純資産総額                    |      | 221,813,111,134 | 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

| 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   | 1,615,040,000 | 0.73    |

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### a 評価額上位30銘柄

平成31年 1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  | 1,095,800  | 6,811.47  | 7,464,013,778 | 6,675.00  | 7,314,465,000 | 3.30    |
| 日本   | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業    | 6,754,200  | 684.59    | 4,623,864,175 | 583.60    | 3,941,751,120 | 1.78    |
| 日本   | 株式 | ソニー               | 電気機器   | 659,500    | 5,391.86  | 3,555,932,918 | 5,467.00  | 3,605,486,500 | 1.63    |
| 日本   | 株式 | ソフトバンクグループ        | 情報・通信業 | 403,200    | 8,518.63  | 3,434,713,290 | 8,526.00  | 3,437,683,200 | 1.55    |
| 日本   | 株式 | 日本電信電話            | 情報・通信業 | 659,900    | 4,945.25  | 3,263,373,404 | 4,671.00  | 3,082,392,900 | 1.39    |
| 日本   | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ   | 銀行業    | 683,500    | 4,446.74  | 3,039,349,004 | 4,045.00  | 2,764,757,500 | 1.25    |
| 日本   | 株式 | 武田薬品工業            | 医薬品    | 623,300    | 4,887.94  | 3,046,653,220 | 4,389.00  | 2,735,663,700 | 1.23    |
| 日本   | 株式 | キーエンス             | 電気機器   | 48,300     | 63,599.40 | 3,071,851,380 | 55,860.00 | 2,698,038,000 | 1.22    |
| 日本   | 株式 | 本田技研工業            | 輸送用機器  | 829,500    | 3,457.22  | 2,867,764,464 | 3,249.00  | 2,695,045,500 | 1.22    |
| 日本   | 株式 | みずほフィナンシャルグループ    | 銀行業    | 13,178,300 | 191.77    | 2,527,332,844 | 179.40    | 2,364,187,020 | 1.07    |
| 日本   | 株式 | KDDI              | 情報・通信業 | 850,300    | 2,777.46  | 2,361,678,288 | 2,723.00  | 2,315,366,900 | 1.04    |
| 日本   | 株式 | 三菱商事              | 卸売業    | 679,600    | 2,965.03  | 2,015,038,764 | 3,181.00  | 2,161,807,600 | 0.97    |
| 日本   | 株式 | 東海旅客鉄道            | 陸運業    | 88,000     | 20,629.63 | 1,815,407,732 | 23,490.00 | 2,067,120,000 | 0.93    |
| 日本   | 株式 | 任天堂               | その他製品  | 60,500     | 44,562.91 | 2,696,056,223 | 33,830.00 | 2,046,715,000 | 0.92    |
| 日本   | 株式 | リクルートホールディングス     | サービス業  | 673,100    | 2,785.84  | 1,875,150,676 | 2,912.50  | 1,960,403,750 | 0.88    |
| 日本   | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス   | 小売業    | 405,900    | 4,553.53  | 1,848,281,360 | 4,739.00  | 1,923,560,100 | 0.87    |
| 日本   | 株式 | 東京海上ホールディングス      | 保険業    | 351,500    | 5,006.15  | 1,759,662,033 | 5,312.00  | 1,867,168,000 | 0.84    |
| 日本   | 株式 | 花王                | 化学     | 238,700    | 7,818.48  | 1,866,271,748 | 7,672.00  | 1,831,306,400 | 0.83    |
| 日本   | 株式 | NTTドコモ            | 情報・通信業 | 692,800    | 2,745.31  | 1,901,954,928 | 2,605.50  | 1,805,090,400 | 0.81    |
| 日本   | 株式 | 東日本旅客鉄道           | 陸運業    | 174,800    | 9,912.37  | 1,732,683,180 | 10,080.00 | 1,761,984,000 | 0.79    |
| 日本   | 株式 | ファナック             | 電気機器   | 93,400     | 24,665.12 | 2,303,723,030 | 18,360.00 | 1,714,824,000 | 0.77    |
| 日本   | 株式 | キヤノン              | 電気機器   | 529,300    | 3,726.22  | 1,972,290,486 | 3,114.00  | 1,648,240,200 | 0.74    |
| 日本   | 株式 | 村田製作所             | 電気機器   | 103,200    | 15,123.61 | 1,560,757,264 | 15,420.00 | 1,591,344,000 | 0.72    |
| 日本   | 株式 | ダイキン工業            | 機械     | 134,200    | 12,280.93 | 1,648,101,968 | 11,765.00 | 1,578,863,000 | 0.71    |
| 日本   | 株式 | 日本たばこ産業           | 食料品    | 569,900    | 2,929.12  | 1,669,307,228 | 2,750.00  | 1,567,225,000 | 0.71    |

|    |    |         |      |         |           |               |           |               |      |
|----|----|---------|------|---------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 日本 | 株式 | 信越化学工業  | 化学   | 169,700 | 10,597.09 | 1,798,327,594 | 9,176.00  | 1,557,167,200 | 0.70 |
| 日本 | 株式 | 日本電産    | 電気機器 | 118,300 | 15,960.79 | 1,888,161,868 | 13,030.00 | 1,541,449,000 | 0.69 |
| 日本 | 株式 | 日立製作所   | 電気機器 | 442,700 | 3,785.59  | 1,675,885,034 | 3,413.00  | 1,510,935,100 | 0.68 |
| 日本 | 株式 | アステラス製薬 | 医薬品  | 906,600 | 1,665.10  | 1,509,583,536 | 1,609.50  | 1,459,172,700 | 0.66 |
| 日本 | 株式 | 三井物産    | 卸売業  | 797,900 | 1,841.32  | 1,469,192,347 | 1,772.50  | 1,414,277,750 | 0.64 |

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

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成31年 1月31日現在

| 種類         | 業種       | 投資比率 (%) |
|------------|----------|----------|
| 株式         | 水産・農林業   | 0.12     |
|            | 鉱業       | 0.29     |
|            | 建設業      | 2.96     |
|            | 食料品      | 4.30     |
|            | 繊維製品     | 0.65     |
|            | パルプ・紙    | 0.29     |
|            | 化学       | 7.13     |
|            | 医薬品      | 5.31     |
|            | 石油・石炭製品  | 0.69     |
|            | ゴム製品     | 0.79     |
|            | ガラス・土石製品 | 0.91     |
|            | 鉄鋼       | 1.00     |
|            | 非鉄金属     | 0.80     |
|            | 金属製品     | 0.58     |
|            | 機械       | 4.89     |
|            | 電気機器     | 12.77    |
|            | 輸送用機器    | 8.23     |
|            | 精密機器     | 1.89     |
|            | その他製品    | 2.09     |
|            | 電気・ガス業   | 1.96     |
|            | 陸運業      | 4.72     |
|            | 海運業      | 0.17     |
|            | 空運業      | 0.61     |
|            | 倉庫・運輸関連業 | 0.19     |
|            | 情報・通信業   | 8.08     |
|            | 卸売業      | 5.03     |
|            | 小売業      | 4.88     |
| 銀行業        | 6.49     |          |
| 証券、商品先物取引業 | 0.84     |          |
| 保険業        | 2.27     |          |
| その他金融業     | 1.15     |          |
| 不動産業       | 2.44     |          |

|       |       |
|-------|-------|
| サービス業 | 4.74  |
| 小計    | 99.28 |
| 合計    | 99.28 |

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

#### 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

平成31年 1月31日現在

| 資産の種類    | 取引所名  | 資産の名称         | 建別 | 数量  | 通貨 | 簿価金額（円）       | 評価金額（円）       | 投資比率（％） |
|----------|-------|---------------|----|-----|----|---------------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 大阪取引所 | TOPIX 19年03月限 | 買建 | 103 | 円  | 1,601,545,620 | 1,615,040,000 | 0.73    |

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

#### 外国株式インデックスマザーファンド

#### 投資状況

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類  | 国/地域        | 時価合計            | 投資比率（％） |
|--------|-------------|-----------------|---------|
| 株式     | アメリカ        | 206,168,054,051 | 63.29   |
|        | イギリス        | 19,819,705,732  | 6.08    |
|        | カナダ         | 11,956,956,970  | 3.67    |
|        | フランス        | 11,728,600,003  | 3.60    |
|        | ドイツ         | 10,384,564,773  | 3.19    |
|        | スイス         | 10,239,619,076  | 3.14    |
|        | オーストラリア     | 7,658,875,429   | 2.35    |
|        | オランダ        | 4,919,858,436   | 1.51    |
|        | 香港          | 4,049,738,367   | 1.24    |
|        | スペイン        | 3,685,612,467   | 1.13    |
|        | スウェーデン      | 3,198,966,470   | 0.98    |
|        | イタリア        | 2,244,405,065   | 0.69    |
|        | デンマーク       | 2,042,204,509   | 0.63    |
|        | シンガポール      | 1,473,186,718   | 0.45    |
|        | フィンランド      | 1,279,163,925   | 0.39    |
|        | ベルギー        | 1,156,506,928   | 0.36    |
| ノルウェー  | 873,727,477 | 0.27            |         |
| アイルランド | 628,342,056 | 0.19            |         |

|                          |          |                 |        |
|--------------------------|----------|-----------------|--------|
|                          | ルクセンブルグ  | 377,621,960     | 0.12   |
|                          | イスラエル    | 335,581,389     | 0.10   |
|                          | オーストリア   | 288,765,738     | 0.09   |
|                          | ニュージーランド | 266,413,675     | 0.08   |
|                          | ポルトガル    | 181,330,098     | 0.06   |
|                          | 小計       | 304,957,801,312 | 93.62  |
| 投資証券                     | アメリカ     | 6,384,271,697   | 1.96   |
|                          | オーストラリア  | 598,900,235     | 0.18   |
|                          | イギリス     | 249,643,919     | 0.08   |
|                          | オランダ     | 225,055,535     | 0.07   |
|                          | 香港       | 206,265,805     | 0.06   |
|                          | フランス     | 194,796,198     | 0.06   |
|                          | シンガポール   | 144,151,826     | 0.04   |
|                          | カナダ      | 67,422,299      | 0.02   |
|                          | 小計       | 8,070,507,514   | 2.48   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） |          | 12,703,304,583  | 3.90   |
| 純資産総額                    |          | 325,731,613,409 | 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

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類    | 建別 | 国/地域    | 時価合計          | 投資比率（%） |
|----------|----|---------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ    | 8,695,484,700 | 2.67    |
|          | 買建 | カナダ     | 475,008,486   | 0.15    |
|          | 買建 | ドイツ     | 1,788,633,788 | 0.55    |
|          | 買建 | オーストラリア | 575,124,900   | 0.18    |
|          | 買建 | イギリス    | 805,193,096   | 0.25    |
|          | 買建 | スイス     | 409,007,684   | 0.13    |

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

#### 投資資産

##### 投資有価証券の主要銘柄

###### a 評価額上位30銘柄

平成31年 1月31日現在

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



|      |    |                             |                        |         |            |               |            |               |      |
|------|----|-----------------------------|------------------------|---------|------------|---------------|------------|---------------|------|
| 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     | 396,389 | 20,888.42  | 8,279,943,246 | 18,005.64  | 7,137,237,634 | 2.19 |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP              | ソフトウェア・サービス            | 597,733 | 10,985.74  | 6,566,540,519 | 11,591.16  | 6,928,421,709 | 2.13 |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC              | 小売                     | 34,024  | 181,581.85 | 6,178,140,979 | 182,010.05 | 6,192,710,036 | 1.90 |
| アメリカ | 株式 | FACEBOOK INC-CLASS A        | メディア・娯楽                | 197,892 | 19,791.22  | 3,916,524,491 | 16,389.76  | 3,243,403,019 | 1.00 |
| 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 | 220,136 | 14,068.36  | 3,096,953,804 | 14,343.49  | 3,157,519,483 | 0.97 |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO         | 銀行                     | 275,705 | 12,324.79  | 3,398,007,943 | 11,376.51  | 3,136,561,682 | 0.96 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C           | メディア・娯楽                | 25,833  | 121,700.66 | 3,143,893,310 | 118,663.97 | 3,065,446,533 | 0.94 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A           | メディア・娯楽                | 24,533  | 122,459.59 | 3,004,301,324 | 119,636.99 | 2,935,054,285 | 0.90 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP            | エネルギー                  | 347,477 | 8,842.92   | 3,072,713,418 | 7,876.71   | 2,736,978,479 | 0.84 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP        | 銀行                     | 778,338 | 3,320.72   | 2,584,646,852 | 3,167.46   | 2,465,360,086 | 0.76 |
| スイス  | 株式 | NESTLE SA-REG               | 食品・飲料・タバコ              | 251,254 | 8,602.32   | 2,161,369,819 | 9,525.47   | 2,393,314,851 | 0.73 |
| アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 各種金融                   | 106,448 | 21,913.30  | 2,332,627,317 | 22,441.40  | 2,388,842,318 | 0.73 |
| アメリカ | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP INC      | ヘルスケア機器・サービス           | 78,967  | 26,627.13  | 2,102,665,147 | 29,459.51  | 2,326,329,537 | 0.71 |
| アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES     | ソフトウェア・サービス            | 145,686 | 14,666.43  | 2,136,694,299 | 14,992.89  | 2,184,255,047 | 0.67 |
| アメリカ | 株式 | PFIZER INC                  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 480,988 | 4,056.49   | 1,951,126,131 | 4,530.55   | 2,179,143,454 | 0.67 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO/THE     | 家庭用品・パーソナル用品           | 204,188 | 8,318.53   | 1,698,544,361 | 10,298.89  | 2,102,911,630 | 0.65 |
| アメリカ | 株式 | WELLS FARGO & CO            | 銀行                     | 375,320 | 5,928.83   | 2,225,210,463 | 5,457.80   | 2,048,423,898 | 0.63 |
| アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS INC  | 電気通信サービス               | 338,948 | 5,459.62   | 1,850,530,299 | 5,883.83   | 1,994,315,800 | 0.61 |
| アメリカ | 株式 | CISCO SYSTEMS INC           | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 385,835 | 4,977.36   | 1,920,442,088 | 5,089.52   | 1,963,715,567 | 0.60 |
| アメリカ | 株式 | INTEL CORP                  | 半導体・半導体製造装置            | 378,368 | 5,773.92   | 2,184,666,897 | 5,179.95   | 1,959,930,500 | 0.60 |
| アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP                | エネルギー                  | 157,255 | 13,827.82  | 2,174,494,186 | 12,313.56  | 1,936,370,387 | 0.59 |
| アメリカ | 株式 | AT&T INC                    | 電気通信サービス               | 595,697 | 3,462.66   | 2,062,699,464 | 3,200.15   | 1,906,322,852 | 0.59 |
| アメリカ | 株式 | BOEING CO/THE               | 資本財                    | 44,781  | 37,673.67  | 1,687,065,045 | 42,245.97  | 1,891,816,836 | 0.58 |
| アメリカ | 株式 | HOME DEPOT INC              | 小売                     | 93,866  | 20,873.64  | 1,959,325,801 | 19,850.33  | 1,863,271,339 | 0.57 |
| 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 | 218,224 | 6,786.43   | 1,480,963,102 | 7,994.39   | 1,744,568,898 | 0.54 |
| アメリカ | 株式 | COCA-COLA CO/THE            | 食品・飲料・タバコ              | 331,341 | 4,715.41   | 1,562,409,911 | 5,214.82   | 1,727,885,529 | 0.53 |
| アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC - A          | ソフトウェア・サービス            | 75,649  | 21,504.51  | 1,626,794,886 | 22,230.01  | 1,681,678,722 | 0.52 |

|      |    |                               |                        |           |           |               |           |               |      |
|------|----|-------------------------------|------------------------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| スイス  | 株式 | NOVARTIS AG-REG               | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 177,938   | 8,666.67  | 1,542,131,568 | 9,387.27  | 1,670,352,085 | 0.51 |
| スイス  | 株式 | ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 57,661    | 24,919.00 | 1,436,854,476 | 28,234.20 | 1,628,012,552 | 0.50 |
| イギリス | 株式 | HSBC HOLDINGS PLC             | 銀行                     | 1,633,039 | 1,027.29  | 1,677,614,516 | 931.43    | 1,521,069,224 | 0.47 |

(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

平成31年 1月31日現在

| 種類          | 業種                     | 投資比率 (%) |
|-------------|------------------------|----------|
| 株式          | エネルギー                  | 6.26     |
|             | 素材                     | 4.38     |
|             | 資本財                    | 6.79     |
|             | 商業・専門サービス              | 1.11     |
|             | 運輸                     | 1.94     |
|             | 自動車・自動車部品              | 1.22     |
|             | 耐久消費財・アパレル             | 1.82     |
|             | 消費者サービス                | 1.85     |
|             | メディア・娯楽                | 5.55     |
|             | 小売                     | 4.53     |
|             | 食品・生活必需品小売り            | 1.49     |
|             | 食品・飲料・タバコ              | 4.64     |
|             | 家庭用品・パーソナル用品           | 1.93     |
|             | ヘルスケア機器・サービス           | 4.69     |
|             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 8.15     |
|             | 銀行                     | 8.28     |
|             | 各種金融                   | 4.17     |
|             | 保険                     | 3.69     |
|             | 不動産                    | 0.66     |
|             | ソフトウェア・サービス            | 8.17     |
|             | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 3.88     |
|             | 電気通信サービス               | 2.34     |
|             | 公益事業                   | 3.30     |
| 半導体・半導体製造装置 | 2.79                   |          |
|             | 小計                     | 93.62    |
| 投資証券        |                        | 2.48     |
| 合計          |                        | 96.10    |

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

## 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

平成31年 1月31日現在

| 資産の種類    | 地域      | 取引所名              | 資産の名称        | 建別 | 数量  | 通貨        | 簿価金額         | 簿価金額（円）       | 評価金額       | 評価金額（円）       | 投資比率（％） |
|----------|---------|-------------------|--------------|----|-----|-----------|--------------|---------------|------------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ    | シカゴ商業取引所          | SP EMINI1903 | 買建 | 595 | アメリカドル    | 75,330,887.5 | 8,208,053,502 | 79,804,375 | 8,695,484,700 | 2.67    |
|          | カナダ     | モントリオール取引所        | SP/TSE601903 | 買建 | 31  | カナダドル     | 5,357,682.25 | 444,044,704   | 5,731,280  | 475,008,486   | 0.15    |
|          | ドイツ     | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO ST 1903 | 買建 | 454 | ユーロ       | 13,676,148.5 | 1,711,569,985 | 14,291,920 | 1,788,633,788 | 0.55    |
|          | オーストラリア | シドニー先物取引所         | SPI 200 1903 | 買建 | 50  | オーストラリアドル | 6,974,350    | 550,694,676   | 7,283,750  | 575,124,900   | 0.18    |
|          | イギリス    | インターコンチネンタル取引所    | FTSE100 1903 | 買建 | 82  | イギリスポンド   | 5,456,431.8  | 779,614,976   | 5,635,450  | 805,193,096   | 0.25    |
|          | スイス     | ユーレックス・チューリッヒ取引所  | SWISS IX1903 | 買建 | 42  | スイスフラン    | 3,517,711.2  | 385,857,741   | 3,728,760  | 409,007,684   | 0.13    |

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

## 新興国株式インデックスマザーファンド

### 投資状況

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類 | 国/地域   | 時価合計           | 投資比率（％） |
|-------|--------|----------------|---------|
| 株式    | 香港     | 17,161,552,239 | 21.54   |
|       | 韓国     | 10,707,891,070 | 13.44   |
|       | アメリカ   | 9,043,899,086  | 11.35   |
|       | 台湾     | 8,129,510,423  | 10.20   |
|       | インド    | 6,408,525,257  | 8.04    |
|       | ブラジル   | 6,041,636,868  | 7.58    |
|       | 南アフリカ  | 4,629,618,046  | 5.81    |
|       | メキシコ   | 2,044,837,393  | 2.57    |
|       | タイ     | 1,866,040,312  | 2.34    |
|       | マレーシア  | 1,745,840,539  | 2.19    |
|       | インドネシア | 1,715,170,988  | 2.15    |
|       | ポーランド  | 925,194,911    | 1.16    |

|                          |          |                |        |
|--------------------------|----------|----------------|--------|
|                          | フィリピン    | 851,664,561    | 1.07   |
|                          | チリ       | 829,438,670    | 1.04   |
|                          | カタール     | 777,723,611    | 0.98   |
|                          | トルコ      | 512,999,320    | 0.64   |
|                          | 中国       | 492,319,655    | 0.62   |
|                          | アラブ首長国連邦 | 487,565,565    | 0.61   |
|                          | コロンビア    | 313,488,875    | 0.39   |
|                          | ハンガリー    | 236,571,664    | 0.30   |
|                          | ギリシャ     | 165,565,247    | 0.21   |
|                          | チェコ      | 132,444,380    | 0.17   |
|                          | イギリス     | 27,839,699     | 0.03   |
|                          | 小計       | 75,247,338,379 | 94.43  |
| 投資証券                     | 南アフリカ    | 211,805,191    | 0.27   |
|                          | メキシコ     | 62,105,113     | 0.08   |
|                          | 小計       | 273,910,304    | 0.34   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） |          | 4,166,228,471  | 5.23   |
| 純資産総額                    |          | 79,687,477,154 | 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

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類    | 建別 | 国/地域 | 時価合計          | 投資比率（%） |
|----------|----|------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 4,157,119,281 | 5.22    |
|          | 買建 | 香港   | 19,200,147    | 0.02    |

（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

平成31年 1月31日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名                             | 業種          | 数量      | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|----|---------------------------------|-------------|---------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 香港   | 株式 | TENCENT HOLDINGS LTD            | メディア・<br>娯楽 | 765,900 | 5,509.65        | 4,219,846,610   | 4,780.93        | 3,661,720,414   | 4.60            |
| アメリカ | 株式 | ALIBABA GROUP HOLDING-SP<br>ADR | 小売          | 173,808 | 20,352.90       | 3,537,498,526   | 18,176.70       | 3,159,257,125   | 3.96            |

|       |    |                              |                    |            |           |               |           |               |      |
|-------|----|------------------------------|--------------------|------------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 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 | 645,363    | 4,916.89  | 3,173,180,392 | 4,556.47  | 2,940,583,602 | 3.69 |
| 台湾    | 株式 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 半導体・半導体製造装置        | 3,297,000  | 823.01    | 2,713,470,035 | 782.34    | 2,579,374,980 | 3.24 |
| 南アフリカ | 株式 | NASPERS LTD-N SHS            | メディア・娯楽            | 58,826     | 25,855.59 | 1,520,981,272 | 24,642.01 | 1,449,591,116 | 1.82 |
| 香港    | 株式 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H    | 銀行                 | 12,898,550 | 110.39    | 1,423,915,729 | 96.39     | 1,243,376,365 | 1.56 |
| 香港    | 株式 | CHINA MOBILE LTD             | 電気通信サービス           | 823,000    | 1,024.18  | 842,903,714   | 1,146.61  | 943,667,849   | 1.18 |
| 香港    | 株式 | IND & COMM BK OF CHINA-H     | 銀行                 | 9,313,350  | 92.21     | 858,788,072   | 83.06     | 773,587,340   | 0.97 |
| ブラジル  | 株式 | ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | 銀行                 | 649,230    | 941.53    | 611,269,801   | 1,127.97  | 732,312,482   | 0.92 |
| 香港    | 株式 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 保険                 | 691,500    | 1,071.50  | 740,944,402   | 1,027.16  | 710,284,943   | 0.89 |
| インド   | 株式 | RELIANCE INDUSTRIES LTD      | エネルギー              | 381,641    | 1,549.34  | 591,294,681   | 1,841.37  | 702,745,341   | 0.88 |
| アメリカ  | 株式 | BAIDU INC - SPON ADR         | メディア・娯楽            | 37,265     | 28,393.41 | 1,058,080,494 | 18,451.28 | 687,587,188   | 0.86 |
| インド   | 株式 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE  | 銀行                 | 214,666    | 2,947.28  | 632,682,610   | 2,904.13  | 623,418,400   | 0.78 |
| ブラジル  | 株式 | VALE SA                      | 素材                 | 426,130    | 1,564.08  | 666,504,907   | 1,378.89  | 587,588,100   | 0.74 |
| 韓国    | 株式 | SK HYNIX INC                 | 半導体・半導体製造装置        | 77,763     | 8,284.39  | 644,219,089   | 7,453.38  | 579,597,189   | 0.73 |
| ブラジル  | 株式 | BANCO BRADESCO SA-PREF       | 銀行                 | 446,328    | 963.61    | 430,089,894   | 1,267.63  | 565,781,262   | 0.71 |
| アメリカ  | 株式 | LUKOIL PJSC-SPON ADR         | エネルギー              | 65,288     | 7,781.90  | 508,065,210   | 8,651.42  | 564,834,170   | 0.71 |
| 香港    | 株式 | BANK OF CHINA LTD-H          | 銀行                 | 10,649,000 | 57.07     | 607,772,514   | 50.00     | 532,492,596   | 0.67 |
| インド   | 株式 | INFOSYS LTD                  | ソフトウェア・サービス        | 466,395    | 929.81    | 433,662,125   | 1,117.88  | 521,376,441   | 0.65 |
| アメリカ  | 株式 | SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR | 銀行                 | 358,117    | 1,643.14  | 588,437,875   | 1,445.35  | 517,605,981   | 0.65 |
| 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 | 1,770,272  | 357.72    | 633,275,868   | 247.80    | 438,673,402   | 0.55 |
| 香港    | 株式 | CNOOC LTD                    | エネルギー              | 2,402,000  | 190.79    | 458,278,747   | 177.79    | 427,056,384   | 0.54 |
| 韓国    | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 115,327    | 3,933.08  | 453,590,901   | 3,657.95  | 421,860,400   | 0.53 |
| ブラジル  | 株式 | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | エネルギー              | 521,000    | 738.64    | 384,833,691   | 758.09    | 394,967,912   | 0.50 |
| メキシコ  | 株式 | AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L | 電気通信サービス           | 4,513,100  | 94.72     | 427,523,608   | 85.78     | 387,156,284   | 0.49 |
| アメリカ  | 株式 | GAZPROM PAO -SPON ADR        | エネルギー              | 714,295    | 519.40    | 371,005,900   | 540.00    | 385,723,414   | 0.48 |
| インド   | 株式 | TATA CONSULTANCY SVCS LTD    | ソフトウェア・サービス        | 120,140    | 2,706.11  | 325,112,874   | 3,051.35  | 366,589,910   | 0.46 |
| ブラジル  | 株式 | PETROBRAS - PETROLEO BRAS    | エネルギー              | 403,900    | 829.95    | 335,218,118   | 871.12    | 351,849,245   | 0.44 |
| カタール  | 株式 | QATAR NATIONAL BANK          | 銀行                 | 58,892     | 4,695.43  | 276,523,823   | 5,936.04  | 349,585,268   | 0.44 |
| ブラジル  | 株式 | AMBEV SA                     | 食品・飲料・タバコ          | 637,400    | 623.73    | 397,567,636   | 531.73    | 338,926,168   | 0.43 |

（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

平成31年 1月31日現在

| 種類          | 業種                     | 投資比率（％） |
|-------------|------------------------|---------|
| 株式          | エネルギー                  | 7.64    |
|             | 素材                     | 7.05    |
|             | 資本財                    | 3.38    |
|             | 商業・専門サービス              | 0.16    |
|             | 運輸                     | 1.65    |
|             | 自動車・自動車部品              | 2.33    |
|             | 耐久消費財・アパレル             | 1.10    |
|             | 消費者サービス                | 1.12    |
|             | メディア・娯楽                | 9.06    |
|             | 小売                     | 5.72    |
|             | 食品・生活必需品小売り            | 1.72    |
|             | 食品・飲料・タバコ              | 3.36    |
|             | 家庭用品・パーソナル用品           | 1.12    |
|             | ヘルスケア機器・サービス           | 0.59    |
|             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 1.98    |
|             | 銀行                     | 17.30   |
|             | 各種金融                   | 2.48    |
|             | 保険                     | 3.60    |
|             | 不動産                    | 2.56    |
|             | ソフトウェア・サービス            | 1.81    |
|             | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 7.04    |
|             | 電気通信サービス               | 4.37    |
|             | 公益事業                   | 2.46    |
| 半導体・半導体製造装置 | 4.85                   |         |
|             | 小計                     | 94.43   |
| 投資証券        |                        | 0.34    |
| 合計          |                        | 94.77   |

（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

平成31年 1月31日現在

| 資産の種類    | 地域   | 取引所名        | 資産の名称        | 建別 | 数量  | 通貨     | 簿価金額          | 簿価金額（円）       | 評価金額       | 評価金額（円）       | 投資比率（％） |
|----------|------|-------------|--------------|----|-----|--------|---------------|---------------|------------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | ニューヨーク証券取引所 | MINI MS 1903 | 買建 | 723 | アメリカドル | 35,727,367.36 | 3,892,853,947 | 38,152,710 | 4,157,119,281 | 5.22    |
|          | 香港   | 香港先物取引所     | HANG IDX1903 | 買建 | 1   | 香港ドル   | 1,279,533.5   | 17,772,720    | 1,382,300  | 19,200,147    | 0.02    |



（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

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国/地域 | 時価合計            | 投資比率（%） |
|--------------------------|------|-----------------|---------|
| 国債証券                     | 日本   | 485,320,036,160 | 82.61   |
| 地方債証券                    | 日本   | 31,083,221,753  | 5.29    |
| 特殊債券                     | 日本   | 38,297,405,963  | 6.52    |
| 社債券                      | 日本   | 30,176,848,180  | 5.14    |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） |      | 2,596,184,510   | 0.44    |
| 純資産総額                    |      | 587,473,696,566 | 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

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類  | 建別 | 国/地域 | 時価合計        | 投資比率（%） |
|--------|----|------|-------------|---------|
| 債券先物取引 | 買建 | 日本   | 610,760,000 | 0.10    |

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

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### a 評価額上位30銘柄

平成31年 1月31日現在

| 国/地域 | 種類   | 銘柄名            | 数量            | 簿価<br>単価<br>（円） | 簿価<br>金額<br>（円） | 評価<br>単価<br>（円） | 評価<br>金額<br>（円） | 利率<br>（%） | 償還期限<br>（年/月/日） | 投資<br>比率<br>（%） |
|------|------|----------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|-----------------|-----------------|
| 日本   | 国債証券 | 第312回利付国債（10年） | 6,860,000,000 | 103.45          | 7,097,081,600   | 102.58          | 7,037,399,600   | 1.200000  | 2020/12/20      | 1.20            |
| 日本   | 国債証券 | 第351回利付国債（10年） | 6,500,000,000 | 100.04          | 6,502,728,000   | 101.31          | 6,585,670,000   | 0.100000  | 2028/6/20       | 1.12            |
| 日本   | 国債証券 | 第329回利付国債（10年） | 5,860,000,000 | 104.58          | 6,128,388,000   | 104.25          | 6,109,518,800   | 0.800000  | 2023/6/20       | 1.04            |
| 日本   | 国債証券 | 第133回利付国債（5年）  | 5,970,000,000 | 100.85          | 6,020,770,500   | 100.98          | 6,028,864,200   | 0.100000  | 2022/9/20       | 1.03            |
| 日本   | 国債証券 | 第352回利付国債（10年） | 5,710,000,000 | 100.36          | 5,730,724,500   | 101.15          | 5,776,121,800   | 0.100000  | 2028/9/20       | 0.98            |

|    |      |                |               |        |               |        |               |          |            |      |
|----|------|----------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|----------|------------|------|
| 日本 | 国債証券 | 第134回利付国債(5年)  | 5,710,000,000 | 100.88 | 5,760,517,000 | 101.05 | 5,770,240,500 | 0.100000 | 2022/12/20 | 0.98 |
| 日本 | 国債証券 | 第348回利付国債(10年) | 5,600,000,000 | 100.48 | 5,626,941,000 | 101.65 | 5,692,568,000 | 0.100000 | 2027/9/20  | 0.97 |
| 日本 | 国債証券 | 第350回利付国債(10年) | 5,550,000,000 | 100.67 | 5,587,620,000 | 101.42 | 5,628,921,000 | 0.100000 | 2028/3/20  | 0.96 |
| 日本 | 国債証券 | 第333回利付国債(10年) | 5,350,000,000 | 103.91 | 5,559,185,000 | 103.93 | 5,560,255,000 | 0.600000 | 2024/3/20  | 0.95 |
| 日本 | 国債証券 | 第340回利付国債(10年) | 5,350,000,000 | 103.02 | 5,511,915,000 | 103.71 | 5,548,966,500 | 0.400000 | 2025/9/20  | 0.94 |
| 日本 | 国債証券 | 第332回利付国債(10年) | 5,040,000,000 | 103.82 | 5,232,800,000 | 103.76 | 5,229,756,000 | 0.600000 | 2023/12/20 | 0.89 |
| 日本 | 国債証券 | 第335回利付国債(10年) | 4,970,000,000 | 103.44 | 5,141,205,000 | 103.75 | 5,156,424,700 | 0.500000 | 2024/9/20  | 0.88 |
| 日本 | 国債証券 | 第339回利付国債(10年) | 4,960,000,000 | 103.03 | 5,110,678,000 | 103.61 | 5,139,056,000 | 0.400000 | 2025/6/20  | 0.87 |
| 日本 | 国債証券 | 第334回利付国債(10年) | 4,830,000,000 | 103.89 | 5,017,981,000 | 104.12 | 5,029,189,200 | 0.600000 | 2024/6/20  | 0.86 |
| 日本 | 国債証券 | 第136回利付国債(5年)  | 4,950,000,000 | 100.79 | 4,989,105,000 | 101.19 | 5,008,954,500 | 0.100000 | 2023/6/20  | 0.85 |
| 日本 | 国債証券 | 第130回利付国債(5年)  | 4,950,000,000 | 100.69 | 4,984,155,000 | 100.78 | 4,988,709,000 | 0.100000 | 2021/12/20 | 0.85 |
| 日本 | 国債証券 | 第346回利付国債(10年) | 4,790,000,000 | 100.78 | 4,827,362,000 | 101.80 | 4,876,459,500 | 0.100000 | 2027/3/20  | 0.83 |
| 日本 | 国債証券 | 第343回利付国債(10年) | 4,760,000,000 | 100.91 | 4,803,427,000 | 101.86 | 4,848,774,000 | 0.100000 | 2026/6/20  | 0.83 |
| 日本 | 国債証券 | 第137回利付国債(5年)  | 4,750,000,000 | 101.07 | 4,800,837,000 | 101.26 | 4,809,850,000 | 0.100000 | 2023/9/20  | 0.82 |
| 日本 | 国債証券 | 第391回利付国債(2年)  | 4,700,000,000 | 100.39 | 4,718,447,000 | 100.41 | 4,719,693,000 | 0.100000 | 2020/8/1   | 0.80 |
| 日本 | 国債証券 | 第135回利付国債(5年)  | 4,480,000,000 | 101.02 | 4,525,696,000 | 101.12 | 4,530,265,600 | 0.100000 | 2023/3/20  | 0.77 |
| 日本 | 国債証券 | 第125回利付国債(5年)  | 4,400,000,000 | 100.53 | 4,423,320,000 | 100.45 | 4,419,800,000 | 0.100000 | 2020/9/20  | 0.75 |
| 日本 | 国債証券 | 第345回利付国債(10年) | 4,190,000,000 | 100.72 | 4,220,220,000 | 101.83 | 4,266,718,900 | 0.100000 | 2026/12/20 | 0.73 |
| 日本 | 国債証券 | 第349回利付国債(10年) | 4,190,000,000 | 100.64 | 4,216,951,900 | 101.56 | 4,255,531,600 | 0.100000 | 2027/12/20 | 0.72 |
| 日本 | 国債証券 | 第341回利付国債(10年) | 4,120,000,000 | 102.56 | 4,225,593,000 | 103.16 | 4,250,398,000 | 0.300000 | 2025/12/20 | 0.72 |
| 日本 | 国債証券 | 第131回利付国債(5年)  | 4,210,000,000 | 100.77 | 4,242,417,000 | 100.84 | 4,245,742,900 | 0.100000 | 2022/3/20  | 0.72 |
| 日本 | 国債証券 | 第336回利付国債(10年) | 4,080,000,000 | 103.67 | 4,229,980,800 | 103.91 | 4,239,895,200 | 0.500000 | 2024/12/20 | 0.72 |
| 日本 | 国債証券 | 第390回利付国債(2年)  | 4,150,000,000 | 100.40 | 4,166,789,000 | 100.40 | 4,166,724,500 | 0.100000 | 2020/7/1   | 0.71 |
| 日本 | 国債証券 | 第325回利付国債(10年) | 3,835,000,000 | 103.91 | 3,984,948,500 | 103.52 | 3,970,222,100 | 0.800000 | 2022/9/20  | 0.68 |
| 日本 | 国債証券 | 第127回利付国債(5年)  | 3,870,000,000 | 100.60 | 3,893,475,400 | 100.58 | 3,892,716,900 | 0.100000 | 2021/3/20  | 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

平成31年 1月31日現在

| 種類    | 投資比率(%) |
|-------|---------|
| 国債証券  | 82.61   |
| 地方債証券 | 5.29    |
| 特殊債券  | 6.52    |

|     |       |
|-----|-------|
| 社債券 | 5.14  |
| 合計  | 99.56 |

（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

平成31年 1月31日現在

| 資産の種類  | 取引所名  | 資産の名称         | 建別 | 数量 | 通貨 | 簿価金額（円）     | 評価金額（円）     | 投資比率（％） |
|--------|-------|---------------|----|----|----|-------------|-------------|---------|
| 債券先物取引 | 大阪取引所 | 長期国債先物19年03月限 | 買建 | 4  | 円  | 609,904,320 | 610,760,000 | 0.10    |

（注1）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。

（注2）平成30年2月28日より、国内債券先物の数量は「額面÷所定倍数÷100」にて算出しております。

#### 外国債券インデックスマザーファンド

#### 投資状況

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類  | 国/地域        | 時価合計           | 投資比率（％） |
|--------|-------------|----------------|---------|
| 国債証券   | アメリカ        | 59,490,849,359 | 45.31   |
|        | フランス        | 13,127,448,954 | 10.00   |
|        | イタリア        | 11,646,093,911 | 8.87    |
|        | ドイツ         | 8,802,870,645  | 6.70    |
|        | イギリス        | 8,712,941,944  | 6.64    |
|        | スペイン        | 7,588,960,604  | 5.78    |
|        | ベルギー        | 3,134,955,658  | 2.39    |
|        | オランダ        | 2,754,573,723  | 2.10    |
|        | オーストラリア     | 2,738,844,625  | 2.09    |
|        | カナダ         | 2,603,009,068  | 1.98    |
|        | オーストリア      | 1,865,355,152  | 1.42    |
|        | メキシコ        | 984,007,558    | 0.75    |
|        | アイルランド      | 979,852,272    | 0.75    |
|        | フィンランド      | 810,629,796    | 0.62    |
|        | ポーランド       | 805,983,194    | 0.61    |
|        | 南アフリカ       | 783,700,880    | 0.60    |
|        | デンマーク       | 692,665,405    | 0.53    |
|        | マレーシア       | 558,677,377    | 0.43    |
| シンガポール | 508,345,068 | 0.39           |         |

|                          |        |                 |        |
|--------------------------|--------|-----------------|--------|
|                          | スウェーデン | 487,874,811     | 0.37   |
|                          | ノルウェー  | 299,874,631     | 0.23   |
|                          | 小計     | 129,377,514,635 | 98.54  |
| コール・ローン、その他資産<br>(負債控除後) |        | 1,922,162,083   | 1.46   |
| 純資産総額                    |        | 131,299,676,718 | 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

平成31年 1月31日現在

| 国/<br>地域 | 種類   | 銘柄名                    | 数量         | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|------|------------------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|-----------------|-----------------|
| アメリカ     | 国債証券 | 2.75 T-NOTE<br>210815  | 12,560,000 | 10,902.91       | 1,369,405,967   | 10,956.86       | 1,376,182,163   | 2.750000  | 2021/8/15       | 1.05            |
| アメリカ     | 国債証券 | 1.875 T-NOTE<br>220430 | 11,100,000 | 10,576.85       | 1,174,031,241   | 10,685.74       | 1,186,117,278   | 1.875000  | 2022/4/30       | 0.90            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.25 T-NOTE<br>241115  | 9,650,000  | 10,593.24       | 1,022,248,163   | 10,717.23       | 1,034,213,418   | 2.250000  | 2024/11/15      | 0.79            |
| アメリカ     | 国債証券 | 1.625 T-NOTE<br>220831 | 7,640,000  | 10,375.86       | 792,716,318     | 10,575.07       | 807,936,016     | 1.625000  | 2022/8/31       | 0.62            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.75 T-NOTE<br>280215  | 7,360,000  | 10,628.57       | 782,263,134     | 10,959.84       | 806,644,500     | 2.750000  | 2028/2/15       | 0.61            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.25 T-NOTE<br>251115  | 7,370,000  | 10,413.31       | 767,461,046     | 10,669.56       | 786,347,124     | 2.250000  | 2025/11/15      | 0.60            |
| アメリカ     | 国債証券 | 1.125 T-NOTE<br>200331 | 6,500,000  | 10,653.91       | 692,504,469     | 10,714.25       | 696,426,777     | 1.125000  | 2020/3/31       | 0.53            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.75 T-NOTE<br>200930  | 6,000,000  | 10,879.00       | 652,740,520     | 10,930.47       | 655,828,537     | 2.750000  | 2020/9/30       | 0.50            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.75 T-NOTE<br>250831  | 5,840,000  | 10,696.57       | 624,679,970     | 11,009.21       | 642,938,229     | 2.750000  | 2025/8/31       | 0.49            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.25 T-NOTE<br>270815  | 6,070,000  | 10,347.21       | 628,075,754     | 10,556.35       | 640,770,520     | 2.250000  | 2027/8/15       | 0.49            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.75 T-NOTE<br>231115  | 5,650,000  | 10,830.66       | 611,932,496     | 11,010.06       | 622,068,813     | 2.750000  | 2023/11/15      | 0.47            |
| アメリカ     | 国債証券 | 3.125 T-BOND<br>440815 | 5,100,000  | 10,908.50       | 556,333,899     | 11,076.46       | 564,899,715     | 3.125000  | 2044/8/15       | 0.43            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.375 T-NOTE<br>230131 | 5,000,000  | 10,647.78       | 532,389,456     | 10,845.77       | 542,288,812     | 2.375000  | 2023/1/31       | 0.41            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2 T-NOTE 261115        | 5,150,000  | 10,099.50       | 520,124,374     | 10,408.23       | 536,024,038     | 2.000000  | 2026/11/15      | 0.41            |
| アメリカ     | 国債証券 | 1.75 T-NOTE<br>220630  | 4,900,000  | 10,454.71       | 512,280,888     | 10,634.66       | 521,098,646     | 1.750000  | 2022/6/30       | 0.40            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.125 T-NOTE<br>250515 | 4,900,000  | 10,335.87       | 506,457,997     | 10,614.23       | 520,097,576     | 2.125000  | 2025/5/15       | 0.40            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.875 T-NOTE<br>211015 | 4,700,000  | 10,908.22       | 512,686,734     | 10,998.57       | 516,933,054     | 2.875000  | 2021/10/15      | 0.39            |
| フランス     | 国債証券 | 4.5 O.A.T 410425       | 2,490,000  | 20,105.26       | 500,620,979     | 20,267.44       | 504,659,424     | 4.500000  | 2041/4/25       | 0.38            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.25 T-NOTE<br>270215  | 4,750,000  | 10,285.82       | 488,576,640     | 10,589.55       | 503,003,625     | 2.250000  | 2027/2/15       | 0.38            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2 T-NOTE 250815        | 4,700,000  | 10,227.29       | 480,682,742     | 10,518.04       | 494,348,115     | 2.000000  | 2025/8/15       | 0.38            |

|      |      |                          |           |           |             |           |             |          |            |      |
|------|------|--------------------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|----------|------------|------|
| アメリカ | 国債証券 | 2.125 T-NOTE<br>210815   | 4,500,000 | 10,667.08 | 480,018,922 | 10,787.46 | 485,435,952 | 2.125000 | 2021/8/15  | 0.37 |
| フランス | 国債証券 | 5.5 O.A.T 290425         | 2,600,000 | 18,640.36 | 484,649,497 | 18,627.95 | 484,326,876 | 5.500000 | 2029/4/25  | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | 2.125 T-NOTE<br>231130   | 4,500,000 | 10,546.51 | 474,593,172 | 10,709.57 | 481,930,931 | 2.125000 | 2023/11/30 | 0.37 |
| フランス | 国債証券 | 0.5 O.A.T 250525         | 3,750,000 | 12,717.65 | 476,912,069 | 12,840.80 | 481,530,018 | 0.500000 | 2025/5/25  | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | 2.5 T-NOTE 240515        | 4,350,000 | 10,659.35 | 463,681,833 | 10,881.52 | 473,346,500 | 2.500000 | 2024/5/15  | 0.36 |
| フランス | 国債証券 | 4.25 O.A.T 231025        | 2,950,000 | 15,340.96 | 452,558,381 | 15,146.49 | 446,821,499 | 4.250000 | 2023/10/25 | 0.34 |
| イタリア | 国債証券 | 0.9 ITALY GOVT<br>220801 | 3,550,000 | 12,191.72 | 432,806,407 | 12,434.50 | 441,424,876 | 0.900000 | 2022/8/1   | 0.34 |
| フランス | 国債証券 | 1.5 O.A.T 310525         | 3,260,000 | 13,280.07 | 432,930,331 | 13,491.42 | 439,820,383 | 1.500000 | 2031/5/25  | 0.33 |
| フランス | 国債証券 | 5.75 O.A.T 321025        | 2,140,000 | 20,425.75 | 437,111,151 | 20,417.43 | 436,933,089 | 5.750000 | 2032/10/25 | 0.33 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.5 T-NOTE 260815        | 4,250,000 | 9,727.94  | 413,437,824 | 10,060.92 | 427,589,259 | 1.500000 | 2026/8/15  | 0.33 |

（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

平成31年 1月31日現在

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

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 新興国債券インデックスマザーファンド

## 投資状況

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類 | 国 / 地域 | 時価合計          | 投資比率（%） |
|-------|--------|---------------|---------|
| 国債証券  | ブラジル   | 2,092,067,852 | 10.15   |
|       | メキシコ   | 2,014,027,364 | 9.77    |
|       | ポーランド  | 1,824,590,375 | 8.85    |
|       | インドネシア | 1,819,208,203 | 8.82    |
|       | 南アフリカ  | 1,750,023,473 | 8.49    |
|       | タイ     | 1,705,260,257 | 8.27    |
|       | ロシア    | 1,475,043,707 | 7.15    |

|  |                          |                |        |
|--|--------------------------|----------------|--------|
|  | コロンビア                    | 1,389,997,480  | 6.74   |
|  | マレーシア                    | 1,121,913,350  | 5.44   |
|  | トルコ                      | 990,857,479    | 4.81   |
|  | ハンガリー                    | 947,290,513    | 4.59   |
|  | チェコ                      | 793,066,200    | 3.85   |
|  | ペルー                      | 613,783,238    | 2.98   |
|  | ルーマニア                    | 593,108,579    | 2.88   |
|  | チリ                       | 521,931,612    | 2.53   |
|  | アルゼンチン                   | 124,355,212    | 0.60   |
|  | フィリピン                    | 63,869,988     | 0.31   |
|  | ウルグアイ                    | 42,157,153     | 0.20   |
|  | ドミニカ共和国                  | 16,761,600     | 0.08   |
|  | 小計                       | 19,899,313,635 | 96.51  |
|  | コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | 719,840,291    | 3.49   |
|  | 純資産総額                    | 20,619,153,926 | 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

平成31年 1月31日現在

| 国/<br>地域  | 種類   | 銘柄名                          | 数量            | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(%) |
|-----------|------|------------------------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|-----------------|-----------------|
| チリ        | 国債証券 | 5.5 CHILE (GL)<br>200805     | 3,110,000,000 | 16.78           | 521,978,278     | 16.78           | 521,931,612     | 5.500000  | 2020/8/5        | 2.53            |
| ブラジル      | 国債証券 | 10(IN)BRAZIL NTN-<br>F230101 | 12,900,000    | 3,142.77        | 405,417,390     | 3,150.08        | 406,361,209     | 10.000000 | 2023/1/1        | 1.97            |
| ブラジル      | 国債証券 | BRAZIL-LTN 200701            | 14,250,000    | 2,695.45        | 384,101,884     | 2,699.06        | 384,616,811     |           | 2020/7/1        | 1.87            |
| ブラジル      | 国債証券 | 10(IN)BRAZIL NTN-<br>F210101 | 9,600,000     | 3,119.62        | 299,483,932     | 3,128.80        | 300,365,155     | 10.000000 | 2021/1/1        | 1.46            |
| 南アフリ<br>カ | 国債証券 | 10.5 SOUTH AFRICA<br>261221  | 33,400,000    | 895.84          | 299,213,232     | 894.62          | 298,804,917     | 10.500000 | 2026/12/21      | 1.45            |
| コロンビ<br>ア | 国債証券 | 7.5 TITULOS DE TE<br>260826  | 7,770,000,000 | 3.63            | 282,138,682     | 3.64            | 283,343,777     | 7.500000  | 2026/8/26       | 1.37            |
| 南アフリ<br>カ | 国債証券 | 8.75 SOUTH AFRICA<br>480228  | 35,700,000    | 737.65          | 263,343,370     | 735.78          | 262,674,168     | 8.750000  | 2048/2/28       | 1.27            |
| コロンビ<br>ア | 国債証券 | 10 TITULOS DE TES<br>240724  | 6,200,000,000 | 4.04            | 250,581,201     | 4.05            | 251,376,330     | 10.000000 | 2024/7/24       | 1.22            |
| ブラジル      | 国債証券 | BRAZIL-LTN 210701            | 9,500,000     | 2,481.44        | 235,737,103     | 2,486.49        | 236,217,120     |           | 2021/7/1        | 1.15            |
| メキシコ      | 国債証券 | 10 MEXICAN BONOS<br>241205   | 37,400,000    | 615.79          | 230,309,013     | 615.85          | 230,328,199     | 10.000000 | 2024/12/5       | 1.12            |
| ブラジル      | 国債証券 | 10 (IN)BRAZIL NT<br>270101   | 6,870,000     | 3,147.91        | 216,261,679     | 3,151.71        | 216,522,491     | 10.000000 | 2027/1/1        | 1.05            |
| タイ        | 国債証券 | 3.65 THAILAND<br>211217      | 58,200,000    | 366.90          | 213,538,501     | 366.67          | 213,406,617     | 3.650000  | 2021/12/17      | 1.03            |
| メキシコ      | 国債証券 | 7.5 MEXICAN BONOS<br>270603  | 38,700,000    | 539.41          | 208,755,347     | 538.70          | 208,479,609     | 7.500000  | 2027/6/3        | 1.01            |

|        |      |                             |                |          |             |          |             |           |            |      |
|--------|------|-----------------------------|----------------|----------|-------------|----------|-------------|-----------|------------|------|
| ブラジル   | 国債証券 | 10 (IN)BRAZIL NTN<br>250101 | 6,600,000      | 3,146.99 | 207,701,380 | 3,153.10 | 208,104,974 | 10.000000 | 2025/1/1   | 1.01 |
| ブラジル   | 国債証券 | BRAZIL-LTN 220101           | 8,700,000      | 2,369.67 | 206,161,380 | 2,374.30 | 206,564,759 |           | 2022/1/1   | 1.00 |
| メキシコ   | 国債証券 | 6.5 MEXICAN BONOS<br>210610 | 36,900,000     | 549.46   | 202,753,914 | 549.30   | 202,692,918 | 6.500000  | 2021/6/10  | 0.98 |
| メキシコ   | 国債証券 | 6.5 MEXICAN BONOS<br>220609 | 36,700,000     | 541.68   | 198,797,441 | 541.69   | 198,803,717 | 6.500000  | 2022/6/9   | 0.96 |
| メキシコ   | 国債証券 | 8 MEXICAN BONOS<br>200611   | 34,000,000     | 568.35   | 193,241,856 | 568.29   | 193,220,538 | 8.000000  | 2020/6/11  | 0.94 |
| インドネシア | 国債証券 | 8.375 INDONESIA<br>240315   | 24,400,000,000 | 0.78     | 190,933,050 | 0.78     | 190,698,200 | 8.375000  | 2024/3/15  | 0.92 |
| タイ     | 国債証券 | 4.875 THAILAND<br>290622    | 43,900,000     | 422.88   | 185,647,086 | 420.67   | 184,677,965 | 4.875000  | 2029/6/22  | 0.90 |
| ロシア    | 国債証券 | 7.1 RUSSIA OFZ<br>241016    | 107,900,000    | 160.17   | 172,825,810 | 160.30   | 172,966,360 | 7.100000  | 2024/10/16 | 0.84 |
| ポーランド  | 国債証券 | 2.5 POLAND 260725           | 5,900,000      | 2,895.73 | 170,848,399 | 2,905.13 | 171,402,951 | 2.500000  | 2026/7/25  | 0.83 |
| ポーランド  | 国債証券 | 1.75 POLAND 210725          | 5,700,000      | 2,937.38 | 167,430,714 | 2,938.55 | 167,497,766 | 1.750000  | 2021/7/25  | 0.81 |
| ポーランド  | 国債証券 | 2.5 POLAND 230125           | 5,400,000      | 2,982.59 | 161,060,198 | 2,982.59 | 161,060,198 | 2.500000  | 2023/1/25  | 0.78 |
| タイ     | 国債証券 | 2.125 THAILAND<br>261217    | 46,400,000     | 343.96   | 159,598,495 | 343.53   | 159,402,470 | 2.125000  | 2026/12/17 | 0.77 |
| タイ     | 国債証券 | 3.625 THAILAND<br>230616    | 42,400,000     | 371.87   | 157,672,986 | 371.77   | 157,631,878 | 3.625000  | 2023/6/16  | 0.76 |
| メキシコ   | 国債証券 | 5.75 MEXICAN BONO<br>260305 | 31,700,000     | 491.69   | 155,868,615 | 490.92   | 155,624,683 | 5.750000  | 2026/3/5   | 0.75 |
| タイ     | 国債証券 | 3.85 THAILAND<br>251212     | 40,500,000     | 384.06   | 155,548,039 | 383.91   | 155,485,437 | 3.850000  | 2025/12/12 | 0.75 |
| ポーランド  | 国債証券 | 1.5 POLAND 200425           | 5,300,000      | 2,927.26 | 155,144,820 | 2,927.00 | 155,131,206 | 1.500000  | 2020/4/25  | 0.75 |
| 南アフリカ  | 国債証券 | 8.75 SOUTH AFRICA<br>440131 | 21,000,000     | 737.95   | 154,970,179 | 736.93   | 154,756,289 | 8.750000  | 2044/1/31  | 0.75 |

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

#### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成31年 1月31日現在

| 種類   | 投資比率 (%) |
|------|----------|
| 国債証券 | 96.51    |
| 合計   | 96.51    |

(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

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国/地域 | 時価合計           | 投資比率（%） |
|--------------------------|------|----------------|---------|
| 投資証券                     | 日本   | 23,540,516,550 | 98.13   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） |      | 449,691,746    | 1.87    |
| 純資産総額                    |      | 23,990,208,296 | 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

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類       | 建別 | 国/地域 | 時価合計        | 投資比率（%） |
|-------------|----|------|-------------|---------|
| 不動産投信指数先物取引 | 買建 | 日本   | 446,998,500 | 1.86    |

（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

平成31年 1月31日現在

| 国/地域 | 種類   | 銘柄名               | 数量    | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|------|-------------------|-------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本   | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人      | 2,511 | 696,000         | 1,747,656,000   | 704,000         | 1,767,744,000   | 7.37            |
| 日本   | 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人  | 2,593 | 639,000         | 1,656,927,000   | 638,000         | 1,654,334,000   | 6.90            |
| 日本   | 投資証券 | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 7,684 | 153,000         | 1,175,652,000   | 155,900         | 1,197,935,600   | 4.99            |
| 日本   | 投資証券 | 日本リテールファンド投資法人    | 4,900 | 220,000         | 1,078,000,000   | 223,000         | 1,092,700,000   | 4.55            |
| 日本   | 投資証券 | ユナイテッド・アーバン投資法人   | 5,718 | 169,800         | 970,916,400     | 173,700         | 993,216,600     | 4.14            |
| 日本   | 投資証券 | オリックス不動産投資法人      | 5,166 | 185,300         | 957,259,800     | 190,300         | 983,089,800     | 4.10            |
| 日本   | 投資証券 | 大和ハウスリート投資法人      | 3,246 | 252,300         | 818,965,800     | 256,200         | 831,625,200     | 3.47            |
| 日本   | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人    | 3,478 | 232,000         | 806,896,000     | 237,500         | 826,025,000     | 3.44            |
| 日本   | 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人   | 2,527 | 327,500         | 827,592,500     | 322,000         | 813,694,000     | 3.39            |
| 日本   | 投資証券 | G L P 投資法人        | 6,424 | 111,400         | 715,633,600     | 115,700         | 743,256,800     | 3.10            |
| 日本   | 投資証券 | 日本プライムリアルティ投資法人   | 1,641 | 440,500         | 722,860,500     | 443,500         | 727,783,500     | 3.03            |
| 日本   | 投資証券 | ジャパン・ホテル・リート投資法人  | 8,345 | 83,500          | 696,807,500     | 83,500          | 696,807,500     | 2.90            |
| 日本   | 投資証券 | アクティブ・プロパティーズ投資法人 | 1,362 | 468,500         | 638,097,000     | 471,500         | 642,183,000     | 2.68            |
| 日本   | 投資証券 | ケネディクス・オフィス投資法人   | 802   | 742,000         | 595,084,000     | 747,000         | 599,094,000     | 2.50            |

|    |      |                    |       |            |             |         |             |      |
|----|------|--------------------|-------|------------|-------------|---------|-------------|------|
| 日本 | 投資証券 | 積水ハウス・リート投資法人      | 6,689 | 74,200     | 496,323,800 | 76,200  | 509,701,800 | 2.12 |
| 日本 | 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 862   | 571,000    | 492,202,000 | 579,000 | 499,098,000 | 2.08 |
| 日本 | 投資証券 | 大和証券オフィス投資法人       | 598   | 716,000    | 428,168,000 | 728,000 | 435,344,000 | 1.81 |
| 日本 | 投資証券 | 森ヒルズリート投資法人        | 2,973 | 144,700    | 430,193,100 | 144,500 | 429,598,500 | 1.79 |
| 日本 | 投資証券 | インヴィンシブル投資法人       | 8,945 | 47,150     | 421,756,750 | 47,350  | 423,545,750 | 1.77 |
| 日本 | 投資証券 | 日本ロジスティクスファンド投資法人  | 1,711 | 232,400    | 397,636,400 | 230,000 | 393,530,000 | 1.64 |
| 日本 | 投資証券 | フロンティア不動産投資法人      | 882   | 446,500    | 393,813,000 | 445,000 | 392,490,000 | 1.64 |
| 日本 | 投資証券 | ヒューリックリート投資法人      | 2,096 | 175,700    | 368,267,200 | 178,900 | 374,974,400 | 1.56 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパンエクセレント投資法人     | 2,322 | 154,200    | 358,052,400 | 155,600 | 361,303,200 | 1.51 |
| 日本 | 投資証券 | 産業ファンド投資法人         | 3,021 | 118,100    | 356,780,100 | 116,300 | 351,342,300 | 1.46 |
| 日本 | 投資証券 | イオンリート投資法人         | 2,661 | 131,900    | 350,985,900 | 127,400 | 339,011,400 | 1.41 |
| 日本 | 投資証券 | プレミアム投資法人          | 2,465 | 132,700    | 327,105,500 | 132,900 | 327,598,500 | 1.37 |
| 日本 | 投資証券 | 日本リート投資法人          | 837   | 380,000    | 318,060,000 | 385,500 | 322,663,500 | 1.34 |
| 日本 | 投資証券 | 森トラスト総合リート投資法人     | 1,853 | 170,800    | 316,492,400 | 168,700 | 312,601,100 | 1.30 |
| 日本 | 投資証券 | 東急リアル・エステート投資法人    | 1,738 | 168,400    | 292,679,200 | 167,900 | 291,810,200 | 1.22 |
| 日本 | 投資証券 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 997   | 297,960.28 | 297,066,400 | 288,700 | 287,833,900 | 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

平成31年 1月31日現在

| 種類   | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 投資証券 | 98.13   |
| 合計   | 98.13   |

（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

平成31年 1月31日現在

| 資産の種類       | 取引所名  | 資産の名称          | 建別 | 数量  | 通貨 | 簿価金額（円）     | 評価金額（円）     | 投資比率（％） |
|-------------|-------|----------------|----|-----|----|-------------|-------------|---------|
| 不動産投信指数先物取引 | 大阪取引所 | 東証REIT 19年03月限 | 買建 | 243 | 円  | 442,631,188 | 446,998,500 | 1.86    |

（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

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国/地域     | 時価合計           | 投資比率(%) |
|--------------------------|----------|----------------|---------|
| 投資証券                     | アメリカ     | 15,879,440,372 | 71.30   |
|                          | オーストラリア  | 1,527,281,738  | 6.86    |
|                          | イギリス     | 1,185,023,309  | 5.32    |
|                          | シンガポール   | 780,603,129    | 3.50    |
|                          | オランダ     | 551,442,682    | 2.48    |
|                          | 香港       | 537,151,440    | 2.41    |
|                          | フランス     | 516,425,108    | 2.32    |
|                          | カナダ      | 414,905,511    | 1.86    |
|                          | ベルギー     | 194,634,719    | 0.87    |
|                          | スペイン     | 161,256,445    | 0.72    |
|                          | ニュージーランド | 98,414,971     | 0.44    |
|                          | ドイツ      | 61,499,058     | 0.28    |
|                          | アイルランド   | 55,086,333     | 0.25    |
|                          | イスラエル    | 12,659,779     | 0.06    |
|                          | イタリア     | 6,776,962      | 0.03    |
|                          | 小計       | 21,982,601,556 | 98.70   |
| コール・ローン、その他資産<br>(負債控除後) |          | 288,720,210    | 1.30    |
| 純資産総額                    |          | 22,271,321,766 | 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

平成31年 1月31日現在

| 国/地域 | 種類   | 銘柄名                       | 数量      | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|------|---------------------------|---------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| アメリカ | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP INC  | 53,808  | 18,240.27       | 981,472,970     | 19,749.00       | 1,062,654,192   | 4.77            |
| アメリカ | 投資証券 | PROLOGIS INC              | 109,472 | 6,320.97        | 691,970,086     | 7,451.77        | 815,760,647     | 3.66            |
| アメリカ | 投資証券 | PUBLIC STORAGE            | 26,091  | 21,420.87       | 558,892,108     | 22,908.83       | 597,714,544     | 2.68            |
| アメリカ | 投資証券 | WELLTOWER INC             | 65,331  | 7,440.93        | 486,123,656     | 8,346.33        | 545,274,477     | 2.45            |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL        | 64,052  | 7,035.21        | 450,619,551     | 7,845.11        | 502,495,626     | 2.26            |
| アメリカ | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 24,031  | 18,653.42       | 448,260,393     | 20,836.42       | 500,720,028     | 2.25            |
| オランダ | 投資証券 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 23,910  | 17,285.20       | 413,289,261     | 19,771.19       | 472,729,320     | 2.12            |
| 香港   | 投資証券 | LINK REIT                 | 370,500 | 1,124.42        | 416,598,407     | 1,182.03        | 437,945,449     | 1.97            |
| アメリカ | 投資証券 | VENTAS INC                | 62,003  | 6,276.57        | 389,166,704     | 6,960.36        | 431,563,499     | 1.94            |
| アメリカ | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC  | 35,847  | 11,421.84       | 409,438,978     | 11,705.57       | 419,609,668     | 1.88            |
| アメリカ | 投資証券 | BOSTON PROPERTIES INC     | 26,825  | 12,151.02       | 325,951,118     | 14,214.92       | 381,315,272     | 1.71            |
| アメリカ | 投資証券 | REALTY INCOME CORP        | 51,300  | 6,805.44        | 349,119,082     | 7,362.42        | 377,692,515     | 1.70            |
| アメリカ | 投資証券 | ESSEX PROPERTY TRUST INC  | 11,484  | 25,966.65       | 298,201,037     | 29,529.24       | 339,113,902     | 1.52            |

|         |      |                              |         |           |             |           |             |      |
|---------|------|------------------------------|---------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| オーストラリア | 投資証券 | SCENTRE GROUP                | 922,179 | 309.49    | 285,406,374 | 320.57    | 295,629,931 | 1.33 |
| アメリカ    | 投資証券 | HCP INC                      | 83,000  | 3,048.05  | 252,988,365 | 3,367.95  | 279,540,149 | 1.26 |
| オーストラリア | 投資証券 | GOODMAN GROUP                | 280,221 | 851.17    | 238,516,866 | 951.46    | 266,621,314 | 1.20 |
| アメリカ    | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 18,707  | 12,361.48 | 231,246,220 | 14,095.06 | 263,676,392 | 1.18 |
| アメリカ    | 投資証券 | HOST HOTELS & RESORTS INC    | 129,697 | 1,838.31  | 238,424,079 | 1,978.71  | 256,633,218 | 1.15 |
| アメリカ    | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC      | 21,861  | 9,571.04  | 209,232,645 | 10,626.86 | 232,313,979 | 1.04 |
| アメリカ    | 投資証券 | UDR INC                      | 48,041  | 4,197.29  | 201,642,424 | 4,753.92  | 228,383,301 | 1.03 |
| アメリカ    | 投資証券 | VORNADO REALTY TRUST         | 30,206  | 6,671.36  | 201,515,395 | 7,491.00  | 226,273,146 | 1.02 |
| アメリカ    | 投資証券 | WP CAREY INC                 | 27,880  | 7,187.00  | 200,373,605 | 8,078.29  | 225,222,848 | 1.01 |
| アメリカ    | 投資証券 | MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 19,707  | 10,169.23 | 200,405,150 | 11,346.00 | 223,595,717 | 1.00 |
| アメリカ    | 投資証券 | REGENCY CENTERS CORP         | 29,569  | 6,222.65  | 183,997,567 | 7,078.04  | 209,290,612 | 0.94 |
| アメリカ    | 投資証券 | DUKE REALTY CORP             | 62,135  | 2,769.76  | 172,099,236 | 3,261.17  | 202,632,972 | 0.91 |
| アメリカ    | 投資証券 | IRON MOUNTAIN INC            | 49,802  | 3,615.29  | 180,048,812 | 4,014.08  | 199,909,531 | 0.90 |
| アメリカ    | 投資証券 | FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 12,918  | 12,849.46 | 165,989,349 | 14,321.70 | 185,007,752 | 0.83 |
| アメリカ    | 投資証券 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 15,694  | 10,392.91 | 163,106,408 | 11,344.91 | 178,047,099 | 0.80 |
| アメリカ    | 投資証券 | SUN COMMUNITIES INC          | 15,000  | 10,832.74 | 162,491,195 | 11,770.94 | 176,564,232 | 0.79 |
| アメリカ    | 投資証券 | CAMDEN PROPERTY TRUST        | 16,163  | 9,255.71  | 149,600,045 | 10,522.26 | 170,071,405 | 0.76 |

(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

平成31年 1月31日現在

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 98.70   |
| 合計   | 98.70   |

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 参考情報

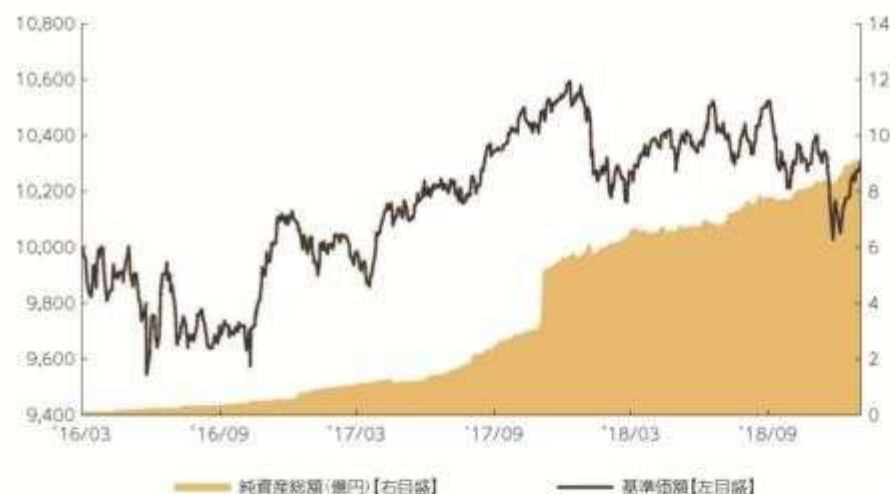


# 運用実績

2019年1月31日現在

## マイゴールキーパー

### ■基準価額・純資産の推移 2016年3月30日(設定日)～2019年1月31日



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

### ■基準価額・純資産

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 10,302円 |
| 純資産総額 | 9.2億円   |

### ■分配の推移

|         |    |
|---------|----|
| 2019年1月 | 0円 |
| 2018年1月 | 0円 |
| 2017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               | 8.9%   |
| 国内債券               | 47.5%  |
| 国内リート              | 2.0%   |
| 外国株式               | 7.8%   |
| 外国債券               | 27.4%  |
| 外国リート              | 3.2%   |
| コールローン他<br>(負債控除後) | 3.2%   |
| 合計                 | 100.0% |

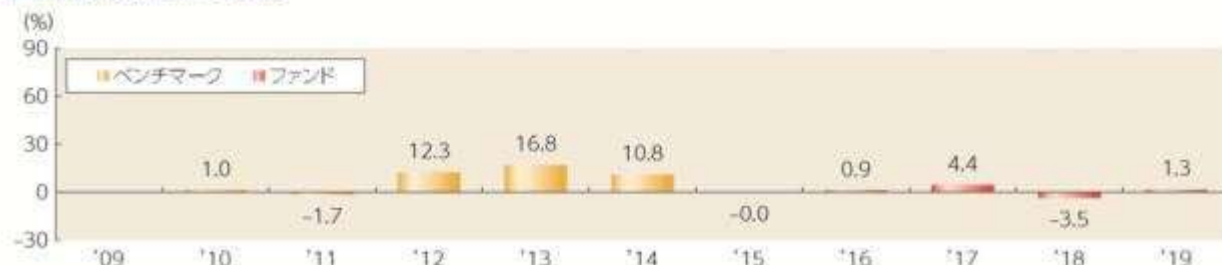
| 組入上位通貨       | 比率    |
|--------------|-------|
| 1 円          | 60.8% |
| 2 アメリカドル     | 20.6% |
| 3 ユーロ        | 12.1% |
| 4 イギリスポンド    | 2.6%  |
| 5 オーストラリアドル  | 1.0%  |
| 6 カナダドル      | 0.9%  |
| 7 スイスフラン     | 0.3%  |
| 8 シンガポールドル   | 0.3%  |
| 9 メキシコペソ     | 0.2%  |
| 10 デンマーククローネ | 0.2%  |

| 組入上位銘柄                   | 種類  | 業種/種別              | 国・地域 | 比率   |
|--------------------------|-----|--------------------|------|------|
| トヨタ自動車                   | 株式  | 輸送用機器              | 日本   | 0.3% |
| 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 | 0.2% |
| MICROSOFT CORP.          | 株式  | ソフトウェア・サービス        | アメリカ | 0.2% |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ        | 株式  | 銀行業                | 日本   | 0.2% |
| 第312回利付国債(10年)           | 債券  | 国債                 | 日本   | 0.6% |
| 第351回利付国債(10年)           | 債券  | 国債                 | 日本   | 0.5% |
| 第329回利付国債(10年)           | 債券  | 国債                 | 日本   | 0.5% |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | リート | -                  | アメリカ | 0.2% |
| 日本ビルファンド投資法人             | リート | -                  | 日本   | 0.1% |
| ジャパンリアルエステイト投資法人         | リート | -                  | 日本   | 0.1% |

| その他資産の状況         | 比率   |
|------------------|------|
| 株価指数先物取引 (買建)    | 0.4% |
| 債券先物取引 (買建)      | 0.0% |
| 不動産投信指数先物取引 (買建) | 0.0% |

- 各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- 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。

### ■年間収益率の推移

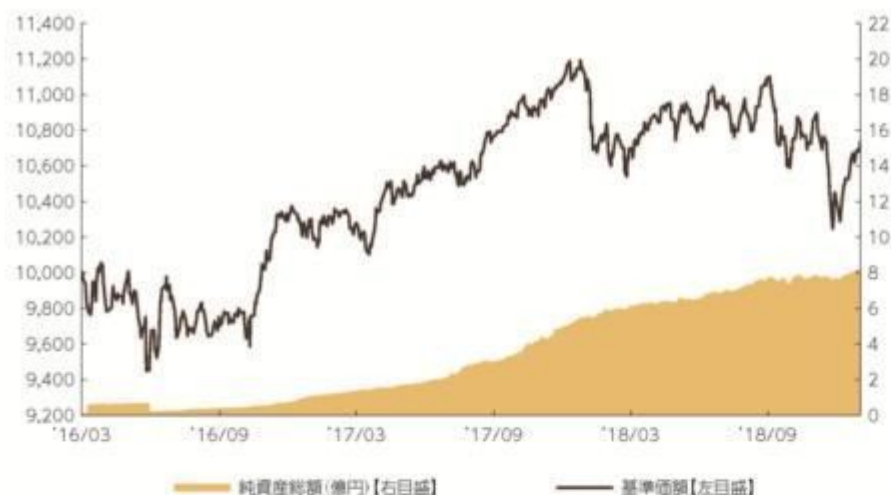


- 収益率は基準価額で計算
- 2016年は設定日から年末までの、2019年は年初から1月31日までの収益率を表示
- 2015年以前はベンチマークの年間収益率、2010年はベンチマーク起算日(9月10日)から年末までの収益率を表示

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)～2019年1月31日



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

## ■基準価額・純資産

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 10,733円 |
| 純資産総額 | 8.2億円   |

## ■分配の推移

|         |    |
|---------|----|
| 2019年1月 | 0円 |
| 2018年1月 | 0円 |
| 2017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

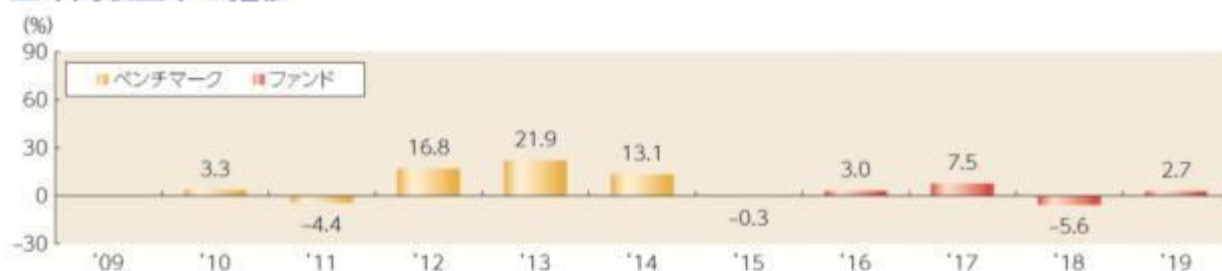
## ■主要な資産の状況

| 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               | 12.9%  | 1 円         | 54.8% | トヨタ自動車                   | 株式  | 輸送用機器              | 日本   | 0.4% |
| 国内債券               | 35.5%  | 2 アメリカドル    | 22.4% | 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 | 0.3% |
| 国内リート              | 3.9%   | 3 ユーロ       | 8.8%  | MICROSOFT CORP           | 株式  | ソフトウェア・サービス        | アメリカ | 0.3% |
| 外国株式               | 17.1%  | 4 イギリスポンド   | 2.4%  | AMAZON.COM INC           | 株式  | 小売                 | アメリカ | 0.3% |
| 外国債券               | 20.5%  | 5 香港ドル      | 1.2%  | 第312回利付国債(10年)           | 債券  | 国債                 | 日本   | 0.4% |
| 外国リート              | 6.4%   | 6 オーストラリアドル | 1.2%  | 第351回利付国債(10年)           | 債券  | 国債                 | 日本   | 0.4% |
| コールローン他<br>(負債控除後) | 3.7%   | 7 カナダドル     | 1.0%  | 第329回利付国債(10年)           | 債券  | 国債                 | 日本   | 0.4% |
| 合計                 | 100.0% | 8 ブラジルレアル   | 0.7%  | SIMON PROPERTY GROUP INC | リート | ---                | アメリカ | 0.3% |
|                    |        | 9 南アフリカランド  | 0.7%  | 日本ビルファンド投資法人             | リート | ---                | 日本   | 0.3% |
|                    |        | 10 メキシコペソ   | 0.6%  | ジャパンリアルエステイト投資法人         | リート | ---                | 日本   | 0.3% |

| その他資産の状況         | 比率   |
|------------------|------|
| 株価指数先物取引 (買建)    | 0.9% |
| 債券先物取引 (買建)      | 0.0% |
| 不動産投信指数先物取引 (買建) | 0.1% |

- 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。

## ■年間収益率の推移



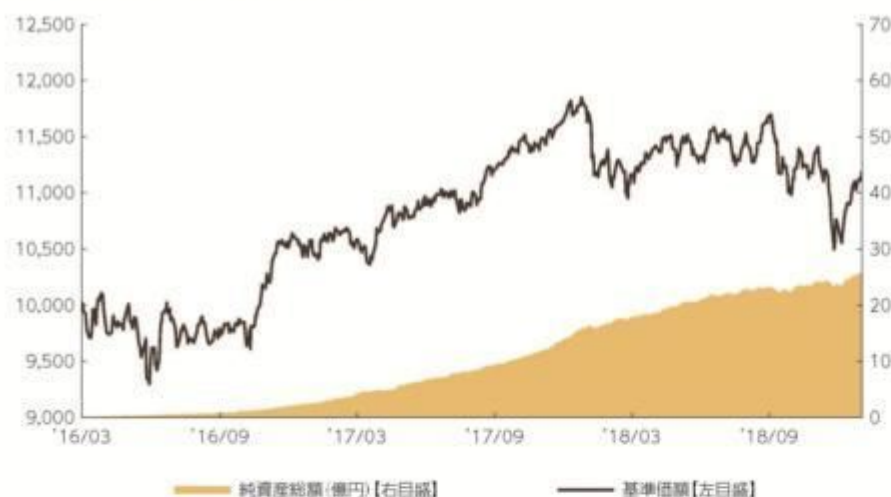
- 収益率は基準価額で計算
- 2016年は設定日から年末までの、2019年は年初から1月31日までの収益率を表示
- 2015年以前はベンチマークの年間収益率、2010年はベンチマーク起算日(9月10日)から年末までの収益率を表示

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)～2019年1月31日



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

## ■基準価額・純資産

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 11,184円 |
| 純資産総額 | 25.8億円  |

## ■分配の推移

|         |    |
|---------|----|
| 2019年1月 | 0円 |
| 2018年1月 | 0円 |
| 2017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

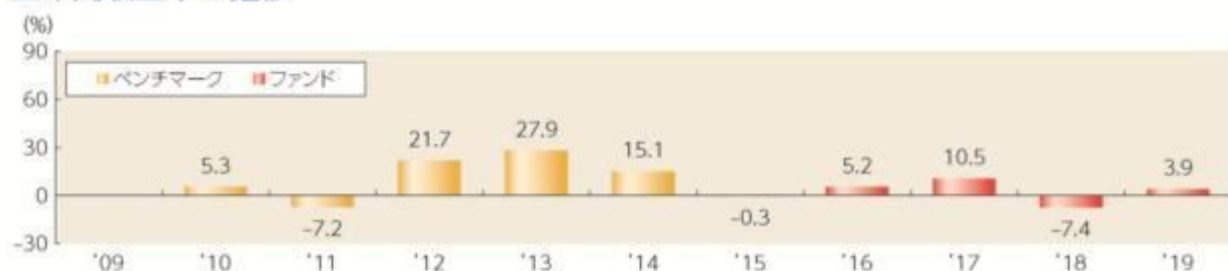
## ■主要な資産の状況

| 資産別構成              | 比率     | 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               | 16.9%  | 1 円         | 49.7% | トヨタ自動車                   | 株式  | 輸送用機器           | 日本   | 0.6% |
| 国内債券               | 23.6%  | 2 アメリカドル    | 23.5% | APPLE INC                | 株式  | テクノロジー/ウェアラブル機器 | アメリカ | 0.4% |
| 国内リート              | 5.9%   | 3 ユーロ       | 5.6%  | MICROSOFT CORP           | 株式  | ソフトウェア・サービス     | アメリカ | 0.4% |
| 外国株式               | 24.7%  | 4 香港ドル      | 2.2%  | TENCENT HOLDINGS LTD     | 株式  | メディア・娯楽         | 香港   | 0.4% |
| 外国債券               | 14.5%  | 5 イギリスポンド   | 2.1%  | 第312回利付国債(10年)           | 債券  | 国債              | 日本   | 0.3% |
| 外国リート              | 9.5%   | 6 ブラジルレアル   | 1.4%  | 第351回利付国債(10年)           | 債券  | 国債              | 日本   | 0.3% |
| コールローン他<br>(負債控除後) | 4.9%   | 7 オーストラリアドル | 1.3%  | 第329回利付国債(10年)           | 債券  | 国債              | 日本   | 0.2% |
| 合計                 | 100.0% | 8 南アフリカランド  | 1.2%  | SIMON PROPERTY GROUP INC | リート | -               | アメリカ | 0.5% |
|                    |        | 9 韓国ウォン     | 1.1%  | 日本ビルファンド投資法人             | リート | -               | 日本   | 0.4% |
|                    |        | 10 メキシコペソ   | 1.1%  | ジャパンリアルエステイト投資法人         | リート | -               | 日本   | 0.4% |

| その他資産の状況         | 比率   |
|------------------|------|
| 株価指数先物取引 (買建)    | 1.3% |
| 債券先物取引 (買建)      | 0.0% |
| 不動産投信指数先物取引 (買建) | 0.1% |

- 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。

## ■年間収益率の推移



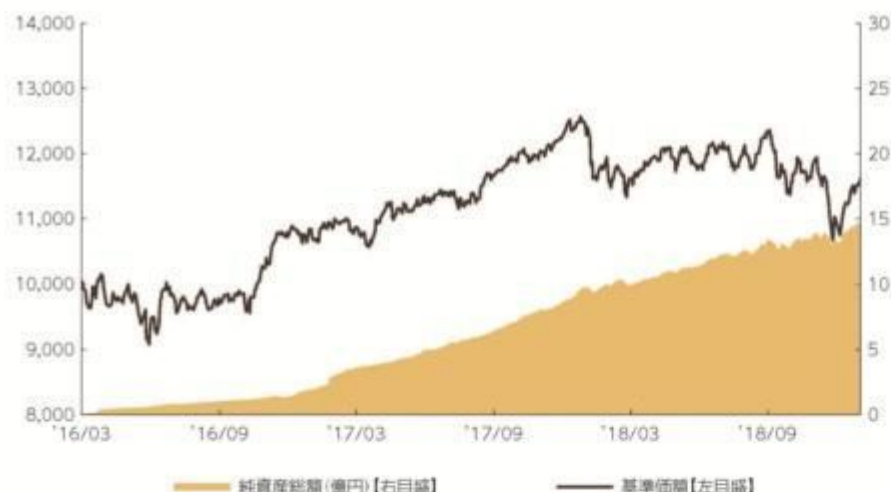
- 収益率は基準価額で計算
- 2016年は設定日から年末までの、2019年は年初から1月31日までの収益率を表示
- 2015年以前はベンチマークの年間収益率、2010年はベンチマーク起算日(9月10日)から年末までの収益率を表示

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)～2019年1月31日



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

## ■基準価額・純資産

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 11,615円 |
| 純資産総額 | 14.7億円  |

## ■分配の推移

|         |    |
|---------|----|
| 2019年1月 | 0円 |
| 2018年1月 | 0円 |
| 2017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

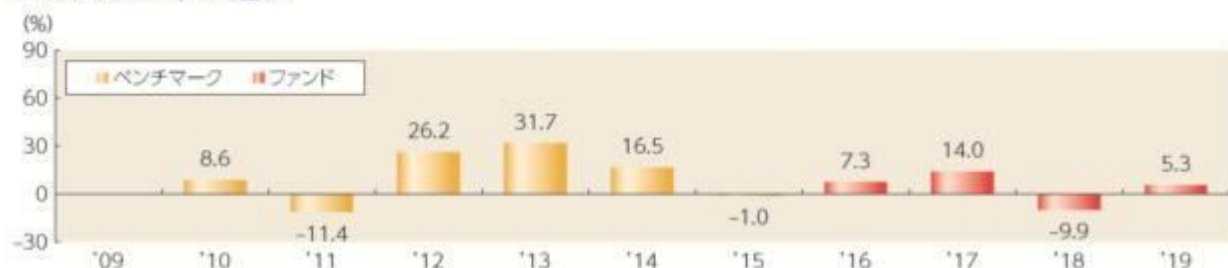
## ■主要な資産の状況

| 資産別構成              | 比率     | 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               | 21.8%  | 1 円          | 37.9% | トヨタ自動車                   | 株式  | 輸送用機器              | 日本   | 0.7% |
| 国内債券               | 4.9%   | 2 アメリカドル     | 28.1% | TENCENT HOLDINGS LTD     | 株式  | メディア・娯楽            | 香港   | 0.5% |
| 国内リート              | 7.9%   | 3 ユーロ        | 4.5%  | 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% |
| 外国株式               | 33.8%  | 4 香港ドル       | 3.2%  | MICROSOFT CORP           | 株式  | ソフトウェア・サービス        | アメリカ | 0.5% |
| 外国債券               | 13.4%  | 5 イギリスポンド    | 2.3%  | 5.5 CHILE (GL) 200805    | 債券  | 国債                 | チリ   | 0.3% |
| 外国リート              | 12.7%  | 6 ブラジルレアル    | 2.1%  | 10(IN)BRAZIL NTN-F230101 | 債券  | 国債                 | ブラジル | 0.2% |
|                    |        | 7 南アフリカランド   | 1.8%  | BRAZIL-LTN 200701        | 債券  | 国債                 | ブラジル | 0.2% |
| コールローン他<br>(負債控除後) | 5.5%   | 8 韓国ウォン      | 1.6%  | SIMON PROPERTY GROUP INC | リート | -                  | アメリカ | 0.6% |
| 合計                 | 100.0% | 9 メキシコペソ     | 1.5%  | 日本ビルファンド投資法人             | リート | -                  | 日本   | 0.6% |
|                    |        | 10 オーストラリアドル | 1.5%  | ジャパンリアルエステイト投資法人         | リート | -                  | 日本   | 0.6% |

| その他資産の状況         | 比率   |
|------------------|------|
| 株価指数先物取引 (買建)    | 1.7% |
| 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。
- 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。

## ■年間収益率の推移

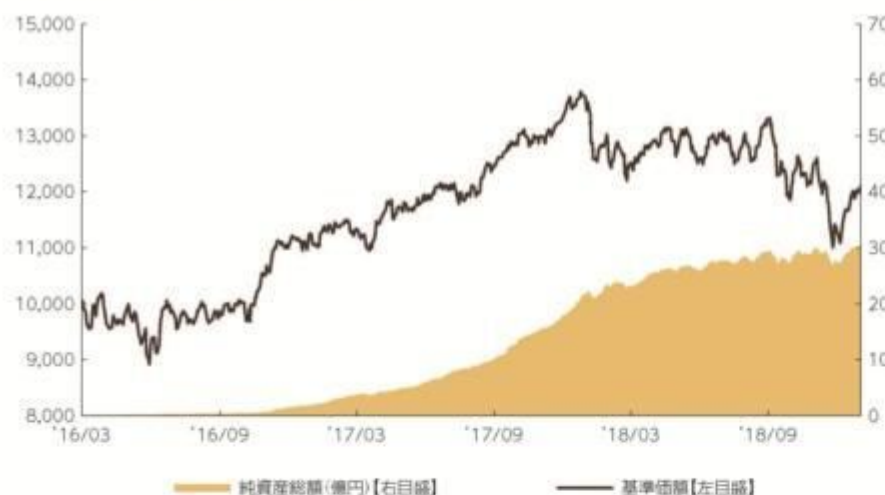


- 収益率は基準価額で計算
- 2016年は設定日から年末までの、2019年は年初から1月31日までの収益率を表示
- 2015年以前はベンチマークの年間収益率、2010年はベンチマーク起算日(9月10日)から年末までの収益率を表示

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)～2019年1月31日



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

## ■基準価額・純資産

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 12,099円 |
| 純資産総額 | 30.3億円  |

## ■分配の推移

|         |    |
|---------|----|
| 2019年1月 | 0円 |
| 2018年1月 | 0円 |
| 2017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

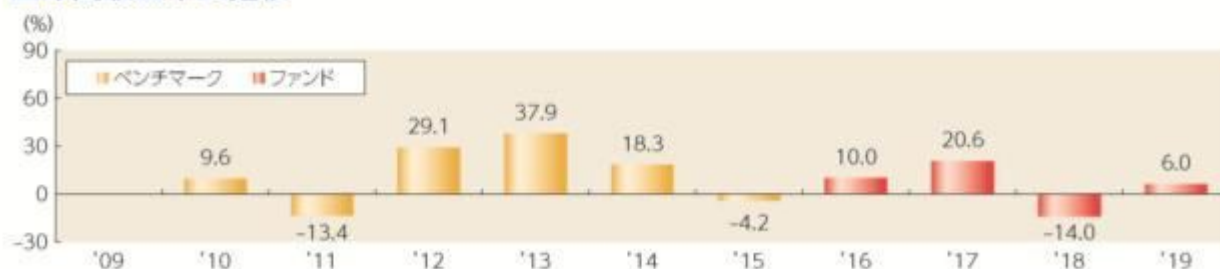
## ■主要な資産の状況

| 資産別構成              | 比率     | 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               | 26.8%  | 1 円         | 33.5% | TENCENT HOLDINGS LTD         | 株式  | メディア・娯楽            | 香港   | 1.4% |
| 国内債券               | 0.5%   | 2 アメリカドル    | 29.1% | ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR | 株式  | 小売                 | アメリカ | 1.2% |
| 国内リート              | 2.0%   | 3 香港ドル      | 7.0%  | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD   | 株式  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 韓国   | 1.1% |
| 外国株式               | 57.3%  | 4 ユーロ       | 4.3%  | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 株式  | 半導体・半導体製造装置        | 台湾   | 1.0% |
| 外国債券               | 1.5%   | 5 韓国ウォン     | 4.0%  | 5.5 CHILE (GL) 200805        | 債券  | 国債                 | チリ   | 0.0% |
| 外国リート              | 4.9%   | 6 ニュー台湾ドル   | 3.0%  | 10(IN)BRAZIL NTN-F230101     | 債券  | 国債                 | ブラジル | 0.0% |
| コールローン他<br>(負債控除後) | 7.0%   | 7 インドルピー    | 2.4%  | BRAZIL-LTN 200701            | 債券  | 国債                 | ブラジル | 0.0% |
| 合計                 | 100.0% | 8 ブラジルレアル   | 2.4%  | SIMON PROPERTY GROUP INC     | リート | -                  | アメリカ | 0.2% |
|                    |        | 9 イギリスポンド   | 2.3%  | PROLOGIS INC                 | リート | -                  | アメリカ | 0.2% |
|                    |        | 10 南アフリカランド | 1.9%  | 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   |
|------------------|------|
| 株値指数先物取引 (買建)    | 3.0% |
| 債券先物取引 (買建)      | 0.0% |
| 不動産投信指数先物取引 (買建) | 0.0% |

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

## ■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2016年は設定日から年末までの、2019年は年初から1月31日までの収益率を表示
- 2015年以前はベンチマークの年間収益率、2010年はベンチマーク起算日(9月10日)から年末までの収益率を表示

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】

## 申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みができません。

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

香港取引所の休業日

香港の銀行の休業日

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

## 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

## 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

## 申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

## 申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

## 申込手数料

ありません。

## 申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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

## 申込受付時間

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会

社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

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。

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。

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】

解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

香港取引所の休業日

香港の銀行の休業日

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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

れます。

#### 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

#### 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

#### 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

#### 解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

#### 解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

#### 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。

#### 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。

#### 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】

基準価額の算出方法

基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

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

（資産の評価方法）

#### ・株式 / 上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券

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

#### ・転換社債 / 転換社債型新株予約権付社債

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

#### ・公社債等

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

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

#### ・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

#### ・投資信託証券（上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

#### ・外貨建資産

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

・外国為替予約取引

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

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

#### 基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

#### 基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

(受付時間：営業日の9:00～17:00)

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

無期限(2016年3月30日設定)

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

#### (4)【計算期間】

毎年1月27日から翌年1月26日まで

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

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

#### (5)【その他】

##### 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10億口を下回るようになった場合
- ・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。

##### 信託約款の変更等

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



出ます。

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

#### ファンドの償還等に関する開示方法

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

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

#### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

#### 関係法人との契約の更改

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

#### 運用報告書

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

#### 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

#### 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

#### 信託事務の再信託

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

の事務を行います。

#### 公告

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

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

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

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

##### (1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

分配金受取コース（一般コース）

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

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

分配金再投資コース（累積投資コース）

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

##### (2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に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（平成30年1月27日から平成31年1月28日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第2期<br>[平成30年 1月26日現在] | 第3期<br>[平成31年 1月28日現在] |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                        |                        |
| 流動資産            |                        |                        |
| コール・ローン         | 7,552,624              | 11,606,015             |
| 親投資信託受益証券       | 572,460,655            | 904,618,956            |
| 未収入金            | 294,787                | 30,993                 |
| 流動資産合計          | 580,308,066            | 916,255,964            |
| 資産合計            | 580,308,066            | 916,255,964            |
| <b>負債の部</b>     |                        |                        |
| 流動負債            |                        |                        |
| 未払解約金           | 1,115,998              | 381,469                |
| 未払受託者報酬         | 107,737                | 261,973                |
| 未払委託者報酬         | 789,986                | 1,921,071              |
| 未払利息            | 11                     | 22                     |
| その他未払費用         | 6,408                  | 15,675                 |
| 流動負債合計          | 2,020,140              | 2,580,210              |
| 負債合計            | 2,020,140              | 2,580,210              |
| <b>純資産の部</b>    |                        |                        |
| 元本等             |                        |                        |
| 元本              | 548,866,385            | 888,912,483            |
| 剰余金             |                        |                        |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 29,421,541             | 24,763,271             |
| （分配準備積立金）       | 9,448,550              | 13,863,577             |
| 元本等合計           | 578,287,926            | 913,675,754            |
| 純資産合計           | 578,287,926            | 913,675,754            |
| 負債純資産合計         | 580,308,066            | 916,255,964            |

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

|   | 第2期    |                | 第3期            |        |                |                |
|---|--------|----------------|----------------|--------|----------------|----------------|
|   | 自<br>至 | 平成29年<br>平成30年 | 1月27日<br>1月26日 | 自<br>至 | 平成30年<br>平成31年 | 1月27日<br>1月28日 |
| 営業収益                                      |        |                |                |        |                |                |
| 受取利息                                      |        |                | 19             |        |                | 22             |
| 有価証券売買等損益                                 |        |                | 13,261,277     |        |                | 11,097,663     |
| 営業収益合計                                    |        |                | 13,261,296     |        |                | 11,097,641     |
| 営業費用                                      |        |                |                |        |                |                |
| 支払利息                                      |        |                | 1,556          |        |                | 5,905          |
| 受託者報酬                                     |        |                | 144,818        |        |                | 469,732        |
| 委託者報酬                                     |        |                | 1,061,859      |        |                | 3,444,521      |
| その他費用                                     |        |                | 8,571          |        |                | 28,135         |
| 営業費用合計                                    |        |                | 1,216,804      |        |                | 3,948,293      |
| 営業利益又は営業損失( )                             |        |                | 12,044,492     |        |                | 15,045,934     |
| 経常利益又は経常損失( )                             |        |                | 12,044,492     |        |                | 15,045,934     |
| 当期純利益又は当期純損失( )                           |        |                | 12,044,492     |        |                | 15,045,934     |
| 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( ) |        |                | 2,854,536      |        |                | 3,490,652      |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )                           |        |                | 62,267         |        |                | 29,421,541     |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            |        |                | 23,250,266     |        |                | 25,559,651     |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |        |                | 23,250,266     |        |                | 25,559,651     |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            |        |                | 2,956,414      |        |                | 18,662,639     |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |        |                | 2,956,414      |        |                | 18,662,639     |
| 分配金                                       |        |                | -              |        |                | -              |
| 期末剰余金又は期末欠損金( )                           |        |                | 29,421,541     |        |                | 24,763,271     |

## （３）【注記表】

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                            |   |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。   |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | ファンドの計算期間<br>当ファンドは、原則として毎年1月26日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成30年 1月27日から平成31年 1月28日までとなっております。 |

## （貸借対照表に関する注記）

|           | 第2期<br>[平成30年 1月26日現在] | 第3期<br>[平成31年 1月28日現在] |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 1. 期首元本額  | 79,590,589円            | 548,866,385円           |
| 期中追加設定元本額 | 637,544,173円           | 738,319,664円           |
| 期中一部解約元本額 | 168,268,377円           | 398,273,566円           |
| 2. 受益権の総数 | 548,866,385口           | 888,912,483口           |

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 第2期<br>自 平成29年 1月27日<br>至 平成30年 1月26日 |              |              | 第3期<br>自 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28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            | 3,422,931円   | 費用控除後の配当等収益額                          | A            | 8,681,782円   |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額             | B            | 5,767,025円   | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額             | B            | 円            |
| 収益調整金額                                | C            | 19,972,991円  | 収益調整金額                                | C            | 18,935,617円  |
| 分配準備積立金額                              | D            | 258,594円     | 分配準備積立金額                              | D            | 5,181,795円   |
| 当ファンドの分配対象収益額                         | E=A+B+C+D    | 29,421,541円  | 当ファンドの分配対象収益額                         | E=A+B+C+D    | 32,799,194円  |
| 当ファンドの期末残存口数                          | F            | 548,866,385口 | 当ファンドの期末残存口数                          | F            | 888,912,483口 |
| 1万口当たり収益分配対象額                         | G=E/F*10,000 | 536円         | 1万口当たり収益分配対象額                         | G=E/F*10,000 | 368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2期<br>自 平成29年 1月27日<br>至 平成30年 1月26日  | 第3期<br>自 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日 |
|--------------------------|--|---------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。  | 同左                                    |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。  | 同左                                    |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> | 同左                                    |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                   | 第2期<br>[平成30年 1月26日現在]  | 第3期<br>[平成31年 1月28日現在]   |
|----------------------|---|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。  | 同左   |
| 2. 時価の算定方法           | <p>(1) 有価証券<br/>           売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引<br/>           デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品<br/>           上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> | <p>(1) 有価証券<br/>           同左</p> <p>(2) デリバティブ取引<br/>           同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品<br/>           同左</p> |

| 区分                         | 第2期   | 第3期             |
|----------------------------|---|-----------------|
|                            | [平成30年 1月26日現在]   | [平成31年 1月28日現在] |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左              |

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種類        | 第2期                      | 第3期                      |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | [平成30年 1月26日現在]          | [平成31年 1月28日現在]          |
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) |
| 親投資信託受益証券 | 11,407,697               | 7,515,201                |
| 合計        | 11,407,697               | 7,515,201                |

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

|              | 第2期             | 第3期             |
|--------------|-----------------|-----------------|
|              | [平成30年 1月26日現在] | [平成31年 1月28日現在] |
| 1口当たり純資産額    | 1.0536円         | 1.0279円         |
| (1万口当たり純資産額) | (10,536円)       | (10,279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 | 16,988,146  | 27,750,136  |    |
|           | 東証REIT指数マザーファンド    | 6,289,579   | 18,542,307  |    |
|           | TOPIXマザーファンド       | 54,738,389  | 91,396,688  |    |
|           | 外国株式インデックスマザーファンド  | 28,637,889  | 73,464,776  |    |
|           | 日本債券インデックスマザーファンド  | 326,153,971 | 437,405,090 |    |
|           | 外国債券インデックスマザーファンド  | 127,367,668 | 256,059,959 |    |
| 合計        |                    | 560,175,642 | 904,618,956 |    |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第2期<br>[平成30年 1月26日現在] | 第3期<br>[平成31年 1月28日現在] |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                        |                        |
| 流動資産            |                        |                        |
| コール・ローン         | 7,647,024              | 10,663,906             |
| 親投資信託受益証券       | 541,387,350            | 807,819,664            |
| 未収入金            | 2,308,281              | 236,697                |
| 流動資産合計          | 551,342,655            | 818,720,267            |
| <b>負債の部</b>     |                        |                        |
| 流動負債            |                        |                        |
| 未払解約金           | 3,491,155              | 732,577                |
| 未払受託者報酬         | 118,663                | 249,681                |
| 未払委託者報酬         | 870,166                | 1,830,976              |
| 未払利息            | 11                     | 20                     |
| その他未払費用         | 7,055                  | 14,947                 |
| 流動負債合計          | 4,487,050              | 2,828,201              |
| 負債合計            | 4,487,050              | 2,828,201              |
| <b>純資産の部</b>    |                        |                        |
| 元本等             |                        |                        |
| 元本              | 490,670,872            | 763,076,768            |
| 剰余金             |                        |                        |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 56,184,733             | 52,815,298             |
| （分配準備積立金）       | 21,068,203             | 25,319,610             |
| 元本等合計           | 546,855,605            | 815,892,066            |
| 純資産合計           | 546,855,605            | 815,892,066            |
| 負債純資産合計         | 551,342,655            | 818,720,267            |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|   | 第2期 |                              | 第3期 |                              |
|---|-----|------------------------------|-----|------------------------------|
|   | 自   | 平成29年 1月27日<br>至 平成30年 1月26日 | 自   | 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日 |
| 営業収益                                      |     |                              |     |                              |
| 受取利息                                      |     | 28                           |     | 25                           |
| 有価証券売買等損益                                 |     | 26,055,722                   |     | 21,091,573                   |
| 営業収益合計                                    |     | 26,055,750                   |     | 21,091,548                   |
| 営業費用                                      |     |                              |     |                              |
| 支払利息                                      |     | 2,211                        |     | 6,069                        |
| 受託者報酬                                     |     | 167,240                      |     | 449,485                      |
| 委託者報酬                                     |     | 1,226,312                    |     | 3,296,136                    |
| その他費用                                     |     | 9,906                        |     | 26,938                       |
| 営業費用合計                                    |     | 1,405,669                    |     | 3,778,628                    |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             |     | 24,650,081                   |     | 24,870,176                   |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             |     | 24,650,081                   |     | 24,870,176                   |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           |     | 24,650,081                   |     | 24,870,176                   |
| 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（ ） |     | 4,799,057                    |     | 4,761,477                    |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           |     | 2,505,958                    |     | 56,184,733                   |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            |     | 41,697,752                   |     | 43,266,124                   |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |     | 41,697,752                   |     | 43,266,124                   |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            |     | 7,870,001                    |     | 26,526,860                   |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |     | 7,870,001                    |     | 26,526,860                   |
| 分配金                                       |     | -                            |     | -                            |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           |     | 56,184,733                   |     | 52,815,298                   |

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                            |   |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。   |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | ファンドの計算期間<br>当ファンドは、原則として毎年1月26日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成30年 1月27日から平成31年 1月28日までとなっております。 |

## (貸借対照表に関する注記)

|           | 第2期<br>[平成30年 1月26日現在] | 第3期<br>[平成31年 1月28日現在] |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 1. 期首元本額  | 101,532,238円           | 490,670,872円           |
| 期中追加設定元本額 | 549,171,328円           | 529,756,983円           |
| 期中一部解約元本額 | 160,032,694円           | 257,351,087円           |
| 2. 受益権の総数 | 490,670,872口           | 763,076,768口           |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第2期<br>自 平成29年 1月27日<br>至 平成30年 1月26日 |              |              | 第3期<br>自 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28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            | 5,065,723円   | 費用控除後の配当等収益額                          | A            | 11,180,319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            | 14,785,301円  | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額             | B            | 円            |
| 収益調整金額                                | C            | 35,116,530円  | 収益調整金額                                | C            | 36,540,628円  |
| 分配準備積立金額                              | D            | 1,217,179円   | 分配準備積立金額                              | D            | 14,139,291円  |
| 当ファンドの分配対象収益額                         | E=A+B+C+D    | 56,184,733円  | 当ファンドの分配対象収益額                         | E=A+B+C+D    | 61,860,238円  |
| 当ファンドの期末残存口数                          | F            | 490,670,872口 | 当ファンドの期末残存口数                          | F            | 763,076,768口 |
| 1万口当たり収益分配対象額                         | G=E/F*10,000 | 1,145円       | 1万口当たり収益分配対象額                         | G=E/F*10,000 | 810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2期<br>自 平成29年 1月27日<br>至 平成30年 1月26日   | 第3期<br>自 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日 |
|--------------------------|---|---------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。   | 同左                                    |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。   | 同左                                    |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。<br>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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。 | 同左                                    |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                   | 第2期<br>[平成30年 1月26日現在]   | 第3期<br>[平成31年 1月28日現在]                                      |
|----------------------|--|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。   | 同左  |
| 2. 時価の算定方法           | (1) 有価証券<br>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。<br>(2) デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、該当事項はありません。<br>(3) 上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 | (1) 有価証券<br>同左<br>(2) デリバティブ取引<br>同左<br>(3) 上記以外の金融商品<br>同左 |

| 区分 | 第2期<br>[平成30年 1月26日現在]     | 第3期<br>[平成31年 1月28日現在]  |
|----|----------------------------|---|
|    | 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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        | 第2期<br>[平成30年 1月26日現在]   | 第3期<br>[平成31年 1月28日現在]   |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) |
| 親投資信託受益証券 | 23,458,390               | 16,767,672               |
| 合計        | 23,458,390               | 16,767,672               |

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

|              | 第2期<br>[平成30年 1月26日現在] | 第3期<br>[平成31年 1月28日現在] |
|--------------|------------------------|------------------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.1145円                | 1.0692円                |
| (1万口当たり純資産額) | (11,145円)              | (10,692円)              |

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

| 種類            | 銘柄                 | 口数          | 評価額         | 備考 |
|---------------|--------------------|-------------|-------------|----|
| 親投資信託受益<br>証券 | MUAM G-REITマザーファンド | 30,270,661  | 49,447,124  |    |
|               | 新興国株式インデックスマザーファンド | 13,904,243  | 33,096,269  |    |
|               | 東証REIT指数マザーファンド    | 11,208,678  | 33,044,303  |    |
|               | 新興国債券インデックスマザーファンド | 24,740,097  | 32,790,524  |    |
|               | TOPIXマザーファンド       | 68,274,122  | 113,997,301 |    |
|               | 外国株式インデックスマザーファンド  | 44,658,982  | 114,563,686 |    |
|               | 日本債券インデックスマザーファンド  | 217,982,772 | 292,336,695 |    |
|               | 外国債券インデックスマザーファンド  | 68,913,531  | 138,543,762 |    |
|               | 合計                 | 479,953,086 | 807,819,664 |    |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第2期<br>[平成30年 1月26日現在] | 第3期<br>[平成31年 1月28日現在] |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                        |                        |
| 流動資産            |                        |                        |
| コール・ローン         | 35,936,810             | 34,700,126             |
| 親投資信託受益証券       | 1,576,720,288          | 2,537,351,501          |
| 流動資産合計          | 1,612,657,098          | 2,572,051,627          |
| 資産合計            | 1,612,657,098          | 2,572,051,627          |
| <b>負債の部</b>     |                        |                        |
| 流動負債            |                        |                        |
| 未払解約金           | 17,060,038             | 2,954,612              |
| 未払受託者報酬         | 348,045                | 766,314                |
| 未払委託者報酬         | 2,552,282              | 5,619,530              |
| 未払利息            | 53                     | 66                     |
| その他未払費用         | 20,820                 | 45,983                 |
| 流動負債合計          | 19,981,238             | 9,386,505              |
| 負債合計            | 19,981,238             | 9,386,505              |
| <b>純資産の部</b>    |                        |                        |
| 元本等             |                        |                        |
| 元本              | 1,350,710,899          | 2,303,430,954          |
| 剰余金             |                        |                        |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 241,964,961            | 259,234,168            |
| （分配準備積立金）       | 94,658,875             | 117,874,683            |
| 元本等合計           | 1,592,675,860          | 2,562,665,122          |
| 純資産合計           | 1,592,675,860          | 2,562,665,122          |
| 負債純資産合計         | 1,612,657,098          | 2,572,051,627          |



## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|   | 第2期 |                              | 第3期 |                              |
|---|-----|------------------------------|-----|------------------------------|
|   | 自   | 平成29年 1月27日<br>至 平成30年 1月26日 | 自   | 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日 |
| 営業収益                                      |     |                              |     |                              |
| 受取利息                                      |     | 81                           |     | 84                           |
| 有価証券売買等損益                                 |     | 106,710,504                  |     | 90,908,800                   |
| 営業収益合計                                    |     | 106,710,585                  |     | 90,908,716                   |
| 営業費用                                      |     |                              |     |                              |
| 支払利息                                      |     | 6,756                        |     | 17,937                       |
| 受託者報酬                                     |     | 500,563                      |     | 1,366,805                    |
| 委託者報酬                                     |     | 3,670,688                    |     | 10,023,047                   |
| その他費用                                     |     | 29,912                       |     | 82,141                       |
| 営業費用合計                                    |     | 4,207,919                    |     | 11,489,930                   |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             |     | 102,502,666                  |     | 102,398,646                  |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             |     | 102,502,666                  |     | 102,398,646                  |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           |     | 102,502,666                  |     | 102,398,646                  |
| 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（ ） |     | 13,148,270                   |     | 10,992,197                   |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           |     | 11,750,201                   |     | 241,964,961                  |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            |     | 166,496,768                  |     | 181,200,528                  |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |     | 166,496,768                  |     | 181,200,528                  |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            |     | 25,636,404                   |     | 72,524,872                   |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |     | 25,636,404                   |     | 72,524,872                   |
| 分配金                                       |     | -                            |     | -                            |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           |     | 241,964,961                  |     | 259,234,168                  |

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                            |   |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。   |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | ファンドの計算期間<br>当ファンドは、原則として毎年1月26日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成30年 1月27日から平成31年 1月28日までとなっております。 |

## (貸借対照表に関する注記)

|           | 第2期<br>[平成30年 1月26日現在] | 第3期<br>[平成31年 1月28日現在] |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 1. 期首元本額  | 227,836,215円           | 1,350,710,899円         |
| 期中追加設定元本額 | 1,456,517,138円         | 1,396,610,241円         |
| 期中一部解約元本額 | 333,642,454円           | 443,890,186円           |
| 2. 受益権の総数 | 1,350,710,899口         | 2,303,430,954口         |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第2期<br>自 平成29年 1月27日<br>至 平成30年 1月26日 |              |                | 第3期<br>自 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28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            | 18,116,176円    | 費用控除後の配当等収益額                          | A            | 43,112,385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            | 71,238,220円    | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額             | B            | 円              |
| 収益調整金額                                | C            | 147,306,086円   | 収益調整金額                                | C            | 175,146,976円   |
| 分配準備積立金額                              | D            | 5,304,479円     | 分配準備積立金額                              | D            | 74,762,298円    |
| 当ファンドの分配対象収益額                         | E=A+B+C+D    | 241,964,961円   | 当ファンドの分配対象収益額                         | E=A+B+C+D    | 293,021,659円   |
| 当ファンドの期末残存口数                          | F            | 1,350,710,899口 | 当ファンドの期末残存口数                          | F            | 2,303,430,954口 |
| 1万口当たり収益分配対象額                         | G=E/F*10,000 | 1,791円         | 1万口当たり収益分配対象額                         | G=E/F*10,000 | 1,272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2期<br>自 平成29年 1月27日<br>至 平成30年 1月26日   | 第3期<br>自 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日 |
|--------------------------|---|---------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。   | 同左                                    |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。   | 同左                                    |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。<br>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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。 | 同左                                    |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                   | 第2期<br>[平成30年 1月26日現在]   | 第3期<br>[平成31年 1月28日現在]                                      |
|----------------------|--|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。   | 同左  |
| 2. 時価の算定方法           | (1) 有価証券<br>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。<br>(2) デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、該当事項はありません。<br>(3) 上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 | (1) 有価証券<br>同左<br>(2) デリバティブ取引<br>同左<br>(3) 上記以外の金融商品<br>同左 |

| 区分                         | 第2期   | 第3期             |
|----------------------------|---|-----------------|
|                            | [平成30年 1月26日現在]   | [平成31年 1月28日現在] |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左              |

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種類        | 第2期                      | 第3期                      |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | [平成30年 1月26日現在]          | [平成31年 1月28日現在]          |
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) |
| 親投資信託受益証券 | 104,139,225              | 82,671,765               |
| 合計        | 104,139,225              | 82,671,765               |

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

|              | 第2期             | 第3期             |
|--------------|-----------------|-----------------|
|              | [平成30年 1月26日現在] | [平成31年 1月28日現在] |
| 1口当たり純資産額    | 1.1791円         | 1.1125円         |
| (1万口当たり純資産額) | (11,791円)       | (11,125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 | 142,230,726   | 232,333,890   |    |
|           | 新興国株式インデックスマザーファンド | 87,146,873    | 207,435,701   |    |
|           | 東証REIT指数マザーファンド    | 52,607,383    | 155,091,825   |    |
|           | 新興国債券インデックスマザーファンド | 154,811,371   | 205,186,991   |    |
|           | TOPIXマザーファンド       | 274,979,290   | 459,132,920   |    |
|           | 外国株式インデックスマザーファンド  | 180,279,973   | 462,472,214   |    |
|           | 日本債券インデックスマザーファンド  | 455,972,006   | 611,504,057   |    |
|           | 外国債券インデックスマザーファンド  | 101,568,794   | 204,193,903   |    |
| 合計        |                    | 1,449,596,416 | 2,537,351,501 |    |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第2期<br>[平成30年 1月26日現在] | 第3期<br>[平成31年 1月28日現在] |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                        |                        |
| 流動資産            |                        |                        |
| コール・ローン         | 15,538,185             | 19,343,426             |
| 親投資信託受益証券       | 963,637,082            | 1,448,266,779          |
| 流動資産合計          | 979,175,267            | 1,467,610,205          |
| 資産合計            | 979,175,267            | 1,467,610,205          |
| <b>負債の部</b>     |                        |                        |
| 流動負債            |                        |                        |
| 未払解約金           | 3,833,730              | 1,297,869              |
| 未払受託者報酬         | 232,018                | 432,989                |
| 未払委託者報酬         | 1,701,422              | 3,175,125              |
| 未払利息            | 23                     | 36                     |
| その他未払費用         | 13,859                 | 25,971                 |
| 流動負債合計          | 5,781,052              | 4,931,990              |
| 負債合計            | 5,781,052              | 4,931,990              |
| <b>純資産の部</b>    |                        |                        |
| 元本等             |                        |                        |
| 元本              | 778,712,920            | 1,268,002,510          |
| 剰余金             |                        |                        |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 194,681,295            | 194,675,705            |
| （分配準備積立金）       | 84,736,907             | 93,853,840             |
| 元本等合計           | 973,394,215            | 1,462,678,215          |
| 純資産合計           | 973,394,215            | 1,462,678,215          |
| 負債純資産合計         | 979,175,267            | 1,467,610,205          |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|   | 第2期 |                              | 第3期 |                              |
|---|-----|------------------------------|-----|------------------------------|
|   | 自   | 平成29年 1月27日<br>至 平成30年 1月26日 | 自   | 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日 |
| 営業収益                                      |     |                              |     |                              |
| 受取利息                                      |     | 64                           |     | 50                           |
| 有価証券売買等損益                                 |     | 93,988,088                   |     | 80,665,546                   |
| 営業収益合計                                    |     | 93,988,152                   |     | 80,665,496                   |
| 営業費用                                      |     |                              |     |                              |
| 支払利息                                      |     | 4,690                        |     | 10,410                       |
| 受託者報酬                                     |     | 352,032                      |     | 772,519                      |
| 委託者報酬                                     |     | 2,581,438                    |     | 5,664,925                    |
| その他費用                                     |     | 21,000                       |     | 46,388                       |
| 営業費用合計                                    |     | 2,959,160                    |     | 6,494,242                    |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             |     | 91,028,992                   |     | 87,159,738                   |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             |     | 91,028,992                   |     | 87,159,738                   |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           |     | 91,028,992                   |     | 87,159,738                   |
| 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（ ） |     | 12,383,542                   |     | 12,462,455                   |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           |     | 13,369,578                   |     | 194,681,295                  |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            |     | 126,820,066                  |     | 141,712,708                  |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |     | 126,820,066                  |     | 141,712,708                  |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            |     | 24,153,799                   |     | 67,021,015                   |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |     | 24,153,799                   |     | 67,021,015                   |
| 分配金                                       |     | -                            |     | -                            |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           |     | 194,681,295                  |     | 194,675,705                  |

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                            |   |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。   |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | ファンドの計算期間<br>当ファンドは、原則として毎年1月26日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成30年 1月27日から平成31年 1月28日までとなっております。 |

## (貸借対照表に関する注記)

|           | 第2期<br>[平成30年 1月26日現在] | 第3期<br>[平成31年 1月28日現在] |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 1. 期首元本額  | 174,989,746円           | 778,712,920円           |
| 期中追加設定元本額 | 829,352,524円           | 779,203,269円           |
| 期中一部解約元本額 | 225,629,350円           | 289,913,679円           |
| 2. 受益権の総数 | 778,712,920口           | 1,268,002,510口         |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第2期<br>自 平成29年 1月27日<br>至 平成30年 1月26日 |              |              | 第3期<br>自 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28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            | 15,304,607円  | 費用控除後の配当等収益額                          | A            | 30,790,362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            | 63,340,843円  | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額             | B            | 円              |
| 収益調整金額                                | C            | 109,944,388円 | 収益調整金額                                | C            | 142,585,048円   |
| 分配準備積立金額                              | D            | 6,091,457円   | 分配準備積立金額                              | D            | 63,063,478円    |
| 当ファンドの分配対象収益額                         | E=A+B+C+D    | 194,681,295円 | 当ファンドの分配対象収益額                         | E=A+B+C+D    | 236,438,888円   |
| 当ファンドの期末残存口数                          | F            | 778,712,920口 | 当ファンドの期末残存口数                          | F            | 1,268,002,510口 |
| 1万口当たり収益分配対象額                         | G=E/F*10,000 | 2,500円       | 1万口当たり収益分配対象額                         | G=E/F*10,000 | 1,864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2期<br>自 平成29年 1月27日<br>至 平成30年 1月26日  | 第3期<br>自 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日 |
|--------------------------|--|---------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。  | 同左                                    |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。  | 同左                                    |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> | 同左                                    |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                   | 第2期<br>[平成30年 1月26日現在]  | 第3期<br>[平成31年 1月28日現在]   |
|----------------------|---|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。  | 同左   |
| 2. 時価の算定方法           | <p>(1) 有価証券<br/>           売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引<br/>           デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品<br/>           上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> | <p>(1) 有価証券<br/>           同左</p> <p>(2) デリバティブ取引<br/>           同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品<br/>           同左</p> |

| 区分                         | 第2期   | 第3期             |
|----------------------------|---|-----------------|
|                            | [平成30年 1月26日現在]   | [平成31年 1月28日現在] |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左              |

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種類        | 第2期                      | 第3期                      |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | [平成30年 1月26日現在]          | [平成31年 1月28日現在]          |
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) |
| 親投資信託受益証券 | 91,782,530               | 75,177,613               |
| 合計        | 91,782,530               | 75,177,613               |

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

|              | 第2期             | 第3期             |
|--------------|-----------------|-----------------|
|              | [平成30年 1月26日現在] | [平成31年 1月28日現在] |
| 1口当たり純資産額    | 1.2500円         | 1.1535円         |
| (1万口当たり純資産額) | (12,500円)       | (11,535円)       |

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

| 種類            | 銘柄                 | 口数          | 評価額           | 備考 |
|---------------|--------------------|-------------|---------------|----|
| 親投資信託受益<br>証券 | MUAM G-REITマザーファンド | 108,260,683 | 176,843,825   |    |
|               | 新興国株式インデックスマザーファンド | 74,440,123  | 177,189,824   |    |
|               | 東証REIT指数マザーファンド    | 44,930,203  | 132,458,731   |    |
|               | 新興国債券インデックスマザーファンド | 132,206,685 | 175,226,740   |    |
|               | TOPIXマザーファンド       | 200,031,071 | 333,991,879   |    |
|               | 外国株式インデックスマザーファンド  | 136,848,338 | 351,057,041   |    |
|               | 日本債券インデックスマザーファンド  | 54,020,204  | 72,446,495    |    |
|               | 外国債券インデックスマザーファンド  | 14,450,977  | 29,052,244    |    |
|               | 合計                 | 765,188,284 | 1,448,266,779 |    |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第2期<br>[平成30年 1月26日現在] | 第3期<br>[平成31年 1月28日現在] |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                        |                        |
| 流動資産            |                        |                        |
| コール・ローン         | 34,480,032             | 43,013,096             |
| 親投資信託受益証券       | 2,123,837,082          | 2,979,157,343          |
| 未収入金            | -                      | 13,262,029             |
| 流動資産合計          | 2,158,317,114          | 3,035,432,468          |
| <b>負債の部</b>     |                        |                        |
| 流動負債            |                        |                        |
| 未払解約金           | 9,367,808              | 18,669,689             |
| 未払受託者報酬         | 417,179                | 938,192                |
| 未払委託者報酬         | 3,059,241              | 6,880,063              |
| 未払利息            | 51                     | 82                     |
| その他未払費用         | 24,972                 | 56,328                 |
| 流動負債合計          | 12,869,251             | 26,544,354             |
| 負債合計            | 12,869,251             | 26,544,354             |
| <b>純資産の部</b>    |                        |                        |
| 元本等             |                        |                        |
| 元本              | 1,564,432,386          | 2,499,467,267          |
| 剰余金             |                        |                        |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 581,015,477            | 509,420,847            |
| （分配準備積立金）       | 182,038,017            | 171,222,261            |
| 元本等合計           | 2,145,447,863          | 3,008,888,114          |
| 純資産合計           | 2,145,447,863          | 3,008,888,114          |
| 負債純資産合計         | 2,158,317,114          | 3,035,432,468          |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|   | 第2期 |                              | 第3期 |                              |
|---|-----|------------------------------|-----|------------------------------|
|   | 自   | 平成29年 1月27日<br>至 平成30年 1月26日 | 自   | 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日 |
| 営業収益                                      |     |                              |     |                              |
| 受取利息                                      |     | 115                          |     | 129                          |
| 有価証券売買等損益                                 |     | 213,717,338                  |     | 303,479,753                  |
| 営業収益合計                                    |     | 213,717,453                  |     | 303,479,624                  |
| 営業費用                                      |     |                              |     |                              |
| 支払利息                                      |     | 8,661                        |     | 24,560                       |
| 受託者報酬                                     |     | 550,008                      |     | 1,730,523                    |
| 委託者報酬                                     |     | 4,033,260                    |     | 12,690,445                   |
| その他費用                                     |     | 32,874                       |     | 104,046                      |
| 営業費用合計                                    |     | 4,624,803                    |     | 14,549,574                   |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             |     | 209,092,650                  |     | 318,029,198                  |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             |     | 209,092,650                  |     | 318,029,198                  |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           |     | 209,092,650                  |     | 318,029,198                  |
| 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（ ） |     | 31,296,840                   |     | 53,052,882                   |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           |     | 18,842,511                   |     | 581,015,477                  |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            |     | 476,887,551                  |     | 471,068,026                  |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |     | 476,887,551                  |     | 471,068,026                  |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            |     | 92,510,395                   |     | 277,686,340                  |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |     | 92,510,395                   |     | 277,686,340                  |
| 分配金                                       |     | -                            |     | -                            |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           |     | 581,015,477                  |     | 509,420,847                  |

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                            |   |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。   |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | ファンドの計算期間<br>当ファンドは、原則として毎年1月26日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成30年 1月27日から平成31年 1月28日までとなっております。 |

## (貸借対照表に関する注記)

|           | 第2期<br>[平成30年 1月26日現在] | 第3期<br>[平成31年 1月28日現在] |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 1. 期首元本額  | 163,571,930円           | 1,564,432,386円         |
| 期中追加設定元本額 | 1,905,710,622円         | 1,752,807,683円         |
| 期中一部解約元本額 | 504,850,166円           | 817,772,802円           |
| 2. 受益権の総数 | 1,564,432,386口         | 2,499,467,267口         |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第2期<br>自 平成29年 1月27日<br>至 平成30年 1月26日 |              |                | 第3期<br>自 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28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            | 18,275,274円    | 費用控除後の配当等収益額                          | A            | 48,678,657円    |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額             | B            | 159,520,536円   | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額             | B            | 円              |
| 収益調整金額                                | C            | 398,977,460円   | 収益調整金額                                | C            | 338,198,586円   |
| 分配準備積立金額                              | D            | 4,242,207円     | 分配準備積立金額                              | D            | 122,543,604円   |
| 当ファンドの分配対象収益額                         | E=A+B+C+D    | 581,015,477円   | 当ファンドの分配対象収益額                         | E=A+B+C+D    | 509,420,847円   |
| 当ファンドの期末残存口数                          | F            | 1,564,432,386口 | 当ファンドの期末残存口数                          | F            | 2,499,467,267口 |
| 1万口当たり収益分配対象額                         | G=E/F*10,000 | 3,713円         | 1万口当たり収益分配対象額                         | G=E/F*10,000 | 2,038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2期<br>自 平成29年 1月27日<br>至 平成30年 1月26日  | 第3期<br>自 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日 |
|--------------------------|--|---------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。  | 同左                                    |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。  | 同左                                    |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> | 同左                                    |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                   | 第2期<br>[平成30年 1月26日現在]  | 第3期<br>[平成31年 1月28日現在]   |
|----------------------|---|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。  | 同左   |
| 2. 時価の算定方法           | <p>(1) 有価証券<br/>           売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引<br/>           デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品<br/>           上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> | <p>(1) 有価証券<br/>           同左</p> <p>(2) デリバティブ取引<br/>           同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品<br/>           同左</p> |

| 区分                         | 第2期   | 第3期             |
|----------------------------|---|-----------------|
|                            | [平成30年 1月26日現在]   | [平成31年 1月28日現在] |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左              |

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種類        | 第2期                      | 第3期                      |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | [平成30年 1月26日現在]          | [平成31年 1月28日現在]          |
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) |
| 親投資信託受益証券 | 210,058,532              | 276,220,434              |
| 合計        | 210,058,532              | 276,220,434              |

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

|              | 第2期             | 第3期             |
|--------------|-----------------|-----------------|
|              | [平成30年 1月26日現在] | [平成31年 1月28日現在] |
| 1口当たり純資産額    | 1.3714円         | 1.2038円         |
| (1万口当たり純資産額) | (13,714円)       | (12,038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 | 73,970,467    | 120,830,757   |    |
|           | 新興国株式インデックスマザーファンド | 382,422,048   | 910,279,200   |    |
|           | 東証REIT指数マザーファンド    | 20,512,702    | 60,473,496    |    |
|           | 新興国債券インデックスマザーファンド | 22,592,149    | 29,943,634    |    |
|           | TOPIXマザーファンド       | 536,362,776   | 895,564,927   |    |
|           | 外国株式インデックスマザーファンド  | 363,401,348   | 932,233,478   |    |
|           | 日本債券インデックスマザーファンド  | 11,106,288    | 14,894,642    |    |
|           | 外国債券インデックスマザーファンド  | 7,429,969     | 14,937,209    |    |
| 合計        |                    | 1,417,797,747 | 2,979,157,343 |    |

## 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）

[平成31年 1月28日現在]

|          |                 |
|----------|-----------------|
| 資産の部     |                 |
| 流動資産     |                 |
| コール・ローン  | 40,638,052,985  |
| 株式       | 215,537,065,230 |
| 派生商品評価勘定 | 101,110,800     |
| 未収入金     | 526,872,120     |

[平成31年 1月28日現在]

|             |                 |
|-------------|-----------------|
| 未収配当金       | 295,928,058     |
| 未収利息        | 1,755,736       |
| その他未収収益     | 49,736,590      |
| 差入委託証拠金     | 116,325,000     |
| 流動資産合計      | 257,266,846,519 |
| 資産合計        | 257,266,846,519 |
| 負債の部        |                 |
| 流動負債        |                 |
| 派生商品評価勘定    | 1,297,280       |
| 前受金         | 150,835,000     |
| 未払解約金       | 661,550,774     |
| 未払利息        | 77,590          |
| 受入担保金       | 37,089,470,764  |
| その他未払費用     | 118,896         |
| 流動負債合計      | 37,903,350,304  |
| 負債合計        | 37,903,350,304  |
| 純資産の部       |                 |
| 元本等         |                 |
| 元本          | 131,381,540,470 |
| 剰余金         |                 |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 87,981,955,745  |
| 元本等合計       | 219,363,496,215 |
| 純資産合計       | 219,363,496,215 |
| 負債純資産合計     | 257,266,846,519 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                       |   |
|-----------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | 株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。<br>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。   |

(貸借対照表に関する注記)

|                     | [平成31年 1月28日現在]  |
|---------------------|------------------|
| 1. 期首               | 平成30年 1月27日      |
| 期首元本額               | 174,206,950,751円 |
| 期中追加設定元本額           | 111,188,970,467円 |
| 期中一部解約元本額           | 154,014,380,748円 |
| 元本の内訳               |                  |
| ファンド・マネジャー（国内株式）    | 1,187,904,340円   |
| eMAXIS TOPIXインデックス  | 11,434,053,455円  |
| eMAXIS バランス（8資産均等型） | 2,094,038,527円   |
| eMAXIS バランス（波乗り型）   | 99,793,815円      |
| コアバランス              | 617,680円         |

[平成31年 1月28日現在]

|                                  |                 |
|----------------------------------|-----------------|
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金) | 28,582,934円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金) | 51,569,836円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金) | 43,595,829円     |
| eMAXIS Slim 国内株式(TOPIX)          | 3,856,583,090円  |
| 国内株式セレクション(ラップ向け)                | 1,668,911,982円  |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)         | 1,519,529,437円  |
| つみたて日本株式(TOPIX)                  | 2,245,711,043円  |
| つみたて8資産均等バランス                    | 418,325,774円    |
| つみたて4資産均等バランス                    | 100,608,226円    |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s            | 1,594,823円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s            | 1,970,686円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s            | 2,416,692円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金) | 4,960,812円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金) | 5,143,187円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金) | 4,866,796円      |
| eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)        | 151,734,114円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金) | 2,661,586円      |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)           | 36,975,422円     |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)         | 241,898,878円    |
| eMAXIS バランス(4資産均等型)              | 207,922,658円    |
| eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)        | 54,738,389円     |
| eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)        | 68,274,122円     |
| eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)       | 274,979,290円    |
| eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)          | 200,031,071円    |
| eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)         | 536,362,776円    |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)    | 55,998,676円     |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)    | 10,068,789,598円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)  | 255,233,422円    |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)  | 2,886,641,512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)   | 14,483,227,350円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)  | 459,763,943円    |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投資家限定)  | 10,512,386円     |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)    | 6,959,751円      |

|  | [平成31年 1月28日現在]  |
|--|------------------|
| 三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）                      | 66,590,610円      |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）                      | 26,569,276円      |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）                        | 438,823,881円     |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）                        | 924,071,669円     |
| MUAMトピックスリスクコントロール（5%）インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）   | 1,876,872円       |
| MUAMトピックスリスクコントロール（10%）インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）  | 162,234,957円     |
| MUAM インデックスファンドTOPIXi（適格機関投資家限定）                     | 8,726,654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）                | 599,661,202円     |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）                           | 46,894,665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）                     | 2,811,007,831円   |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンド                                     | 9,191,324,543円   |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA                           | 5,240,970円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA                         | 19,167,357円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA                           | 22,025,941円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA                           | 18,467,814円      |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1                                  | 1,683,875,133円   |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンドVA                                   | 306,158,473円     |
| 三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）                           | 46,878,518円      |
| 三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）                           | 308,014,302円     |
| 三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）                           | 31,745,578円      |
| 三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）                           | 205,621,141円     |
| 三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド                                 | 1,919,975,396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）                  | 526,301,128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）                | 2,089,608,463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）                  | 1,744,480,622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）                  | 1,414,216,782円   |
| 三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド                               | 51,988,496,784円  |
| 合計   | 131,381,540,470円 |
| 2. 貸付有価証券<br>貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っており<br>す。<br>株式 | 35,578,377,360円  |
| 3. 受益権の総数  | 131,381,540,470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 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日   |
|-------------------------|--|
| 1.金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。  |
| 2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。<br>当ファンドは、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。<br>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。<br>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。<br>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。  |

2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                        | [平成31年 1月28日現在]  |
|---------------------------|--|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。   |
| 2.時価の算定方法                 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。<br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。<br>(3)上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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 | [平成31年 1月28日現在]    |                |
|----|--------------------|----------------|
|    | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |                |
| 株式 |                    | 19,817,505,573 |
| 合計 |                    | 19,817,505,573 |

（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

[平成31年 1月28日現在]

| 区分   | 種類             | 契約額等（円）       |       | 時価（円）         | 評価損益（円）    |
|------|----------------|---------------|-------|---------------|------------|
|      |                |               | うち1年超 |               |            |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 3,976,765,000 |       | 4,076,720,000 | 99,955,000 |
|      | 合計             | 3,976,765,000 |       | 4,076,720,000 | 99,955,000 |

## （注）時価の算定方法

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

|              | [平成31年 1月28日現在] |
|--------------|-----------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.6697円         |
| (1万口当たり純資産額) | (16,697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               | 4,300   | 2,792.00 | 12,005,600  | 貸付有価証券<br>3,700株(3,700株)   |
| 1332 | 日本水産             | 132,900 | 663.00   | 88,112,700  |                            |
| 1333 | マル八ニチロ           | 19,200  | 3,650.00 | 70,080,000  |                            |
| 1376 | カネコ種苗            | 3,800   | 1,268.00 | 4,818,400   |                            |
| 1377 | サカタのタネ           | 16,200  | 3,560.00 | 57,672,000  | 貸付有価証券<br>14,200株(14,200株) |
| 1379 | ホクト              | 11,100  | 1,991.00 | 22,100,100  |                            |
| 1384 | ホクリヨウ            | 1,800   | 612.00   | 1,101,600   |                            |
| 1514 | 住石ホールディングス       | 28,600  | 99.00    | 2,831,400   | 貸付有価証券<br>21,700株(21,700株) |
| 1515 | 日鉄鉱業             | 3,000   | 4,570.00 | 13,710,000  |                            |
| 1518 | 三井松島ホールディングス     | 5,600   | 1,392.00 | 7,795,200   |                            |
| 1605 | 国際石油開発帝石         | 533,200 | 1,022.00 | 544,930,400 |                            |
| 1662 | 石油資源開発           | 19,100  | 2,041.00 | 38,983,100  | 貸付有価証券<br>8,800株(8,800株)   |
| 1663 | K&Oエナジーグループ      | 6,500   | 1,482.00 | 9,633,000   |                            |
| 1413 | ヒノキヤグループ         | 2,800   | 1,925.00 | 5,390,000   |                            |
| 1414 | ショーボンドホールディングス   | 10,300  | 7,530.00 | 77,559,000  | 貸付有価証券<br>8,500株(8,500株)   |
| 1417 | ミライト・ホールディングス    | 37,400  | 1,539.00 | 57,558,600  | 貸付有価証券<br>17,500株(17,500株) |
| 1419 | タマホーム            | 8,200   | 1,208.00 | 9,905,600   |                            |
| 1420 | サンヨーホームズ         | 1,900   | 833.00   | 1,582,700   |                            |
| 1429 | 日本アクア            | 3,200   | 409.00   | 1,308,800   | 貸付有価証券<br>1,200株(1,200株)   |
| 1430 | ファーストコーポレーション    | 3,700   | 757.00   | 2,800,900   |                            |
| 1433 | ベステラ             | 2,500   | 1,440.00 | 3,600,000   | 貸付有価証券<br>1,000株(1,000株)   |
| 1435 | TATERU           | 16,200  | 320.00   | 5,184,000   | 貸付有価証券<br>5,600株(5,600株)   |
| 1448 | スペースバリューホールディングス | 16,200  | 954.00   | 15,454,800  | 貸付有価証券<br>9,600株(9,600株)   |
| 1712 | ダイセキ環境ソリューション    | 2,600   | 663.00   | 1,723,800   | 貸付有価証券<br>300株(300株)       |
| 1716 | 第一カッター興業         | 1,500   | 1,790.00 | 2,685,000   | 貸付有価証券<br>500株(500株)       |
| 1719 | 安藤・間             | 85,000  | 712.00   | 60,520,000  |                            |
| 1720 | 東急建設             | 38,900  | 983.00   | 38,238,700  |                            |
| 1721 | コムシスホールディングス     | 47,100  | 2,802.00 | 131,974,200 |                            |
| 1722 | ミサワホーム           | 10,500  | 757.00   | 7,948,500   |                            |

|      |                 |         |           |             |                            |
|------|-----------------|---------|-----------|-------------|----------------------------|
| 1726 | ビーアールホールディングス   | 10,900  | 341.00    | 3,716,900   |                            |
| 1762 | 高松コンストラクショングループ | 8,300   | 2,714.00  | 22,526,200  | 貸付有価証券<br>1,400株(1,400株)   |
| 1766 | 東建コーポレーション      | 4,100   | 6,340.00  | 25,994,000  |                            |
| 1768 | ソネック            | 1,400   | 699.00    | 978,600     |                            |
| 1780 | ヤマウラ            | 5,100   | 968.00    | 4,936,800   | 貸付有価証券<br>4,100株(4,100株)   |
| 1801 | 大成建設            | 109,200 | 5,050.00  | 551,460,000 |                            |
| 1802 | 大林組             | 328,900 | 1,019.00  | 335,149,100 |                            |
| 1803 | 清水建設            | 335,400 | 921.00    | 308,903,400 |                            |
| 1805 | 飛鳥建設            | 9,400   | 1,413.00  | 13,282,200  |                            |
| 1808 | 長谷工コーポレーション     | 137,100 | 1,203.00  | 164,931,300 |                            |
| 1810 | 松井建設            | 12,100  | 727.00    | 8,796,700   |                            |
| 1811 | 銭高組             | 1,300   | 5,120.00  | 6,656,000   |                            |
| 1812 | 鹿島建設            | 257,000 | 1,515.00  | 389,355,000 |                            |
| 1813 | 不動テトラ           | 7,500   | 1,636.00  | 12,270,000  |                            |
| 1814 | 大末建設            | 3,900   | 908.00    | 3,541,200   |                            |
| 1815 | 鉄建建設            | 6,700   | 2,567.00  | 17,198,900  | 貸付有価証券<br>5,300株(5,300株)   |
| 1820 | 西松建設            | 23,600  | 2,518.00  | 59,424,800  |                            |
| 1821 | 三井住友建設          | 79,100  | 690.00    | 54,579,000  |                            |
| 1822 | 大豊建設            | 7,400   | 3,365.00  | 24,901,000  |                            |
| 1824 | 前田建設工業          | 78,200  | 1,070.00  | 83,674,000  | 貸付有価証券<br>7,400株(7,400株)   |
| 1826 | 佐田建設            | 7,100   | 398.00    | 2,825,800   |                            |
| 1827 | ナカノフドー建設        | 8,400   | 499.00    | 4,191,600   |                            |
| 1833 | 奥村組             | 18,000  | 3,360.00  | 60,480,000  |                            |
| 1835 | 東鉄工業            | 13,200  | 2,894.00  | 38,200,800  |                            |
| 1847 | イチケン            | 2,000   | 1,993.00  | 3,986,000   |                            |
| 1848 | 富士ピー・エス         | 3,400   | 423.00    | 1,438,200   | 貸付有価証券<br>1,200株(1,200株)   |
| 1852 | 浅沼組             | 3,900   | 2,954.00  | 11,520,600  | 貸付有価証券<br>2,800株(2,800株)   |
| 1860 | 戸田建設            | 127,500 | 682.00    | 86,955,000  | 貸付有価証券<br>72,000株(72,000株) |
| 1861 | 熊谷組             | 15,600  | 3,340.00  | 52,104,000  |                            |
| 1865 | 青木あすなろ建設        | 5,400   | 987.00    | 5,329,800   |                            |
| 1866 | 北野建設            | 2,300   | 3,145.00  | 7,233,500   |                            |
| 1867 | 植木組             | 1,400   | 2,229.00  | 3,120,600   |                            |
| 1870 | 矢作建設工業          | 14,900  | 687.00    | 10,236,300  |                            |
| 1871 | ピーエス三菱          | 11,500  | 567.00    | 6,520,500   | 貸付有価証券<br>9,600株(9,600株)   |
| 1873 | 日本ハウスホールディングス   | 20,900  | 432.00    | 9,028,800   | 貸付有価証券<br>8,400株(8,400株)   |
| 1878 | 大東建託            | 39,100  | 15,030.00 | 587,673,000 |                            |



|      |           |         |          |               |                              |
|------|-----------|---------|----------|---------------|------------------------------|
| 1879 | 新日本建設     | 13,100  | 1,033.00 | 13,532,300    | 貸付有価証券<br>10,500株(10,500株)   |
| 1881 | N I P P O | 29,000  | 2,071.00 | 60,059,000    | 貸付有価証券<br>14,000株(14,000株)   |
| 1882 | 東亜道路工業    | 2,100   | 3,005.00 | 6,310,500     |                              |
| 1883 | 前田道路      | 34,300  | 2,094.00 | 71,824,200    |                              |
| 1884 | 日本道路      | 3,000   | 6,330.00 | 18,990,000    |                              |
| 1885 | 東亜建設工業    | 9,600   | 1,407.00 | 13,507,200    |                              |
| 1888 | 若築建設      | 5,500   | 1,507.00 | 8,288,500     |                              |
| 1890 | 東洋建設      | 40,100  | 390.00   | 15,639,000    |                              |
| 1893 | 五洋建設      | 130,400 | 621.00   | 80,978,400    | 貸付有価証券<br>98,400株(98,400株)   |
| 1898 | 世紀東急工業    | 16,000  | 611.00   | 9,776,000     |                              |
| 1899 | 福田組       | 3,600   | 4,010.00 | 14,436,000    |                              |
| 1911 | 住友林業      | 77,700  | 1,456.00 | 113,131,200   | 貸付有価証券<br>42,400株(42,400株)   |
| 1914 | 日本基礎技術    | 11,200  | 343.00   | 3,841,600     |                              |
| 1921 | 巴コーポレーション | 13,600  | 413.00   | 5,616,800     | 貸付有価証券<br>11,000株(11,000株)   |
| 1925 | 大和ハウス工業   | 303,700 | 3,508.00 | 1,065,379,600 | 貸付有価証券<br>114,200株(114,200株) |
| 1926 | ライト工業     | 21,100  | 1,321.00 | 27,873,100    |                              |
| 1928 | 積水ハウス     | 335,800 | 1,659.50 | 557,260,100   |                              |
| 1929 | 日特建設      | 9,300   | 643.00   | 5,979,900     |                              |
| 1930 | 北陸電気工事    | 5,300   | 890.00   | 4,717,000     | 貸付有価証券<br>100株(100株)         |
| 1934 | ユアテック     | 17,600  | 918.00   | 16,156,800    |                              |
| 1939 | 四電工       | 1,700   | 2,610.00 | 4,437,000     | 貸付有価証券<br>400株(400株)         |
| 1941 | 中電工       | 14,100  | 2,296.00 | 32,373,600    | 貸付有価証券<br>10,400株(10,400株)   |
| 1942 | 関電工       | 49,900  | 1,020.00 | 50,898,000    |                              |
| 1944 | きんでん      | 72,900  | 1,750.00 | 127,575,000   |                              |
| 1945 | 東京エネシス    | 11,300  | 967.00   | 10,927,100    | 貸付有価証券<br>10,000株(10,000株)   |
| 1946 | トーエネック    | 3,100   | 3,040.00 | 9,424,000     | 貸付有価証券<br>1,100株(1,100株)     |
| 1949 | 住友電設      | 7,600   | 1,724.00 | 13,102,400    |                              |
| 1950 | 日本電設工業    | 18,700  | 2,343.00 | 43,814,100    | 貸付有価証券<br>14,400株(14,400株)   |
| 1951 | 協和エクシオ    | 43,000  | 2,632.00 | 113,176,000   |                              |
| 1952 | 新日本空調     | 9,200   | 1,697.00 | 15,612,400    |                              |
| 1959 | 九電工       | 21,600  | 3,785.00 | 81,756,000    |                              |
| 1961 | 三機工業      | 24,800  | 1,131.00 | 28,048,800    |                              |
| 1963 | 日揮        | 94,500  | 1,649.00 | 155,830,500   | 貸付有価証券<br>62,000株(62,000株)   |
| 1964 | 中外炉工業     | 3,100   | 2,081.00 | 6,451,100     |                              |

|      |                 |         |          |             |                            |
|------|-----------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 1967 | ヤマト             | 9,800   | 488.00   | 4,782,400   |                            |
| 1968 | 太平電業            | 7,400   | 2,391.00 | 17,693,400  |                            |
| 1969 | 高砂熱学工業          | 27,700  | 1,706.00 | 47,256,200  |                            |
| 1972 | 三晃金属工業          | 1,300   | 2,885.00 | 3,750,500   |                            |
| 1975 | 朝日工業社           | 2,300   | 3,050.00 | 7,015,000   |                            |
| 1976 | 明星工業            | 19,800  | 708.00   | 14,018,400  |                            |
| 1979 | 大氣社             | 14,900  | 2,888.00 | 43,031,200  | 貸付有価証券<br>8,200株(8,200株)   |
| 1980 | ダイダン            | 7,300   | 2,409.00 | 17,585,700  |                            |
| 1982 | 日比谷総合設備         | 10,500  | 1,679.00 | 17,629,500  | 貸付有価証券<br>7,900株(7,900株)   |
| 1983 | 東芝プラントシステム      | 23,700  | 2,055.00 | 48,703,500  |                            |
| 5912 | O S J Bホールディングス | 48,400  | 301.00   | 14,568,400  |                            |
| 6330 | 東洋エンジニアリング      | 12,900  | 710.00   | 9,159,000   | 貸付有価証券<br>6,800株(6,800株)   |
| 6366 | 千代田化工建設         | 79,100  | 331.00   | 26,182,100  | 貸付有価証券<br>49,000株(49,000株) |
| 6379 | 新興プランテック        | 19,700  | 1,160.00 | 22,852,000  | 貸付有価証券<br>14,900株(14,900株) |
| 2001 | 日本製粉            | 32,600  | 1,822.00 | 59,397,200  |                            |
| 2002 | 日清製粉グループ本社      | 111,000 | 2,156.00 | 239,316,000 |                            |
| 2003 | 日東富士製粉          | 700     | 5,570.00 | 3,899,000   |                            |
| 2004 | 昭和産業            | 9,000   | 2,947.00 | 26,523,000  |                            |
| 2009 | 鳥越製粉            | 8,700   | 799.00   | 6,951,300   |                            |
| 2053 | 中部飼料            | 12,000  | 1,197.00 | 14,364,000  |                            |
| 2060 | フィード・ワン         | 66,000  | 175.00   | 11,550,000  |                            |
| 2107 | 東洋精糖            | 1,500   | 1,025.00 | 1,537,500   |                            |
| 2108 | 日本甜菜製糖          | 5,600   | 1,764.00 | 9,878,400   |                            |
| 2109 | 三井製糖            | 7,700   | 3,025.00 | 23,292,500  |                            |
| 2112 | 塩水港精糖           | 10,600  | 220.00   | 2,332,000   |                            |
| 2117 | 日新製糖            | 4,700   | 2,060.00 | 9,682,000   | 貸付有価証券<br>900株(900株)       |
| 2201 | 森永製菓            | 24,700  | 4,440.00 | 109,668,000 |                            |
| 2204 | 中村屋             | 2,500   | 4,240.00 | 10,600,000  |                            |
| 2206 | 江崎グリコ           | 29,500  | 5,290.00 | 156,055,000 | 貸付有価証券<br>18,500株(18,500株) |
| 2207 | 名糖産業            | 4,700   | 1,310.00 | 6,157,000   |                            |
| 2209 | 井村屋グループ         | 4,200   | 2,460.00 | 10,332,000  |                            |
| 2211 | 不二家             | 5,500   | 2,223.00 | 12,226,500  | 貸付有価証券<br>1,800株(1,800株)   |
| 2212 | 山崎製パン           | 80,300  | 2,116.00 | 169,914,800 |                            |
| 2215 | 第一屋製パン          | 1,700   | 984.00   | 1,672,800   |                            |
| 2217 | モロゾフ            | 1,700   | 5,040.00 | 8,568,000   |                            |
| 2220 | 亀田製菓            | 6,100   | 4,900.00 | 29,890,000  |                            |
| 2222 | 寿スピリッツ          | 10,400  | 4,235.00 | 44,044,000  | 貸付有価証券<br>100株(100株)       |

|      |                          |         |          |               |                            |
|------|--------------------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| 2229 | カルビー                     | 44,800  | 3,490.00 | 156,352,000   | 貸付有価証券<br>22,600株(22,600株) |
| 2264 | 森永乳業                     | 19,700  | 3,220.00 | 63,434,000    |                            |
| 2266 | 六甲バター                    | 7,200   | 1,982.00 | 14,270,400    | 貸付有価証券<br>3,800株(3,800株)   |
| 2267 | ヤクルト本社                   | 72,800  | 7,130.00 | 519,064,000   | 貸付有価証券<br>36,100株(36,100株) |
| 2269 | 明治ホールディングス               | 69,600  | 8,360.00 | 581,856,000   | 貸付有価証券<br>26,500株(26,500株) |
| 2270 | 雪印メグミルク                  | 23,600  | 2,862.00 | 67,543,200    |                            |
| 2281 | プリマハム                    | 13,800  | 2,054.00 | 28,345,200    |                            |
| 2282 | 日本ハム                     | 42,500  | 4,555.00 | 193,587,500   |                            |
| 2286 | 林兼産業                     | 3,200   | 578.00   | 1,849,600     |                            |
| 2288 | 丸大食品                     | 10,500  | 1,816.00 | 19,068,000    | 貸付有価証券<br>9,000株(9,000株)   |
| 2292 | S Foods                  | 8,800   | 3,780.00 | 33,264,000    | 貸付有価証券<br>4,300株(4,300株)   |
| 2296 | 伊藤ハム米久ホールディングス           | 63,200  | 700.00   | 44,240,000    | 貸付有価証券<br>2,600株(2,600株)   |
| 2501 | サッポロホールディングス             | 35,900  | 2,486.00 | 89,247,400    | 貸付有価証券<br>14,800株(14,800株) |
| 2502 | アサヒグループホールディングス          | 205,700 | 4,257.00 | 875,664,900   |                            |
| 2503 | キリンホールディングス              | 444,400 | 2,567.50 | 1,140,997,000 |                            |
| 2531 | 宝ホールディングス                | 73,500  | 1,293.00 | 95,035,500    |                            |
| 2533 | オエノンホールディングス             | 27,900  | 348.00   | 9,709,200     |                            |
| 2540 | 養命酒製造                    | 3,000   | 2,091.00 | 6,273,000     |                            |
| 2579 | コカ・コーラ ボトラーズジャパン<br>ホールデ | 75,200  | 3,285.00 | 247,032,000   | 貸付有価証券<br>22,800株(22,800株) |
| 2587 | サントリー食品インターナショナル         | 65,700  | 4,855.00 | 318,973,500   |                            |
| 2590 | ダイドーグループホールディングス         | 5,500   | 5,220.00 | 28,710,000    | 貸付有価証券<br>3,600株(3,600株)   |
| 2593 | 伊藤園                      | 32,500  | 4,700.00 | 152,750,000   | 貸付有価証券<br>16,800株(16,800株) |
| 2594 | キーコーヒー                   | 9,700   | 2,020.00 | 19,594,000    | 貸付有価証券<br>7,800株(7,800株)   |
| 2597 | ユニカフェ                    | 2,900   | 1,001.00 | 2,902,900     |                            |
| 2599 | ジャパンフーズ                  | 1,400   | 1,201.00 | 1,681,400     |                            |
| 2602 | 日清オイリオグループ               | 12,600  | 3,195.00 | 40,257,000    |                            |
| 2607 | 不二製油グループ本社               | 23,900  | 3,410.00 | 81,499,000    |                            |
| 2612 | かどや製油                    | 1,100   | 5,330.00 | 5,863,000     |                            |
| 2613 | J - オイルミルズ               | 5,100   | 3,825.00 | 19,507,500    |                            |
| 2801 | キッコーマン                   | 64,800  | 5,550.00 | 359,640,000   | 貸付有価証券<br>50,000株(50,000株) |
| 2802 | 味の素                      | 216,900 | 1,856.00 | 402,566,400   |                            |
| 2809 | キューピー                    | 54,700  | 2,485.00 | 135,929,500   |                            |
| 2810 | ハウス食品グループ本社              | 37,500  | 3,785.00 | 141,937,500   |                            |
| 2811 | カゴメ                      | 39,300  | 2,901.00 | 114,009,300   | 貸付有価証券<br>31,800株(31,800株) |

|      |                   |         |          |               |                            |
|------|-------------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| 2812 | 焼津水産化学工業          | 4,800   | 1,011.00 | 4,852,800     |                            |
| 2815 | アリアケジャパン          | 9,000   | 6,570.00 | 59,130,000    | 貸付有価証券<br>7,200株(7,200株)   |
| 2818 | ピエトロ              | 1,300   | 1,631.00 | 2,120,300     |                            |
| 2819 | エバラ食品工業           | 2,400   | 2,109.00 | 5,061,600     |                            |
| 2871 | ニチレイ              | 51,000  | 2,968.00 | 151,368,000   |                            |
| 2875 | 東洋水産              | 50,500  | 3,885.00 | 196,192,500   |                            |
| 2882 | イートアンド            | 3,400   | 1,623.00 | 5,518,200     | 貸付有価証券<br>1,600株(1,600株)   |
| 2883 | 大冷                | 1,100   | 1,705.00 | 1,875,500     |                            |
| 2884 | ヨシムラ・フード・ホールディングス | 2,700   | 472.00   | 1,274,400     | 貸付有価証券<br>700株(700株)       |
| 2897 | 日清食品ホールディングス      | 41,800  | 6,850.00 | 286,330,000   | 貸付有価証券<br>24,100株(24,100株) |
| 2899 | 永谷園ホールディングス       | 5,200   | 2,457.00 | 12,776,400    |                            |
| 2904 | 一正蒲鉾              | 3,800   | 1,070.00 | 4,066,000     |                            |
| 2908 | フジッコ              | 10,600  | 2,308.00 | 24,464,800    |                            |
| 2910 | ロック・フィールド         | 10,600  | 1,504.00 | 15,942,400    |                            |
| 2914 | 日本たばこ産業           | 567,200 | 2,744.50 | 1,556,680,400 |                            |
| 2915 | ケンコーマヨネーズ         | 5,500   | 2,006.00 | 11,033,000    | 貸付有価証券<br>2,800株(2,800株)   |
| 2918 | わらべや日洋ホールディングス    | 6,400   | 1,844.00 | 11,801,600    | 貸付有価証券<br>4,800株(4,800株)   |
| 2922 | なとり               | 5,500   | 1,608.00 | 8,844,000     |                            |
| 2924 | イフジ産業             | 1,700   | 644.00   | 1,094,800     |                            |
| 2925 | ピククルスコーポレーション     | 2,300   | 2,047.00 | 4,708,100     |                            |
| 2930 | 北の達人コーポレーション      | 38,600  | 410.00   | 15,826,000    | 貸付有価証券<br>16,800株(16,800株) |
| 2931 | ユーグレナ             | 41,700  | 605.00   | 25,228,500    | 貸付有価証券<br>33,200株(33,200株) |
| 4404 | ミヨシ油脂             | 3,800   | 1,058.00 | 4,020,400     |                            |
| 4526 | 理研ビタミン            | 4,600   | 3,400.00 | 15,640,000    |                            |
| 3001 | 片倉工業              | 11,800  | 1,155.00 | 13,629,000    | 貸付有価証券<br>7,900株(7,900株)   |
| 3002 | ガンゼ               | 6,400   | 4,595.00 | 29,408,000    | 貸付有価証券<br>4,700株(4,700株)   |
| 3101 | 東洋紡               | 40,600  | 1,589.00 | 64,513,400    | 貸付有価証券<br>23,900株(23,900株) |
| 3103 | ユニチカ              | 28,100  | 519.00   | 14,583,900    |                            |
| 3104 | 富士紡ホールディングス       | 5,000   | 2,595.00 | 12,975,000    | 貸付有価証券<br>600株(600株)       |
| 3106 | 倉敷紡績              | 9,100   | 2,354.00 | 21,421,400    |                            |
| 3109 | シキボウ              | 5,000   | 1,046.00 | 5,230,000     |                            |
| 3201 | 日本毛織              | 31,500  | 893.00   | 28,129,500    |                            |
| 3202 | ダイトウボウ            | 15,500  | 82.00    | 1,271,000     | 貸付有価証券<br>12,000株(12,000株) |
| 3204 | トーア紡コーポレーション      | 4,100   | 461.00   | 1,890,100     | 貸付有価証券<br>100株(100株)       |

|      |                |         |           |             |                            |
|------|----------------|---------|-----------|-------------|----------------------------|
| 3205 | ダイドーリミテッド      | 11,500  | 338.00    | 3,887,000   |                            |
| 3302 | 帝国繊維           | 10,800  | 2,257.00  | 24,375,600  | 貸付有価証券<br>8,600株(8,600株)   |
| 3401 | 帝人             | 78,200  | 1,864.00  | 145,764,800 |                            |
| 3402 | 東レ             | 743,600 | 802.40    | 596,664,640 |                            |
| 3408 | サカイオーベックス      | 2,300   | 1,954.00  | 4,494,200   |                            |
| 3501 | 住江織物           | 2,600   | 2,538.00  | 6,598,800   | 貸付有価証券<br>2,000株(2,000株)   |
| 3512 | 日本フェルト         | 5,400   | 444.00    | 2,397,600   |                            |
| 3513 | イチカワ           | 1,400   | 1,401.00  | 1,961,400   |                            |
| 3524 | 日東製網           | 1,100   | 1,282.00  | 1,410,200   |                            |
| 3529 | アツギ            | 7,900   | 979.00    | 7,734,100   |                            |
| 3551 | ダイニック          | 3,900   | 738.00    | 2,878,200   |                            |
| 3569 | セーレン           | 23,600  | 1,777.00  | 41,937,200  | 貸付有価証券<br>20,600株(20,600株) |
| 3571 | ソトー            | 3,800   | 951.00    | 3,613,800   |                            |
| 3577 | 東海染工           | 1,300   | 995.00    | 1,293,500   |                            |
| 3580 | 小松マテーレ         | 15,700  | 756.00    | 11,869,200  | 貸付有価証券<br>4,800株(4,800株)   |
| 3591 | ワコールホールディングス   | 27,900  | 2,885.00  | 80,491,500  | 貸付有価証券<br>11,200株(11,200株) |
| 3593 | ホギメディカル        | 11,900  | 3,550.00  | 42,245,000  |                            |
| 3606 | レナウン           | 27,700  | 100.00    | 2,770,000   | 貸付有価証券<br>15,600株(15,600株) |
| 3607 | クラウディアホールディングス | 2,400   | 478.00    | 1,147,200   |                            |
| 3608 | T S Iホールディングス  | 35,400  | 705.00    | 24,957,000  | 貸付有価証券<br>24,100株(24,100株) |
| 3611 | マツオカコーポレーション   | 3,000   | 2,805.00  | 8,415,000   |                            |
| 3612 | ワールド           | 9,400   | 1,539.00  | 14,466,600  |                            |
| 8011 | 三陽商会           | 5,800   | 1,765.00  | 10,237,000  | 貸付有価証券<br>4,600株(4,600株)   |
| 8013 | ナイガイ           | 3,500   | 498.00    | 1,743,000   | 貸付有価証券<br>200株(200株)       |
| 8016 | オンワードホールディングス  | 57,600  | 635.00    | 36,576,000  | 貸付有価証券<br>39,000株(39,000株) |
| 8029 | ルックホールディングス    | 3,500   | 1,093.00  | 3,825,500   |                            |
| 8107 | キムラタン          | 47,200  | 24.00     | 1,132,800   | 貸付有価証券<br>28,100株(28,100株) |
| 8111 | ゴールドウイン        | 8,700   | 10,590.00 | 92,133,000  | 貸付有価証券<br>5,200株(5,200株)   |
| 8114 | デサント           | 23,400  | 1,895.00  | 44,343,000  |                            |
| 8118 | キング            | 5,100   | 506.00    | 2,580,600   |                            |
| 8127 | ヤマトインターナショナル   | 6,300   | 418.00    | 2,633,400   |                            |
| 3708 | 特種東海製紙         | 6,100   | 3,940.00  | 24,034,000  | 貸付有価証券<br>3,600株(3,600株)   |
| 3861 | 王子ホールディングス     | 431,500 | 615.00    | 265,372,500 |                            |
| 3863 | 日本製紙           | 45,900  | 2,097.00  | 96,252,300  | 貸付有価証券<br>100株(100株)       |

|      |            |         |          |               |                            |
|------|------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| 3864 | 三菱製紙       | 15,600  | 562.00   | 8,767,200     |                            |
| 3865 | 北越コーポレーション | 63,600  | 578.00   | 36,760,800    |                            |
| 3877 | 中越パルプ工業    | 4,100   | 1,341.00 | 5,498,100     | 貸付有価証券<br>2,100株(2,100株)   |
| 3878 | 巴川製紙所      | 3,200   | 1,097.00 | 3,510,400     |                            |
| 3880 | 大王製紙       | 46,700  | 1,370.00 | 63,979,000    | 貸付有価証券<br>36,700株(36,700株) |
| 3896 | 阿波製紙       | 2,500   | 469.00   | 1,172,500     | 貸付有価証券<br>1,600株(1,600株)   |
| 3941 | レンゴー       | 98,800  | 942.00   | 93,069,600    | 貸付有価証券<br>46,000株(46,000株) |
| 3946 | トーモク       | 5,900   | 1,639.00 | 9,670,100     |                            |
| 3950 | ザ・バック      | 7,300   | 2,950.00 | 21,535,000    | 貸付有価証券<br>5,100株(5,100株)   |
| 3405 | クラレ        | 161,700 | 1,668.00 | 269,715,600   | 貸付有価証券<br>91,600株(91,600株) |
| 3407 | 旭化成        | 681,900 | 1,183.50 | 807,028,650   |                            |
| 3553 | 共和レザー      | 6,000   | 765.00   | 4,590,000     |                            |
| 4004 | 昭和電工       | 63,700  | 3,630.00 | 231,231,000   | 貸付有価証券<br>38,400株(38,400株) |
| 4005 | 住友化学       | 754,500 | 585.00   | 441,382,500   |                            |
| 4008 | 住友精化       | 4,700   | 4,280.00 | 20,116,000    |                            |
| 4021 | 日産化学       | 58,900  | 5,690.00 | 335,141,000   |                            |
| 4022 | ラサ工業       | 3,400   | 1,365.00 | 4,641,000     |                            |
| 4023 | クレハ        | 8,900   | 6,730.00 | 59,897,000    | 貸付有価証券<br>6,200株(6,200株)   |
| 4025 | 多木化学       | 2,800   | 5,520.00 | 15,456,000    | 貸付有価証券<br>300株(300株)       |
| 4027 | テイカ        | 7,800   | 1,753.00 | 13,673,400    | 貸付有価証券<br>5,600株(5,600株)   |
| 4028 | 石原産業       | 18,400  | 1,136.00 | 20,902,400    |                            |
| 4031 | 片倉コープアグリ   | 2,800   | 1,169.00 | 3,273,200     |                            |
| 4033 | 日東エフシー     | 6,000   | 728.00   | 4,368,000     |                            |
| 4041 | 日本曹達       | 15,100  | 2,843.00 | 42,929,300    |                            |
| 4042 | 東ソー        | 148,200 | 1,529.00 | 226,597,800   |                            |
| 4043 | トクヤマ       | 27,600  | 2,692.00 | 74,299,200    |                            |
| 4044 | セントラル硝子    | 20,900  | 2,401.00 | 50,180,900    |                            |
| 4045 | 東亜合成       | 60,200  | 1,229.00 | 73,985,800    | 貸付有価証券<br>34,000株(34,000株) |
| 4046 | 大阪ソーダ      | 10,300  | 2,449.00 | 25,224,700    | 貸付有価証券<br>7,200株(7,200株)   |
| 4047 | 関東電化工業     | 22,700  | 903.00   | 20,498,100    | 貸付有価証券<br>20,000株(20,000株) |
| 4061 | デンカ        | 37,700  | 3,430.00 | 129,311,000   |                            |
| 4063 | 信越化学工業     | 168,900 | 9,119.00 | 1,540,199,100 |                            |
| 4064 | 日本カーバイド工業  | 3,200   | 1,666.00 | 5,331,200     |                            |
| 4078 | 堺化学工業      | 6,400   | 2,197.00 | 14,060,800    |                            |

|      |                |         |          |             |                            |
|------|----------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 4082 | 第一稀元素化学工業      | 7,800   | 885.00   | 6,903,000   | 貸付有価証券<br>2,900株(2,900株)   |
| 4088 | エア・ウォーター       | 78,500  | 1,791.00 | 140,593,500 | 貸付有価証券<br>48,000株(48,000株) |
| 4091 | 大陽日酸           | 79,000  | 1,740.00 | 137,460,000 |                            |
| 4092 | 日本化学工業         | 3,300   | 2,292.00 | 7,563,600   |                            |
| 4093 | 東邦アセチレン        | 1,400   | 1,360.00 | 1,904,000   |                            |
| 4095 | 日本パーカラライジング    | 52,400  | 1,251.00 | 65,552,400  |                            |
| 4097 | 高压ガス工業         | 15,200  | 754.00   | 11,460,800  |                            |
| 4098 | チタン工業          | 1,200   | 2,476.00 | 2,971,200   | 貸付有価証券<br>500株(500株)       |
| 4099 | 四国化成工業         | 16,100  | 1,050.00 | 16,905,000  | 貸付有価証券<br>11,700株(11,700株) |
| 4100 | 戸田工業           | 2,000   | 2,264.00 | 4,528,000   | 貸付有価証券<br>1,600株(1,600株)   |
| 4109 | ステラ ケミファ       | 5,600   | 2,858.00 | 16,004,800  |                            |
| 4112 | 保土谷化学工業        | 3,300   | 2,125.00 | 7,012,500   |                            |
| 4114 | 日本触媒           | 16,100  | 7,250.00 | 116,725,000 |                            |
| 4116 | 大日精化工業         | 7,900   | 2,842.00 | 22,451,800  |                            |
| 4118 | カネカ            | 25,500  | 4,225.00 | 107,737,500 |                            |
| 4182 | 三菱瓦斯化学         | 98,600  | 1,709.00 | 168,507,400 | 貸付有価証券<br>45,500株(45,500株) |
| 4183 | 三井化学           | 87,000  | 2,707.00 | 235,509,000 |                            |
| 4185 | J S R          | 96,200  | 1,765.00 | 169,793,000 |                            |
| 4186 | 東京応化工業         | 16,400  | 3,090.00 | 50,676,000  | 貸付有価証券<br>8,600株(8,600株)   |
| 4187 | 大阪有機化学工業       | 8,900   | 1,126.00 | 10,021,400  |                            |
| 4188 | 三菱ケミカルホールディングス | 640,800 | 925.90   | 593,316,720 |                            |
| 4189 | K Hネオケム        | 14,600  | 2,566.00 | 37,463,600  | 貸付有価証券<br>10,200株(10,200株) |
| 4202 | ダイセル           | 148,900 | 1,122.00 | 167,065,800 |                            |
| 4203 | 住友ベークライト       | 16,600  | 4,040.00 | 67,064,000  |                            |
| 4204 | 積水化学工業         | 209,500 | 1,622.00 | 339,809,000 |                            |
| 4205 | 日本ゼオン          | 86,400  | 1,101.00 | 95,126,400  | 貸付有価証券<br>39,600株(39,600株) |
| 4206 | アイカ工業          | 28,800  | 3,615.00 | 104,112,000 |                            |
| 4208 | 宇部興産           | 48,400  | 2,437.00 | 117,950,800 |                            |
| 4212 | 積水樹脂           | 15,800  | 1,942.00 | 30,683,600  |                            |
| 4215 | タキロンシーアイ       | 20,700  | 573.00   | 11,861,100  |                            |
| 4216 | 旭有機材           | 6,600   | 1,541.00 | 10,170,600  |                            |
| 4217 | 日立化成           | 44,300  | 1,799.00 | 79,695,700  |                            |
| 4218 | ニチバン           | 5,000   | 1,972.00 | 9,860,000   |                            |
| 4220 | リケンテクノス        | 26,100  | 448.00   | 11,692,800  | 貸付有価証券<br>9,600株(9,600株)   |
| 4221 | 大倉工業           | 4,900   | 1,819.00 | 8,913,100   |                            |
| 4228 | 積水化成品工業        | 14,300  | 944.00   | 13,499,200  |                            |

|      |                |         |          |               |                            |
|------|----------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| 4229 | 群栄化学工業         | 2,500   | 2,817.00 | 7,042,500     |                            |
| 4231 | タイガースポリマー      | 5,000   | 608.00   | 3,040,000     |                            |
| 4238 | ミライアル          | 2,800   | 1,118.00 | 3,130,400     | 貸付有価証券<br>2,000株(2,000株)   |
| 4245 | ダイキアクシス        | 3,400   | 905.00   | 3,077,000     | 貸付有価証券<br>1,800株(1,800株)   |
| 4246 | ダイキョーニシカワ      | 20,200  | 1,150.00 | 23,230,000    |                            |
| 4248 | 竹本容器           | 3,400   | 1,447.00 | 4,919,800     |                            |
| 4249 | 森六ホールディングス     | 5,200   | 2,565.00 | 13,338,000    |                            |
| 4272 | 日本化薬           | 61,000  | 1,387.00 | 84,607,000    |                            |
| 4275 | カーリットホールディングス  | 10,200  | 781.00   | 7,966,200     | 貸付有価証券<br>7,600株(7,600株)   |
| 4362 | 日本精化           | 7,700   | 1,059.00 | 8,154,300     | 貸付有価証券<br>100株(100株)       |
| 4368 | 扶桑化学工業         | 9,700   | 2,089.00 | 20,263,300    | 貸付有価証券<br>4,500株(4,500株)   |
| 4369 | トリケミカル研究所      | 2,100   | 4,510.00 | 9,471,000     | 貸付有価証券<br>800株(800株)       |
| 4401 | A D E K A      | 47,200  | 1,719.00 | 81,136,800    | 貸付有価証券<br>24,000株(24,000株) |
| 4403 | 日油             | 36,900  | 3,490.00 | 128,781,000   |                            |
| 4406 | 新日本理化          | 17,300  | 176.00   | 3,044,800     | 貸付有価証券<br>10,000株(10,000株) |
| 4410 | ハリマ化成グループ      | 7,900   | 987.00   | 7,797,300     |                            |
| 4452 | 花王             | 237,600 | 7,610.00 | 1,808,136,000 |                            |
| 4461 | 第一工業製薬         | 3,600   | 2,471.00 | 8,895,600     |                            |
| 4462 | 石原ケミカル         | 2,400   | 1,786.00 | 4,286,400     | 貸付有価証券<br>400株(400株)       |
| 4463 | 日華化学           | 3,200   | 931.00   | 2,979,200     | 貸付有価証券<br>200株(200株)       |
| 4465 | ニイタカ           | 1,500   | 1,494.00 | 2,241,000     |                            |
| 4471 | 三洋化成工業         | 6,400   | 5,120.00 | 32,768,000    |                            |
| 4531 | 有機合成薬品工業       | 7,300   | 209.00   | 1,525,700     | 貸付有価証券<br>2,300株(2,300株)   |
| 4611 | 大日本塗料          | 10,800  | 1,000.00 | 10,800,000    |                            |
| 4612 | 日本ペイントホールディングス | 79,100  | 3,590.00 | 283,969,000   | 貸付有価証券<br>50,000株(50,000株) |
| 4613 | 関西ペイント         | 107,700 | 1,923.00 | 207,107,100   | 貸付有価証券<br>70,000株(70,000株) |
| 4615 | 神東塗料           | 7,500   | 169.00   | 1,267,500     |                            |
| 4617 | 中国塗料           | 31,500  | 929.00   | 29,263,500    | 貸付有価証券<br>24,000株(24,000株) |
| 4619 | 日本特殊塗料         | 7,200   | 1,324.00 | 9,532,800     | 貸付有価証券<br>700株(700株)       |
| 4620 | 藤倉化成           | 12,900  | 575.00   | 7,417,500     |                            |
| 4626 | 太陽ホールディングス     | 7,900   | 3,350.00 | 26,465,000    |                            |
| 4631 | D I C          | 43,400  | 3,460.00 | 150,164,000   | 貸付有価証券<br>20,400株(20,400株) |



|      |                  |         |           |               |                              |
|------|------------------|---------|-----------|---------------|------------------------------|
| 4633 | サカタインクス          | 20,900  | 1,193.00  | 24,933,700    | 貸付有価証券<br>16,800株(16,800株)   |
| 4634 | 東洋インキSCホールディングス  | 20,300  | 2,499.00  | 50,729,700    | 貸付有価証券<br>10,400株(10,400株)   |
| 4636 | T & K TOKA       | 7,400   | 969.00    | 7,170,600     |                              |
| 4901 | 富士フイルムホールディングス   | 203,300 | 4,603.00  | 935,789,900   |                              |
| 4911 | 資生堂              | 194,500 | 6,337.00  | 1,232,546,500 | 貸付有価証券<br>102,500株(102,500株) |
| 4912 | ライオン             | 136,300 | 2,205.00  | 300,541,500   |                              |
| 4914 | 高砂香料工業           | 6,700   | 3,315.00  | 22,210,500    |                              |
| 4917 | マンダム             | 22,000  | 2,918.00  | 64,196,000    |                              |
| 4919 | ミルボン             | 12,100  | 4,370.00  | 52,877,000    | 貸付有価証券<br>9,600株(9,600株)     |
| 4921 | ファンケル            | 43,600  | 2,449.00  | 106,776,400   | 貸付有価証券<br>38,400株(38,400株)   |
| 4922 | コーセー             | 16,600  | 15,850.00 | 263,110,000   |                              |
| 4923 | コタ               | 4,700   | 1,407.00  | 6,612,900     |                              |
| 4924 | シーズ・ホールディングス     | 11,400  | 5,880.00  | 67,032,000    |                              |
| 4926 | シーボン             | 1,200   | 2,682.00  | 3,218,400     |                              |
| 4927 | ポーラ・オルビスホールディングス | 41,800  | 3,040.00  | 127,072,000   | 貸付有価証券<br>23,600株(23,600株)   |
| 4928 | ノエビアホールディングス     | 6,200   | 4,595.00  | 28,489,000    |                              |
| 4929 | アジュバンコスメジャパン     | 2,200   | 936.00    | 2,059,200     | 貸付有価証券<br>500株(500株)         |
| 4951 | エステー             | 7,000   | 1,750.00  | 12,250,000    | 貸付有価証券<br>5,600株(5,600株)     |
| 4955 | アグロ カネショウ        | 4,000   | 1,989.00  | 7,956,000     | 貸付有価証券<br>1,300株(1,300株)     |
| 4956 | コニシ              | 17,300  | 1,648.00  | 28,510,400    |                              |
| 4958 | 長谷川香料            | 11,700  | 1,596.00  | 18,673,200    |                              |
| 4963 | 星光PMC            | 6,500   | 787.00    | 5,115,500     |                              |
| 4967 | 小林製薬             | 27,400  | 6,900.00  | 189,060,000   |                              |
| 4968 | 荒川化学工業           | 8,800   | 1,324.00  | 11,651,200    |                              |
| 4971 | メック              | 6,700   | 1,090.00  | 7,303,000     |                              |
| 4973 | 日本高純度化学          | 2,700   | 2,271.00  | 6,131,700     | 貸付有価証券<br>300株(300株)         |
| 4974 | タカラバイオ           | 25,600  | 2,516.00  | 64,409,600    |                              |
| 4975 | JCU              | 12,700  | 1,592.00  | 20,218,400    |                              |
| 4977 | 新田ゼラチン           | 6,100   | 678.00    | 4,135,800     | 貸付有価証券<br>1,900株(1,900株)     |
| 4979 | OATアグリオ          | 1,300   | 2,079.00  | 2,702,700     | 貸付有価証券<br>700株(700株)         |
| 4980 | デクセリアルズ          | 25,200  | 869.00    | 21,898,800    | 貸付有価証券<br>11,600株(11,600株)   |
| 4985 | アース製薬            | 7,400   | 5,020.00  | 37,148,000    | 貸付有価証券<br>5,900株(5,900株)     |
| 4992 | 北興化学工業           | 10,000  | 552.00    | 5,520,000     |                              |

|      |                 |         |          |               |                            |
|------|-----------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| 4994 | 大成ラミック          | 3,200   | 2,825.00 | 9,040,000     |                            |
| 4996 | クミアイ化学工業        | 40,500  | 656.00   | 26,568,000    | 貸付有価証券<br>30,700株(30,700株) |
| 4997 | 日本農薬            | 23,400  | 494.00   | 11,559,600    |                            |
| 5142 | アキレス            | 7,100   | 1,952.00 | 13,859,200    |                            |
| 5208 | 有沢製作所           | 15,400  | 818.00   | 12,597,200    |                            |
| 6988 | 日東電工            | 73,900  | 6,047.00 | 446,873,300   |                            |
| 7874 | レック             | 10,400  | 1,542.00 | 16,036,800    | 貸付有価証券<br>7,900株(7,900株)   |
| 7888 | 三光合成            | 7,500   | 357.00   | 2,677,500     | 貸付有価証券<br>2,800株(2,800株)   |
| 7908 | きもと             | 16,600  | 189.00   | 3,137,400     |                            |
| 7917 | 藤森工業            | 8,800   | 2,842.00 | 25,009,600    |                            |
| 7925 | 前澤化成工業          | 6,700   | 1,029.00 | 6,894,300     |                            |
| 7940 | ウェーブロックホールディングス | 2,000   | 758.00   | 1,516,000     | 貸付有価証券<br>700株(700株)       |
| 7942 | J S P           | 5,700   | 2,172.00 | 12,380,400    |                            |
| 7947 | エフピコ            | 8,100   | 6,060.00 | 49,086,000    | 貸付有価証券<br>5,600株(5,600株)   |
| 7958 | 天馬              | 6,800   | 1,713.00 | 11,648,400    |                            |
| 7970 | 信越ポリマー          | 17,600  | 746.00   | 13,129,600    |                            |
| 7971 | 東リ              | 24,400  | 251.00   | 6,124,400     |                            |
| 7988 | ニフコ             | 39,200  | 2,636.00 | 103,331,200   | 貸付有価証券<br>25,800株(25,800株) |
| 7995 | バルカー            | 8,000   | 2,303.00 | 18,424,000    |                            |
| 8113 | ユニ・チャーム         | 207,500 | 3,245.00 | 673,337,500   |                            |
| 4151 | 協和発酵キリン         | 122,600 | 2,066.00 | 253,291,600   |                            |
| 4502 | 武田薬品工業          | 386,400 | 4,509.00 | 1,742,277,600 |                            |
| 4503 | アステラス製薬         | 902,400 | 1,529.00 | 1,379,769,600 |                            |
| 4506 | 大日本住友製薬         | 72,500  | 3,735.00 | 270,787,500   | 貸付有価証券<br>40,800株(40,800株) |
| 4507 | 塩野義製薬           | 128,000 | 6,505.00 | 832,640,000   |                            |
| 4508 | 田辺三菱製薬          | 102,400 | 1,650.00 | 168,960,000   |                            |
| 4512 | わかもと製薬          | 11,600  | 272.00   | 3,155,200     | 貸付有価証券<br>7,000株(7,000株)   |
| 4514 | あすか製薬           | 12,100  | 1,110.00 | 13,431,000    | 貸付有価証券<br>8,600株(8,600株)   |
| 4516 | 日本新薬            | 25,600  | 6,640.00 | 169,984,000   | 貸付有価証券<br>12,800株(12,800株) |
| 4517 | バイオフェルミン製薬      | 1,700   | 2,392.00 | 4,066,400     |                            |
| 4519 | 中外製薬            | 102,000 | 6,270.00 | 639,540,000   |                            |
| 4521 | 科研製薬            | 17,700  | 5,090.00 | 90,093,000    |                            |
| 4523 | エーザイ            | 117,100 | 8,630.00 | 1,010,573,000 |                            |
| 4527 | ロート製薬           | 50,200  | 2,892.00 | 145,178,400   |                            |
| 4528 | 小野薬品工業          | 231,100 | 2,324.50 | 537,191,950   |                            |

|      |                 |           |           |               |                              |
|------|-----------------|-----------|-----------|---------------|------------------------------|
| 4530 | 久光製薬            | 28,900    | 5,460.00  | 157,794,000   | 貸付有価証券<br>17,900株(17,900株)   |
| 4534 | 持田製薬            | 7,400     | 9,480.00  | 70,152,000    | 貸付有価証券<br>4,300株(4,300株)     |
| 4536 | 参天製薬            | 185,600   | 1,490.00  | 276,544,000   |                              |
| 4538 | 扶桑薬品工業          | 3,400     | 2,557.00  | 8,693,800     |                              |
| 4539 | 日本ケミファ          | 1,300     | 3,330.00  | 4,329,000     |                              |
| 4540 | ツムラ             | 30,300    | 3,070.00  | 93,021,000    | 貸付有価証券<br>16,900株(16,900株)   |
| 4541 | 日医工             | 25,100    | 1,658.00  | 41,615,800    | 貸付有価証券<br>9,100株(9,100株)     |
| 4547 | キッセイ薬品工業        | 17,300    | 2,887.00  | 49,945,100    |                              |
| 4548 | 生化学工業           | 19,000    | 1,238.00  | 23,522,000    |                              |
| 4549 | 栄研化学            | 17,200    | 2,237.00  | 38,476,400    | 貸付有価証券<br>13,800株(13,800株)   |
| 4550 | 日水製薬            | 4,100     | 1,161.00  | 4,760,100     |                              |
| 4551 | 鳥居薬品            | 5,300     | 2,409.00  | 12,767,700    |                              |
| 4552 | JCRファーマ         | 6,900     | 6,010.00  | 41,469,000    | 貸付有価証券<br>4,900株(4,900株)     |
| 4553 | 東和薬品            | 4,700     | 7,580.00  | 35,626,000    | 貸付有価証券<br>3,700株(3,700株)     |
| 4554 | 富士製薬工業          | 6,600     | 1,767.00  | 11,662,200    |                              |
| 4555 | 沢井製薬            | 20,100    | 5,500.00  | 110,550,000   |                              |
| 4559 | ゼリア新薬工業         | 19,400    | 1,836.00  | 35,618,400    | 貸付有価証券<br>16,900株(16,900株)   |
| 4568 | 第一三共            | 280,100   | 3,733.00  | 1,045,613,300 | 貸付有価証券<br>181,800株(181,800株) |
| 4569 | キョーリン製薬ホールディングス | 21,600    | 2,263.00  | 48,880,800    |                              |
| 4574 | 大幸薬品            | 4,400     | 1,738.00  | 7,647,200     | 貸付有価証券<br>3,200株(3,200株)     |
| 4577 | ダイト             | 5,700     | 2,866.00  | 16,336,200    |                              |
| 4578 | 大塚ホールディングス      | 186,500   | 4,333.00  | 808,104,500   |                              |
| 4581 | 大正製薬ホールディングス    | 21,900    | 11,150.00 | 244,185,000   | 貸付有価証券<br>3,500株(3,500株)     |
| 4587 | ペプチドリーム         | 45,000    | 4,525.00  | 203,625,000   | 貸付有価証券<br>32,800株(32,800株)   |
| 3315 | 日本コークス工業        | 82,700    | 96.00     | 7,939,200     |                              |
| 5002 | 昭和シェル石油         | 71,400    | 1,614.00  | 115,239,600   |                              |
| 5011 | ニチレキ            | 12,500    | 980.00    | 12,250,000    |                              |
| 5013 | コシロ化学工業         | 5,100     | 1,183.00  | 6,033,300     |                              |
| 5015 | ビーピー・カストロール     | 3,500     | 1,231.00  | 4,308,500     | 貸付有価証券<br>2,300株(2,300株)     |
| 5017 | 富士石油            | 23,800    | 300.00    | 7,140,000     | 貸付有価証券<br>19,200株(19,200株)   |
| 5018 | MORESCO         | 3,500     | 1,549.00  | 5,421,500     |                              |
| 5019 | 出光興産            | 84,000    | 3,790.00  | 318,360,000   |                              |
| 5020 | JXTGホールディングス    | 1,646,200 | 581.70    | 957,594,540   |                              |

|      |                  |         |          |               |                            |
|------|------------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| 5021 | コスモエネルギーホールディングス | 28,300  | 2,429.00 | 68,740,700    |                            |
| 5101 | 横浜ゴム             | 56,700  | 2,288.00 | 129,729,600   | 貸付有価証券<br>32,000株(32,000株) |
| 5105 | TOYO TIRE        | 50,200  | 1,489.00 | 74,747,800    |                            |
| 5108 | ブリヂストン           | 300,800 | 4,231.00 | 1,272,684,800 |                            |
| 5110 | 住友ゴム工業           | 87,900  | 1,480.00 | 130,092,000   | 貸付有価証券<br>48,800株(48,800株) |
| 5121 | 藤倉ゴム工業           | 8,500   | 463.00   | 3,935,500     |                            |
| 5122 | オカモト             | 6,800   | 5,640.00 | 38,352,000    | 貸付有価証券<br>5,000株(5,000株)   |
| 5185 | フコク              | 4,300   | 887.00   | 3,814,100     |                            |
| 5186 | ニッタ              | 11,000  | 3,520.00 | 38,720,000    | 貸付有価証券<br>6,300株(6,300株)   |
| 5191 | 住友理工             | 19,000  | 1,057.00 | 20,083,000    | 貸付有価証券<br>14,600株(14,600株) |
| 5192 | 三ツ星ベルト           | 12,900  | 2,088.00 | 26,935,200    |                            |
| 5195 | バンドー化学           | 18,600  | 1,090.00 | 20,274,000    |                            |
| 3110 | 日東紡績             | 14,600  | 1,904.00 | 27,798,400    |                            |
| 5201 | A G C            | 96,800  | 3,655.00 | 353,804,000   |                            |
| 5202 | 日本板硝子            | 46,800  | 988.00   | 46,238,400    | 貸付有価証券<br>40,000株(40,000株) |
| 5204 | 石塚硝子             | 1,400   | 1,998.00 | 2,797,200     |                            |
| 5210 | 日本山村硝子           | 4,100   | 1,506.00 | 6,174,600     | 貸付有価証券<br>3,200株(3,200株)   |
| 5214 | 日本電気硝子           | 42,300  | 3,030.00 | 128,169,000   |                            |
| 5218 | オハラ              | 3,900   | 1,663.00 | 6,485,700     | 貸付有価証券<br>3,100株(3,100株)   |
| 5232 | 住友大阪セメント         | 19,800  | 4,820.00 | 95,436,000    | 貸付有価証券<br>10,900株(10,900株) |
| 5233 | 太平洋セメント          | 61,800  | 3,675.00 | 227,115,000   |                            |
| 5262 | 日本ヒューム           | 9,800   | 778.00   | 7,624,400     |                            |
| 5269 | 日本コンクリート工業       | 21,100  | 256.00   | 5,401,600     |                            |
| 5273 | 三谷セキサン           | 4,600   | 2,565.00 | 11,799,000    | 貸付有価証券<br>400株(400株)       |
| 5288 | アジアパイルホールディングス   | 13,900  | 660.00   | 9,174,000     |                            |
| 5301 | 東海カーボン           | 88,900  | 1,514.00 | 134,594,600   | 貸付有価証券<br>72,000株(72,000株) |
| 5302 | 日本カーボン           | 4,700   | 4,410.00 | 20,727,000    | 貸付有価証券<br>4,000株(4,000株)   |
| 5310 | 東洋炭素             | 5,700   | 2,274.00 | 12,961,800    | 貸付有価証券<br>4,500株(4,500株)   |
| 5331 | ノリタケカンパニーリミテド    | 5,900   | 5,130.00 | 30,267,000    |                            |
| 5332 | TOTO             | 75,300  | 4,065.00 | 306,094,500   | 貸付有価証券<br>42,500株(42,500株) |
| 5333 | 日本碍子             | 119,400 | 1,655.00 | 197,607,000   | 貸付有価証券<br>73,000株(73,000株) |
| 5334 | 日本特殊陶業           | 82,500  | 2,239.00 | 184,717,500   |                            |

|      |                    |         |          |             |                            |
|------|--------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 5337 | ダントーホールディングス       | 8,200   | 103.00   | 844,600     | 貸付有価証券<br>5,000株(5,000株)   |
| 5344 | MARUWA             | 3,400   | 6,440.00 | 21,896,000  | 貸付有価証券<br>2,500株(2,500株)   |
| 5351 | 品川リフラクトリーズ         | 2,600   | 3,605.00 | 9,373,000   |                            |
| 5352 | 黒崎播磨               | 1,900   | 5,800.00 | 11,020,000  | 貸付有価証券<br>100株(100株)       |
| 5357 | ヨータイ               | 8,600   | 671.00   | 5,770,600   | 貸付有価証券<br>4,000株(4,000株)   |
| 5358 | イソライト工業            | 5,000   | 597.00   | 2,985,000   | 貸付有価証券<br>500株(500株)       |
| 5363 | 東京窯業               | 12,400  | 388.00   | 4,811,200   | 貸付有価証券<br>10,000株(10,000株) |
| 5367 | ニッカトー              | 4,400   | 920.00   | 4,048,000   |                            |
| 5384 | フジインコーポレーテッド       | 8,700   | 2,196.00 | 19,105,200  |                            |
| 5388 | クニミネ工業             | 3,300   | 817.00   | 2,696,100   |                            |
| 5391 | エーアンドエーマテリアル       | 1,900   | 986.00   | 1,873,400   |                            |
| 5393 | ニチアス               | 26,800  | 1,912.00 | 51,241,600  |                            |
| 7943 | ニチハ                | 13,600  | 2,665.00 | 36,244,000  |                            |
| 5401 | 新日鐵住金              | 449,700 | 1,987.50 | 893,778,750 |                            |
| 5406 | 神戸製鋼所              | 177,100 | 847.00   | 150,003,700 |                            |
| 5408 | 中山製鋼所              | 13,400  | 509.00   | 6,820,600   |                            |
| 5410 | 合同製鐵               | 4,700   | 1,719.00 | 8,079,300   | 貸付有価証券<br>2,600株(2,600株)   |
| 5411 | ジェイ エフ イー ホールディングス | 261,400 | 1,870.00 | 488,818,000 |                            |
| 5423 | 東京製鐵               | 51,800  | 877.00   | 45,428,600  |                            |
| 5440 | 共英製鋼               | 10,900  | 1,781.00 | 19,412,900  | 貸付有価証券<br>8,800株(8,800株)   |
| 5444 | 大和工業               | 20,600  | 2,646.00 | 54,507,600  |                            |
| 5445 | 東京鐵鋼               | 4,000   | 1,145.00 | 4,580,000   |                            |
| 5449 | 大阪製鐵               | 6,400   | 1,854.00 | 11,865,600  |                            |
| 5451 | 淀川製鋼所              | 13,100  | 2,169.00 | 28,413,900  |                            |
| 5463 | 丸一鋼管               | 34,300  | 3,345.00 | 114,733,500 | 貸付有価証券<br>2,000株(2,000株)   |
| 5464 | モリ工業               | 2,900   | 2,331.00 | 6,759,900   |                            |
| 5471 | 大同特殊鋼              | 15,800  | 4,405.00 | 69,599,000  | 貸付有価証券<br>9,600株(9,600株)   |
| 5476 | 日本高周波鋼業            | 3,600   | 541.00   | 1,947,600   |                            |
| 5480 | 日本冶金工業             | 80,100  | 254.00   | 20,345,400  | 貸付有価証券<br>60,900株(60,900株) |
| 5481 | 山陽特殊製鋼             | 12,200  | 2,264.00 | 27,620,800  |                            |
| 5482 | 愛知製鋼               | 5,400   | 3,465.00 | 18,711,000  |                            |
| 5486 | 日立金属               | 104,300 | 1,204.00 | 125,577,200 | 貸付有価証券<br>33,900株(33,900株) |
| 5491 | 日本金属               | 2,200   | 1,198.00 | 2,635,600   |                            |
| 5541 | 大平洋金属              | 6,500   | 2,801.00 | 18,206,500  |                            |

|      |                |         |          |             |                            |
|------|----------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 5563 | 新日本電工          | 58,000  | 221.00   | 12,818,000  | 貸付有価証券<br>46,800株(46,800株) |
| 5602 | 栗本鐵工所          | 4,900   | 1,397.00 | 6,845,300   |                            |
| 5603 | 虹技             | 1,400   | 1,372.00 | 1,920,800   | 貸付有価証券<br>200株(200株)       |
| 5612 | 日本鑄鉄管          | 1,000   | 1,004.00 | 1,004,000   | 貸付有価証券<br>600株(600株)       |
| 5632 | 三菱製鋼           | 7,200   | 1,667.00 | 12,002,400  | 貸付有価証券<br>5,600株(5,600株)   |
| 5658 | 日亜鋼業           | 14,200  | 280.00   | 3,976,000   |                            |
| 5659 | 日本精線           | 1,400   | 3,545.00 | 4,963,000   |                            |
| 5698 | エンビプロ・ホールディングス | 2,000   | 523.00   | 1,046,000   | 貸付有価証券<br>700株(700株)       |
| 6319 | シンニッタン         | 15,000  | 326.00   | 4,890,000   | 貸付有価証券<br>11,800株(11,800株) |
| 7305 | 新家工業           | 2,200   | 1,564.00 | 3,440,800   |                            |
| 5702 | 大紀アルミニウム工業所    | 15,900  | 583.00   | 9,269,700   | 貸付有価証券<br>12,000株(12,000株) |
| 5703 | 日本軽金属ホールディングス  | 263,700 | 227.00   | 59,859,900  |                            |
| 5706 | 三井金属鉱業         | 26,100  | 2,535.00 | 66,163,500  | 貸付有価証券<br>14,700株(14,700株) |
| 5707 | 東邦亜鉛           | 5,400   | 3,515.00 | 18,981,000  |                            |
| 5711 | 三菱マテリアル        | 63,900  | 3,085.00 | 197,131,500 | 貸付有価証券<br>36,000株(36,000株) |
| 5713 | 住友金属鉱山         | 132,500 | 3,050.00 | 404,125,000 |                            |
| 5714 | DOWAホールディングス   | 22,600  | 3,395.00 | 76,727,000  | 貸付有価証券<br>12,800株(12,800株) |
| 5715 | 古河機械金属         | 16,000  | 1,361.00 | 21,776,000  | 貸付有価証券<br>12,800株(12,800株) |
| 5721 | エス・サイエンス       | 42,800  | 57.00    | 2,439,600   | 貸付有価証券<br>21,500株(21,500株) |
| 5726 | 大阪チタニウムテクノロジーズ | 11,200  | 1,634.00 | 18,300,800  | 貸付有価証券<br>8,100株(8,100株)   |
| 5727 | 東邦チタニウム        | 17,300  | 971.00   | 16,798,300  | 貸付有価証券<br>14,000株(14,000株) |
| 5741 | UACJ           | 14,700  | 2,376.00 | 34,927,200  | 貸付有価証券<br>11,500株(11,500株) |
| 5757 | CKサンエツ         | 1,800   | 2,493.00 | 4,487,400   |                            |
| 5801 | 古河電気工業         | 27,900  | 3,265.00 | 91,093,500  |                            |
| 5802 | 住友電気工業         | 361,900 | 1,551.50 | 561,487,850 |                            |
| 5803 | フジクラ           | 116,900 | 474.00   | 55,410,600  |                            |
| 5805 | 昭和電線ホールディングス   | 11,200  | 616.00   | 6,899,200   |                            |
| 5807 | 東京特殊電線         | 1,200   | 1,952.00 | 2,342,400   |                            |
| 5809 | タツタ電線          | 19,200  | 496.00   | 9,523,200   | 貸付有価証券<br>7,400株(7,400株)   |
| 5819 | カナレ電気          | 1,600   | 1,807.00 | 2,891,200   |                            |
| 5821 | 平河ヒューテック       | 4,000   | 1,178.00 | 4,712,000   |                            |
| 5851 | リョービ           | 11,900  | 2,764.00 | 32,891,600  |                            |

|      |                  |         |          |             |                            |
|------|------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 5852 | アーレスティ           | 11,900  | 662.00   | 7,877,800   |                            |
| 5857 | アサヒホールディングス      | 18,200  | 2,313.00 | 42,096,600  |                            |
| 3421 | 稲葉製作所            | 5,400   | 1,258.00 | 6,793,200   |                            |
| 3431 | 宮地エンジニアリンググループ   | 2,900   | 1,996.00 | 5,788,400   | 貸付有価証券<br>1,700株(1,700株)   |
| 3433 | トーカロ             | 25,000  | 933.00   | 23,325,000  | 貸付有価証券<br>5,600株(5,600株)   |
| 3434 | アルファCo           | 3,400   | 1,274.00 | 4,331,600   |                            |
| 3436 | SUMCO            | 106,900 | 1,501.00 | 160,456,900 |                            |
| 3443 | 川田テクノロジーズ        | 2,100   | 6,770.00 | 14,217,000  |                            |
| 3445 | RS Technologies  | 1,900   | 2,790.00 | 5,301,000   | 貸付有価証券<br>900株(900株)       |
| 5901 | 東洋製罐グループホールディングス | 61,600  | 2,441.00 | 150,365,600 |                            |
| 5902 | ホッカンホールディングス     | 4,900   | 1,671.00 | 8,187,900   |                            |
| 5909 | コロナ              | 5,300   | 1,065.00 | 5,644,500   |                            |
| 5911 | 横河ブリッジホールディングス   | 18,000  | 1,704.00 | 30,672,000  | 貸付有価証券<br>15,600株(15,600株) |
| 5915 | 駒井ハルテック          | 1,800   | 1,882.00 | 3,387,600   | 貸付有価証券<br>1,400株(1,400株)   |
| 5923 | 高田機工             | 900     | 2,700.00 | 2,430,000   |                            |
| 5929 | 三和ホールディングス       | 100,000 | 1,179.00 | 117,900,000 | 貸付有価証券<br>100株(100株)       |
| 5930 | 文化シャッター          | 28,500  | 703.00   | 20,035,500  |                            |
| 5932 | 三協立山             | 13,400  | 1,333.00 | 17,862,200  | 貸付有価証券<br>10,800株(10,800株) |
| 5933 | アルインコ            | 7,700   | 950.00   | 7,315,000   |                            |
| 5936 | 東洋シャッター          | 2,300   | 630.00   | 1,449,000   | 貸付有価証券<br>600株(600株)       |
| 5938 | LIXILグループ        | 142,800 | 1,518.00 | 216,770,400 | 貸付有価証券<br>80,300株(80,300株) |
| 5942 | 日本ファイルコン         | 7,400   | 533.00   | 3,944,200   |                            |
| 5943 | ノーリツ             | 21,600  | 1,494.00 | 32,270,400  | 貸付有価証券<br>4,900株(4,900株)   |
| 5946 | 長府製作所            | 9,800   | 2,082.00 | 20,403,600  | 貸付有価証券<br>8,800株(8,800株)   |
| 5947 | リンナイ             | 17,300  | 7,140.00 | 123,522,000 |                            |
| 5951 | ダイニチ工業           | 5,200   | 707.00   | 3,676,400   |                            |
| 5957 | 日東精工             | 13,400  | 489.00   | 6,552,600   |                            |
| 5958 | 三洋工業             | 1,300   | 1,880.00 | 2,444,000   |                            |
| 5959 | 岡部               | 19,600  | 855.00   | 16,758,000  | 貸付有価証券<br>700株(700株)       |
| 5970 | ジーテクト            | 10,700  | 1,560.00 | 16,692,000  |                            |
| 5974 | 中国工業             | 1,500   | 564.00   | 846,000     |                            |
| 5975 | 東プレ              | 18,100  | 2,356.00 | 42,643,600  | 貸付有価証券<br>15,900株(15,900株) |
| 5976 | 高周波熱錬            | 18,600  | 844.00   | 15,698,400  |                            |
| 5981 | 東京製綱             | 5,900   | 990.00   | 5,841,000   |                            |

|      |             |         |           |             |                            |
|------|-------------|---------|-----------|-------------|----------------------------|
| 5985 | サンコール       | 5,400   | 635.00    | 3,429,000   |                            |
| 5986 | モリテック スチール  | 7,500   | 415.00    | 3,112,500   | 貸付有価証券<br>4,100株(4,100株)   |
| 5988 | パイオラックス     | 15,500  | 2,257.00  | 34,983,500  | 貸付有価証券<br>12,300株(12,300株) |
| 5989 | エイチワン       | 9,500   | 1,043.00  | 9,908,500   |                            |
| 5991 | 日本発條        | 96,400  | 1,013.00  | 97,653,200  |                            |
| 5992 | 中央発條        | 1,200   | 3,145.00  | 3,774,000   | 貸付有価証券<br>100株(100株)       |
| 5998 | アドバネクス      | 1,300   | 1,561.00  | 2,029,300   |                            |
| 7989 | 立川ブラインド工業   | 4,300   | 1,001.00  | 4,304,300   | 貸付有価証券<br>1,700株(1,700株)   |
| 8155 | 三益半導体工業     | 7,600   | 1,400.00  | 10,640,000  |                            |
| 1909 | 日本ドライケミカル   | 2,600   | 1,149.00  | 2,987,400   | 貸付有価証券<br>100株(100株)       |
| 5631 | 日本製鋼所       | 29,400  | 1,994.00  | 58,623,600  |                            |
| 6005 | 三浦工業        | 41,900  | 2,609.00  | 109,317,100 | 貸付有価証券<br>36,900株(36,900株) |
| 6013 | タクマ         | 35,300  | 1,387.00  | 48,961,100  |                            |
| 6101 | ツガミ         | 21,700  | 721.00    | 15,645,700  | 貸付有価証券<br>16,400株(16,400株) |
| 6103 | オークマ        | 12,300  | 5,670.00  | 69,741,000  | 貸付有価証券<br>7,400株(7,400株)   |
| 6104 | 東芝機械        | 10,900  | 2,206.00  | 24,045,400  | 貸付有価証券<br>8,800株(8,800株)   |
| 6113 | アマダホールディングス | 149,400 | 1,097.00  | 163,891,800 |                            |
| 6118 | アイダエンジニアリング | 26,900  | 777.00    | 20,901,300  |                            |
| 6121 | 滝澤鉄工所       | 3,000   | 1,512.00  | 4,536,000   |                            |
| 6134 | F U J I     | 29,000  | 1,406.00  | 40,774,000  |                            |
| 6135 | 牧野フライス製作所   | 11,300  | 4,495.00  | 50,793,500  |                            |
| 6136 | オーエスジー      | 47,700  | 2,200.00  | 104,940,000 |                            |
| 6138 | ダイジェット工業    | 1,100   | 1,793.00  | 1,972,300   |                            |
| 6140 | 旭ダイヤモンド工業   | 25,400  | 706.00    | 17,932,400  | 貸付有価証券<br>14,800株(14,800株) |
| 6141 | D M G 森精機   | 61,200  | 1,469.00  | 89,902,800  | 貸付有価証券<br>30,400株(30,400株) |
| 6143 | ソディック       | 21,100  | 826.00    | 17,428,600  |                            |
| 6146 | ディスコ        | 13,100  | 15,850.00 | 207,635,000 | 貸付有価証券<br>6,400株(6,400株)   |
| 6151 | 日東工器        | 5,300   | 2,110.00  | 11,183,000  |                            |
| 6157 | 日進工具        | 2,800   | 2,505.00  | 7,014,000   | 貸付有価証券<br>1,700株(1,700株)   |
| 6165 | パンチ工業       | 6,700   | 553.00    | 3,705,100   |                            |
| 6167 | 富士ダイス       | 4,300   | 651.00    | 2,799,300   |                            |
| 6203 | 豊和工業        | 5,300   | 795.00    | 4,213,500   | 貸付有価証券<br>4,800株(4,800株)   |
| 6205 | O K K       | 4,000   | 809.00    | 3,236,000   |                            |
| 6208 | 石川製作所       | 2,300   | 1,250.00  | 2,875,000   |                            |



|      |                |        |           |               |                            |
|------|----------------|--------|-----------|---------------|----------------------------|
| 6210 | 東洋機械金属         | 6,900  | 591.00    | 4,077,900     |                            |
| 6217 | 津田駒工業          | 2,100  | 1,912.00  | 4,015,200     | 貸付有価証券<br>1,900株(1,900株)   |
| 6218 | エンシュウ          | 2,500  | 1,013.00  | 2,532,500     | 貸付有価証券<br>2,000株(2,000株)   |
| 6222 | 島精機製作所         | 13,300 | 3,560.00  | 47,348,000    | 貸付有価証券<br>9,400株(9,400株)   |
| 6235 | オプトラン          | 9,400  | 1,845.00  | 17,343,000    | 貸付有価証券<br>3,600株(3,600株)   |
| 6236 | NCホールディングス     | 3,100  | 545.00    | 1,689,500     |                            |
| 6238 | フリュー           | 7,700  | 1,024.00  | 7,884,800     |                            |
| 6240 | ヤマシンフィルタ       | 16,800 | 671.00    | 11,272,800    | 貸付有価証券<br>6,000株(6,000株)   |
| 6247 | 日阪製作所          | 11,900 | 812.00    | 9,662,800     |                            |
| 6250 | やまびこ           | 18,800 | 1,110.00  | 20,868,000    |                            |
| 6258 | 平田機工           | 4,600  | 6,650.00  | 30,590,000    | 貸付有価証券<br>1,700株(1,700株)   |
| 6262 | ベガサスミシン製造      | 9,100  | 742.00    | 6,752,200     |                            |
| 6264 | マルマエ           | 2,600  | 709.00    | 1,843,400     |                            |
| 6266 | タツモ            | 3,000  | 774.00    | 2,322,000     | 貸付有価証券<br>1,100株(1,100株)   |
| 6268 | ナプテスコ          | 53,200 | 2,825.00  | 150,290,000   | 貸付有価証券<br>10,600株(10,600株) |
| 6269 | 三井海洋開発         | 10,300 | 2,408.00  | 24,802,400    | 貸付有価証券<br>4,800株(4,800株)   |
| 6272 | レオン自動機         | 9,500  | 1,369.00  | 13,005,500    | 貸付有価証券<br>6,800株(6,800株)   |
| 6273 | S M C          | 28,700 | 36,700.00 | 1,053,290,000 | 貸付有価証券<br>16,200株(16,200株) |
| 6274 | 新川             | 7,300  | 407.00    | 2,971,100     | 貸付有価証券<br>2,400株(2,400株)   |
| 6277 | ホソカワミクロン       | 3,400  | 4,330.00  | 14,722,000    |                            |
| 6278 | ユニオンツール        | 4,200  | 3,065.00  | 12,873,000    |                            |
| 6282 | オイレス工業         | 13,500 | 1,833.00  | 24,745,500    | 貸付有価証券<br>2,800株(2,800株)   |
| 6284 | 日精イー・エス・ビー機械   | 2,800  | 3,835.00  | 10,738,000    | 貸付有価証券<br>2,300株(2,300株)   |
| 6287 | サトーホールディングス    | 11,700 | 2,573.00  | 30,104,100    |                            |
| 6289 | 技研製作所          | 6,700  | 3,300.00  | 22,110,000    |                            |
| 6291 | 日本エアーテック       | 3,000  | 592.00    | 1,776,000     | 貸付有価証券<br>2,300株(2,300株)   |
| 6292 | カワタ            | 2,000  | 1,448.00  | 2,896,000     | 貸付有価証券<br>700株(700株)       |
| 6293 | 日精樹脂工業         | 8,100  | 930.00    | 7,533,000     |                            |
| 6294 | オカダアイヨン        | 3,300  | 1,510.00  | 4,983,000     | 貸付有価証券<br>1,300株(1,300株)   |
| 6298 | ワイエイシイホールディングス | 3,900  | 660.00    | 2,574,000     | 貸付有価証券<br>2,900株(2,900株)   |

|      |              |         |           |               |                              |
|------|--------------|---------|-----------|---------------|------------------------------|
| 6301 | 小松製作所        | 443,100 | 2,841.00  | 1,258,847,100 | 貸付有価証券<br>268,900株(268,900株) |
| 6302 | 住友重機械工業      | 56,000  | 3,690.00  | 206,640,000   |                              |
| 6305 | 日立建機         | 39,200  | 2,775.00  | 108,780,000   |                              |
| 6306 | 日工           | 2,700   | 2,309.00  | 6,234,300     | 貸付有価証券<br>1,800株(1,800株)     |
| 6309 | 巴工業          | 4,200   | 2,444.00  | 10,264,800    | 貸付有価証券<br>200株(200株)         |
| 6310 | 井関農機         | 9,800   | 1,625.00  | 15,925,000    | 貸付有価証券<br>8,400株(8,400株)     |
| 6315 | TOWA         | 8,400   | 697.00    | 5,854,800     | 貸付有価証券<br>6,900株(6,900株)     |
| 6316 | 丸山製作所        | 2,100   | 1,362.00  | 2,860,200     |                              |
| 6317 | 北川鉄工所        | 4,400   | 2,293.00  | 10,089,200    |                              |
| 6323 | ローツェ         | 4,300   | 1,605.00  | 6,901,500     | 貸付有価証券<br>2,200株(2,200株)     |
| 6325 | タカキタ         | 3,400   | 640.00    | 2,176,000     |                              |
| 6326 | クボタ          | 525,000 | 1,713.50  | 899,587,500   |                              |
| 6328 | 荏原実業         | 2,900   | 2,126.00  | 6,165,400     |                              |
| 6331 | 三菱化工機        | 3,400   | 1,498.00  | 5,093,200     |                              |
| 6332 | 月島機械         | 19,400  | 1,357.00  | 26,325,800    | 貸付有価証券<br>12,800株(12,800株)   |
| 6333 | 帝国電機製作所      | 6,800   | 1,217.00  | 8,275,600     |                              |
| 6335 | 東京機械製作所      | 3,800   | 402.00    | 1,527,600     | 貸付有価証券<br>3,000株(3,000株)     |
| 6339 | 新東工業         | 23,200  | 948.00    | 21,993,600    |                              |
| 6340 | 澁谷工業         | 8,600   | 3,630.00  | 31,218,000    | 貸付有価証券<br>6,800株(6,800株)     |
| 6345 | アイチ コーポレーション | 16,900  | 623.00    | 10,528,700    | 貸付有価証券<br>11,600株(11,600株)   |
| 6349 | 小森コーポレーション   | 26,500  | 1,218.00  | 32,277,000    |                              |
| 6351 | 鶴見製作所        | 7,600   | 1,913.00  | 14,538,800    | 貸付有価証券<br>6,100株(6,100株)     |
| 6355 | 住友精密工業       | 1,600   | 3,135.00  | 5,016,000     |                              |
| 6358 | 酒井重工業        | 1,800   | 2,332.00  | 4,197,600     |                              |
| 6361 | 荏原製作所        | 43,400  | 3,010.00  | 130,634,000   |                              |
| 6362 | 石井鐵工所        | 1,500   | 1,803.00  | 2,704,500     | 貸付有価証券<br>1,200株(1,200株)     |
| 6363 | 西島製作所        | 10,000  | 919.00    | 9,190,000     | 貸付有価証券<br>5,100株(5,100株)     |
| 6364 | 北越工業         | 10,100  | 1,073.00  | 10,837,300    |                              |
| 6367 | ダイキン工業       | 133,600 | 11,695.00 | 1,562,452,000 |                              |
| 6368 | オルガノ         | 3,500   | 2,596.00  | 9,086,000     |                              |
| 6369 | トーヨーカネツ      | 3,700   | 2,320.00  | 8,584,000     | 貸付有価証券<br>2,800株(2,800株)     |
| 6370 | 栗田工業         | 53,000  | 2,721.00  | 144,213,000   |                              |
| 6371 | 橋本チエイン       | 12,800  | 4,025.00  | 51,520,000    |                              |

|      |                 |        |          |             |                            |
|------|-----------------|--------|----------|-------------|----------------------------|
| 6373 | 大同工業            | 4,600  | 948.00   | 4,360,800   |                            |
| 6378 | 木村化工機           | 8,100  | 362.00   | 2,932,200   |                            |
| 6381 | アネスト岩田          | 15,200 | 940.00   | 14,288,000  |                            |
| 6383 | ダイフク            | 53,900 | 5,390.00 | 290,521,000 | 貸付有価証券<br>23,500株(23,500株) |
| 6387 | サムコ             | 2,700  | 970.00   | 2,619,000   | 貸付有価証券<br>500株(500株)       |
| 6390 | 加藤製作所           | 5,000  | 2,757.00 | 13,785,000  | 貸付有価証券<br>3,600株(3,600株)   |
| 6393 | 油研工業            | 1,600  | 1,962.00 | 3,139,200   |                            |
| 6395 | タダノ             | 47,200 | 1,260.00 | 59,472,000  | 貸付有価証券<br>30,500株(30,500株) |
| 6406 | フジテック           | 35,600 | 1,192.00 | 42,435,200  |                            |
| 6407 | C K D           | 27,200 | 1,080.00 | 29,376,000  | 貸付有価証券<br>22,000株(22,000株) |
| 6409 | キトー             | 7,400  | 1,668.00 | 12,343,200  |                            |
| 6412 | 平和              | 27,300 | 2,287.00 | 62,435,100  |                            |
| 6413 | 理想科学工業          | 8,600  | 1,641.00 | 14,112,600  |                            |
| 6417 | S A N K Y O     | 24,500 | 4,185.00 | 102,532,500 |                            |
| 6418 | 日本金銭機械          | 10,800 | 1,000.00 | 10,800,000  |                            |
| 6419 | マースグループホールディングス | 6,200  | 2,222.00 | 13,776,400  |                            |
| 6420 | 福島工業            | 6,000  | 3,810.00 | 22,860,000  |                            |
| 6428 | オーイズミ           | 4,100  | 366.00   | 1,500,600   |                            |
| 6430 | ダイコク電機          | 4,500  | 1,518.00 | 6,831,000   |                            |
| 6432 | 竹内製作所           | 16,400 | 1,948.00 | 31,947,200  |                            |
| 6436 | アマノ             | 28,000 | 2,227.00 | 62,356,000  | 貸付有価証券<br>24,400株(24,400株) |
| 6440 | J U K I         | 13,600 | 1,237.00 | 16,823,200  |                            |
| 6444 | サンデンホールディングス    | 11,900 | 834.00   | 9,924,600   | 貸付有価証券<br>9,600株(9,600株)   |
| 6445 | 蛇の目ミシン工業        | 8,900  | 499.00   | 4,441,100   |                            |
| 6454 | マックス            | 15,000 | 1,376.00 | 20,640,000  |                            |
| 6457 | グローリー           | 27,100 | 2,686.00 | 72,790,600  |                            |
| 6458 | 新晃工業            | 9,100  | 1,436.00 | 13,067,600  |                            |
| 6459 | 大和冷機工業          | 14,100 | 1,095.00 | 15,439,500  |                            |
| 6460 | セガサミーホールディングス   | 97,100 | 1,529.00 | 148,465,900 |                            |
| 6461 | 日本ピストンリング       | 3,600  | 1,772.00 | 6,379,200   |                            |
| 6462 | リケン             | 4,500  | 4,865.00 | 21,892,500  | 貸付有価証券<br>3,600株(3,600株)   |
| 6463 | T P R           | 13,200 | 2,327.00 | 30,716,400  |                            |
| 6464 | ツバキ・ナカシマ        | 14,800 | 1,780.00 | 26,344,000  | 貸付有価証券<br>6,800株(6,800株)   |
| 6465 | ホシザキ            | 28,600 | 7,820.00 | 223,652,000 |                            |
| 6470 | 大豊工業            | 8,000  | 1,000.00 | 8,000,000   | 貸付有価証券<br>300株(300株)       |

|      |              |         |          |               |                              |
|------|--------------|---------|----------|---------------|------------------------------|
| 6471 | 日本精工         | 201,000 | 1,062.00 | 213,462,000   | 貸付有価証券<br>123,000株(123,000株) |
| 6472 | N T N        | 210,300 | 359.00   | 75,497,700    | 貸付有価証券<br>128,000株(128,000株) |
| 6473 | ジェイテクト       | 93,900  | 1,421.00 | 133,431,900   |                              |
| 6474 | 不二越          | 9,100   | 4,400.00 | 40,040,000    | 貸付有価証券<br>7,300株(7,300株)     |
| 6480 | 日本トムソン       | 29,000  | 556.00   | 16,124,000    | 貸付有価証券<br>22,000株(22,000株)   |
| 6481 | T H K        | 61,000  | 2,580.00 | 157,380,000   |                              |
| 6482 | ユーシン精機       | 7,600   | 955.00   | 7,258,000     |                              |
| 6485 | 前澤給装工業       | 3,800   | 1,830.00 | 6,954,000     |                              |
| 6486 | イーグル工業       | 12,100  | 1,281.00 | 15,500,100    | 貸付有価証券<br>7,000株(7,000株)     |
| 6489 | 前澤工業         | 7,200   | 357.00   | 2,570,400     |                              |
| 6490 | 日本ピラー工業      | 9,900   | 1,397.00 | 13,830,300    |                              |
| 6498 | キッツ          | 39,700  | 895.00   | 35,531,500    |                              |
| 6586 | マキタ          | 119,100 | 3,905.00 | 465,085,500   | 貸付有価証券<br>71,800株(71,800株)   |
| 7004 | 日立造船         | 77,600  | 363.00   | 28,168,800    | 貸付有価証券<br>46,000株(46,000株)   |
| 7011 | 三菱重工業        | 164,000 | 4,177.00 | 685,028,000   | 貸付有価証券<br>98,000株(98,000株)   |
| 7013 | I H I        | 75,200  | 3,395.00 | 255,304,000   |                              |
| 7718 | スター精密        | 16,900  | 1,612.00 | 27,242,800    |                              |
| 3105 | 日清紡ホールディングス  | 54,300  | 939.00   | 50,987,700    |                              |
| 4062 | イビデン         | 59,900  | 1,562.00 | 93,563,800    |                              |
| 4902 | コニカミノルタ      | 213,800 | 1,068.00 | 228,338,400   |                              |
| 6448 | ブラザー工業       | 127,500 | 1,833.00 | 233,707,500   |                              |
| 6479 | ミネベアミツミ      | 181,700 | 1,768.00 | 321,245,600   | 貸付有価証券<br>87,300株(87,300株)   |
| 6501 | 日立製作所        | 440,600 | 3,427.00 | 1,509,936,200 | 貸付有価証券<br>233,400株(233,400株) |
| 6503 | 三菱電機         | 978,700 | 1,378.00 | 1,348,648,600 | 貸付有価証券<br>315,600株(315,600株) |
| 6504 | 富士電機         | 63,500  | 3,360.00 | 213,360,000   |                              |
| 6505 | 東洋電機製造       | 3,800   | 1,307.00 | 4,966,600     | 貸付有価証券<br>3,000株(3,000株)     |
| 6506 | 安川電機         | 113,400 | 3,115.00 | 353,241,000   | 貸付有価証券<br>60,000株(60,000株)   |
| 6507 | シンフォニアテクノロジー | 13,600  | 1,333.00 | 18,128,800    |                              |
| 6508 | 明電舎          | 19,400  | 1,472.00 | 28,556,800    |                              |
| 6513 | オリジン電気       | 2,600   | 1,755.00 | 4,563,000     |                              |
| 6516 | 山洋電気         | 4,700   | 4,125.00 | 19,387,500    | 貸付有価証券<br>700株(700株)         |

|      |                   |         |           |               |                            |
|------|-------------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
| 6517 | デンヨー              | 9,000   | 1,422.00  | 12,798,000    |                            |
| 6588 | 東芝テック             | 12,300  | 2,592.00  | 31,881,600    |                            |
| 6590 | 芝浦メカトロニクス         | 1,700   | 3,685.00  | 6,264,500     |                            |
| 6592 | マブチモーター           | 27,100  | 3,780.00  | 102,438,000   |                            |
| 6594 | 日本電産              | 117,800 | 12,920.00 | 1,521,976,000 | 貸付有価証券<br>61,200株(61,200株) |
| 6615 | ユー・エム・シー・エレクトロニクス | 5,300   | 1,729.00  | 9,163,700     |                            |
| 6616 | トレックス・セミコンダクター    | 3,300   | 1,269.00  | 4,187,700     |                            |
| 6617 | 東光高岳              | 4,900   | 1,390.00  | 6,811,000     |                            |
| 6619 | ダブル・スコープ          | 14,300  | 1,154.00  | 16,502,200    | 貸付有価証券<br>8,800株(8,800株)   |
| 6620 | 宮越ホールディングス        | 3,600   | 1,044.00  | 3,758,400     | 貸付有価証券<br>2,600株(2,600株)   |
| 6622 | ダイヘン              | 10,700  | 2,481.00  | 26,546,700    | 貸付有価証券<br>9,000株(9,000株)   |
| 6624 | 田淵電機              | 13,500  | 127.00    | 1,714,500     | 貸付有価証券<br>5,600株(5,600株)   |
| 6630 | ヤーマン              | 14,200  | 1,327.00  | 18,843,400    | 貸付有価証券<br>5,400株(5,400株)   |
| 6632 | JVCケンウッド          | 74,700  | 259.00    | 19,347,300    |                            |
| 6638 | ミマキエンジニアリング       | 8,800   | 775.00    | 6,820,000     |                            |
| 6640 | 第一精工              | 4,100   | 1,241.00  | 5,088,100     | 貸付有価証券<br>3,200株(3,200株)   |
| 6641 | 日新電機              | 22,900  | 936.00    | 21,434,400    |                            |
| 6644 | 大崎電気工業            | 19,500  | 720.00    | 14,040,000    |                            |
| 6645 | オムロン              | 104,000 | 4,425.00  | 460,200,000   | 貸付有価証券<br>62,100株(62,100株) |
| 6651 | 日東工業              | 15,700  | 1,934.00  | 30,363,800    | 貸付有価証券<br>3,900株(3,900株)   |
| 6652 | I D E C           | 13,100  | 2,002.00  | 26,226,200    | 貸付有価証券<br>10,300株(10,300株) |
| 6653 | 正興電機製作所           | 1,200   | 872.00    | 1,046,400     |                            |
| 6654 | 不二電機工業            | 1,100   | 1,319.00  | 1,450,900     |                            |
| 6674 | ジーエス・ユアサ コーポレーション | 35,200  | 2,265.00  | 79,728,000    | 貸付有価証券<br>21,200株(21,200株) |
| 6675 | サクサホールディングス       | 2,500   | 1,789.00  | 4,472,500     |                            |
| 6676 | メルコホールディングス       | 4,100   | 3,490.00  | 14,309,000    |                            |
| 6678 | テクノメディカ           | 2,200   | 2,053.00  | 4,516,600     |                            |
| 6701 | 日本電気              | 126,600 | 3,460.00  | 438,036,000   |                            |
| 6702 | 富士通               | 94,300  | 7,373.00  | 695,273,900   |                            |
| 6703 | 沖電気工業             | 42,400  | 1,396.00  | 59,190,400    | 貸付有価証券<br>15,600株(15,600株) |
| 6704 | 岩崎通信機             | 4,600   | 772.00    | 3,551,200     |                            |
| 6706 | 電気興業              | 5,100   | 2,369.00  | 12,081,900    |                            |
| 6707 | サンケン電気            | 11,400  | 2,315.00  | 26,391,000    |                            |
| 6715 | ナカヨ               | 1,900   | 1,452.00  | 2,758,800     |                            |
| 6718 | アイホン              | 5,500   | 1,658.00  | 9,119,000     |                            |

|      |                  |           |          |               |                              |
|------|------------------|-----------|----------|---------------|------------------------------|
| 6723 | ルネサスエレクトロニクス     | 101,400   | 647.00   | 65,605,800    | 貸付有価証券<br>40,900株(40,900株)   |
| 6724 | セイコーエプソン         | 121,400   | 1,688.00 | 204,923,200   | 貸付有価証券<br>75,200株(75,200株)   |
| 6727 | ワコム              | 70,800    | 467.00   | 33,063,600    | 貸付有価証券<br>43,300株(43,300株)   |
| 6728 | アルバック            | 22,500    | 3,555.00 | 79,987,500    | 貸付有価証券<br>13,300株(13,300株)   |
| 6730 | アクセル             | 4,100     | 480.00   | 1,968,000     | 貸付有価証券<br>2,300株(2,300株)     |
| 6737 | E I Z O          | 9,000     | 4,260.00 | 38,340,000    | 貸付有価証券<br>7,800株(7,800株)     |
| 6740 | ジャパンディスプレイ       | 231,400   | 79.00    | 18,280,600    | 貸付有価証券<br>181,400株(181,400株) |
| 6741 | 日本信号             | 24,900    | 903.00   | 22,484,700    | 貸付有価証券<br>21,800株(21,800株)   |
| 6742 | 京三製作所            | 21,000    | 420.00   | 8,820,000     |                              |
| 6744 | 能美防災             | 12,900    | 1,873.00 | 24,161,700    |                              |
| 6745 | ホーチキ             | 6,200     | 1,079.00 | 6,689,800     |                              |
| 6748 | 星和電機             | 3,900     | 386.00   | 1,505,400     | 貸付有価証券<br>1,400株(1,400株)     |
| 6750 | エレコム             | 9,000     | 2,837.00 | 25,533,000    |                              |
| 6752 | パナソニック           | 1,118,100 | 1,063.00 | 1,188,540,300 |                              |
| 6753 | シャープ             | 97,100    | 1,223.00 | 118,753,300   | 貸付有価証券<br>36,800株(36,800株)   |
| 6754 | アンリツ             | 63,000    | 1,648.00 | 103,824,000   | 貸付有価証券<br>32,000株(32,000株)   |
| 6755 | 富士通ゼネラル          | 29,900    | 1,383.00 | 41,351,700    |                              |
| 6758 | ソニー              | 656,300   | 5,373.00 | 3,526,299,900 |                              |
| 6762 | T D K            | 51,200    | 8,000.00 | 409,600,000   |                              |
| 6763 | 帝国通信工業           | 4,300     | 1,201.00 | 5,164,300     | 貸付有価証券<br>800株(800株)         |
| 6768 | タムラ製作所           | 37,700    | 581.00   | 21,903,700    | 貸付有価証券<br>1,000株(1,000株)     |
| 6770 | アルプスアルパイン        | 101,900   | 2,298.00 | 234,166,200   |                              |
| 6771 | 池上通信機            | 3,100     | 1,185.00 | 3,673,500     | 貸付有価証券<br>2,400株(2,400株)     |
| 6773 | パイオニア            | 163,100   | 65.00    | 10,601,500    |                              |
| 6779 | 日本電波工業           | 8,800     | 389.00   | 3,423,200     | 貸付有価証券<br>2,500株(2,500株)     |
| 6785 | 鈴木               | 4,800     | 641.00   | 3,076,800     | 貸付有価証券<br>1,400株(1,400株)     |
| 6788 | 日本トリム            | 1,800     | 5,700.00 | 10,260,000    | 貸付有価証券<br>1,600株(1,600株)     |
| 6789 | ローランド ディー . ジー . | 5,000     | 2,110.00 | 10,550,000    |                              |
| 6794 | フォスター電機          | 11,500    | 1,526.00 | 17,549,000    | 貸付有価証券<br>9,800株(9,800株)     |
| 6796 | クラリオン            | 8,300     | 2,492.00 | 20,683,600    |                              |

|      |                     |        |           |               |                            |
|------|---------------------|--------|-----------|---------------|----------------------------|
| 6798 | S M K               | 2,700  | 2,358.00  | 6,366,600     |                            |
| 6800 | ヨコオ                 | 7,000  | 1,431.00  | 10,017,000    | 貸付有価証券<br>5,600株(5,600株)   |
| 6803 | ティアック               | 7,000  | 216.00    | 1,512,000     | 貸付有価証券<br>4,500株(4,500株)   |
| 6804 | ホシデン                | 28,800 | 821.00    | 23,644,800    | 貸付有価証券<br>2,800株(2,800株)   |
| 6806 | ヒロセ電機               | 14,000 | 11,370.00 | 159,180,000   | 貸付有価証券<br>10,500株(10,500株) |
| 6807 | 日本航空電子工業            | 22,400 | 1,432.00  | 32,076,800    |                            |
| 6809 | T O A               | 10,500 | 1,023.00  | 10,741,500    |                            |
| 6810 | マクセルホールディングス        | 21,100 | 1,547.00  | 32,641,700    |                            |
| 6814 | 古野電気                | 12,600 | 914.00    | 11,516,400    |                            |
| 6815 | ユニデンホールディングス        | 2,900  | 2,112.00  | 6,124,800     | 貸付有価証券<br>2,400株(2,400株)   |
| 6817 | スミダコーポレーション         | 8,300  | 1,221.00  | 10,134,300    | 貸付有価証券<br>5,300株(5,300株)   |
| 6820 | アイコム                | 5,400  | 2,151.00  | 11,615,400    |                            |
| 6823 | リオン                 | 4,500  | 1,694.00  | 7,623,000     |                            |
| 6826 | 本多通信工業              | 8,400  | 514.00    | 4,317,600     |                            |
| 6839 | 船井電機                | 9,900  | 577.00    | 5,712,300     |                            |
| 6841 | 横河電機                | 97,900 | 1,994.00  | 195,212,600   |                            |
| 6844 | 新電元工業               | 3,500  | 4,260.00  | 14,910,000    |                            |
| 6845 | アズビル                | 63,200 | 2,216.00  | 140,051,200   |                            |
| 6848 | 東亜ディーケーケー           | 4,800  | 755.00    | 3,624,000     |                            |
| 6849 | 日本光電工業              | 43,100 | 3,285.00  | 141,583,500   | 貸付有価証券<br>23,400株(23,400株) |
| 6850 | チノー                 | 3,400  | 1,260.00  | 4,284,000     |                            |
| 6853 | 共和電業                | 10,200 | 365.00    | 3,723,000     |                            |
| 6855 | 日本電子材料              | 3,900  | 729.00    | 2,843,100     | 貸付有価証券<br>3,100株(3,100株)   |
| 6856 | 堀場製作所               | 19,400 | 5,310.00  | 103,014,000   | 貸付有価証券<br>10,200株(10,200株) |
| 6857 | アドバンテスト             | 66,700 | 2,409.00  | 160,680,300   | 貸付有価証券<br>40,800株(40,800株) |
| 6858 | 小野測器                | 4,600  | 598.00    | 2,750,800     |                            |
| 6859 | エスベック               | 8,700  | 1,987.00  | 17,286,900    |                            |
| 6861 | キーエンス               | 48,000 | 54,970.00 | 2,638,560,000 |                            |
| 6866 | 日置電機                | 5,100  | 4,155.00  | 21,190,500    | 貸付有価証券<br>4,100株(4,100株)   |
| 6869 | シスメックス              | 76,200 | 6,032.00  | 459,638,400   | 貸付有価証券<br>46,000株(46,000株) |
| 6871 | 日本マイクロニクス           | 15,800 | 778.00    | 12,292,400    |                            |
| 6875 | メガチップス              | 7,700  | 2,823.00  | 21,737,100    | 貸付有価証券<br>5,800株(5,800株)   |
| 6877 | O B A R A G R O U P | 5,700  | 3,460.00  | 19,722,000    |                            |
| 6901 | 澤藤電機                | 1,200  | 1,700.00  | 2,040,000     |                            |

|      |                  |         |           |               |                            |
|------|------------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
| 6904 | 原田工業             | 3,000   | 891.00    | 2,673,000     |                            |
| 6905 | コーセル             | 13,600  | 1,039.00  | 14,130,400    | 貸付有価証券<br>10,900株(10,900株) |
| 6908 | イリソ電子工業          | 9,000   | 4,430.00  | 39,870,000    | 貸付有価証券<br>3,800株(3,800株)   |
| 6914 | オプテックスグループ       | 17,200  | 1,908.00  | 32,817,600    | 貸付有価証券<br>11,600株(11,600株) |
| 6915 | 千代田インテグレ         | 4,100   | 1,922.00  | 7,880,200     |                            |
| 6916 | アイ・オー・データ機器      | 4,100   | 1,142.00  | 4,682,200     |                            |
| 6920 | レーザーテック          | 20,100  | 3,450.00  | 69,345,000    | 貸付有価証券<br>11,600株(11,600株) |
| 6923 | スタンレー電気          | 69,200  | 3,220.00  | 222,824,000   |                            |
| 6924 | 岩崎電気             | 3,800   | 1,322.00  | 5,023,600     | 貸付有価証券<br>300株(300株)       |
| 6925 | ウシオ電機            | 59,400  | 1,243.00  | 73,834,200    |                            |
| 6926 | 岡谷電機産業           | 7,000   | 384.00    | 2,688,000     |                            |
| 6927 | ヘリオス テクノ ホールディング | 9,000   | 698.00    | 6,282,000     |                            |
| 6928 | エノモト             | 2,000   | 827.00    | 1,654,000     |                            |
| 6929 | 日本セラミック          | 9,900   | 2,505.00  | 24,799,500    | 貸付有価証券<br>4,500株(4,500株)   |
| 6932 | 遠藤照明             | 4,900   | 724.00    | 3,547,600     |                            |
| 6937 | 古河電池             | 7,000   | 699.00    | 4,893,000     | 貸付有価証券<br>5,000株(5,000株)   |
| 6938 | 双信電機             | 4,700   | 359.00    | 1,687,300     | 貸付有価証券<br>1,400株(1,400株)   |
| 6941 | 山一電機             | 7,100   | 1,298.00  | 9,215,800     |                            |
| 6947 | 図研               | 6,400   | 1,504.00  | 9,625,600     |                            |
| 6951 | 日本電子             | 19,300  | 1,920.00  | 37,056,000    | 貸付有価証券<br>7,500株(7,500株)   |
| 6952 | カシオ計算機           | 86,600  | 1,422.00  | 123,145,200   | 貸付有価証券<br>57,200株(57,200株) |
| 6954 | ファナック            | 93,000  | 18,675.00 | 1,736,775,000 |                            |
| 6958 | 日本シイエムケイ         | 24,900  | 690.00    | 17,181,000    | 貸付有価証券<br>13,600株(13,600株) |
| 6961 | エンプラス            | 4,400   | 3,110.00  | 13,684,000    | 貸付有価証券<br>2,100株(2,100株)   |
| 6962 | 大真空              | 3,600   | 996.00    | 3,585,600     | 貸付有価証券<br>2,200株(2,200株)   |
| 6963 | ローム              | 47,300  | 7,690.00  | 363,737,000   |                            |
| 6965 | 浜松ホトニクス          | 70,200  | 3,775.00  | 265,005,000   | 貸付有価証券<br>43,000株(43,000株) |
| 6966 | 三井ハイテック          | 10,800  | 937.00    | 10,119,600    |                            |
| 6967 | 新光電気工業           | 32,900  | 738.00    | 24,280,200    |                            |
| 6971 | 京セラ              | 149,200 | 6,099.00  | 909,970,800   |                            |
| 6976 | 太陽誘電             | 43,500  | 1,816.00  | 78,996,000    | 貸付有価証券<br>26,800株(26,800株) |
| 6981 | 村田製作所            | 102,700 | 14,895.00 | 1,529,716,500 | 貸付有価証券<br>58,100株(58,100株) |



|      |                     |         |           |               |                              |
|------|---------------------|---------|-----------|---------------|------------------------------|
| 6985 | ユーシン                | 15,000  | 981.00    | 14,715,000    |                              |
| 6986 | 双葉電子工業              | 16,000  | 1,715.00  | 27,440,000    | 貸付有価証券<br>10,200株(10,200株)   |
| 6989 | 北陸電気工業              | 3,700   | 975.00    | 3,607,500     |                              |
| 6996 | ニチコン                | 30,800  | 895.00    | 27,566,000    | 貸付有価証券<br>24,800株(24,800株)   |
| 6997 | 日本ケミコン              | 6,900   | 2,215.00  | 15,283,500    |                              |
| 6999 | K O A               | 14,800  | 1,500.00  | 22,200,000    |                              |
| 7244 | 市光工業                | 14,600  | 603.00    | 8,803,800     |                              |
| 7276 | 小糸製作所               | 58,600  | 6,330.00  | 370,938,000   | 貸付有価証券<br>30,000株(30,000株)   |
| 7280 | ミツバ                 | 18,000  | 692.00    | 12,456,000    | 貸付有価証券<br>13,400株(13,400株)   |
| 7735 | S C R E E Nホールディングス | 17,000  | 5,500.00  | 93,500,000    | 貸付有価証券<br>12,800株(12,800株)   |
| 7739 | キャノン電子              | 9,000   | 1,900.00  | 17,100,000    |                              |
| 7751 | キャノン                | 526,900 | 3,133.00  | 1,650,777,700 |                              |
| 7752 | リコー                 | 294,200 | 1,164.00  | 342,448,800   | 貸付有価証券<br>151,000株(151,000株) |
| 7965 | 象印マホービン             | 18,200  | 1,141.00  | 20,766,200    | 貸付有価証券<br>6,900株(6,900株)     |
| 7999 | M U T O Hホールディングス   | 1,300   | 1,883.00  | 2,447,900     |                              |
| 8035 | 東京エレクトロン            | 65,300  | 15,520.00 | 1,013,456,000 | 貸付有価証券<br>49,400株(49,400株)   |
| 3116 | トヨタ紡織               | 34,200  | 1,740.00  | 59,508,000    |                              |
| 3526 | 芦森工業                | 2,000   | 1,452.00  | 2,904,000     | 貸付有価証券<br>1,700株(1,700株)     |
| 5949 | ユニプレス               | 18,900  | 2,063.00  | 38,990,700    |                              |
| 6201 | 豊田自動織機              | 79,200  | 5,390.00  | 426,888,000   | 貸付有価証券<br>50,100株(50,100株)   |
| 6455 | モリタホールディングス         | 17,100  | 1,837.00  | 31,412,700    | 貸付有価証券<br>13,800株(13,800株)   |
| 6584 | 三櫻工業                | 12,400  | 602.00    | 7,464,800     |                              |
| 6902 | デンソー                | 215,500 | 5,082.00  | 1,095,171,000 |                              |
| 6995 | 東海理化電機製作所           | 25,800  | 1,983.00  | 51,161,400    |                              |
| 7003 | 三井E & Sホールディングス     | 35,300  | 1,183.00  | 41,759,900    |                              |
| 7012 | 川崎重工業               | 76,200  | 2,646.00  | 201,625,200   | 貸付有価証券<br>16,800株(16,800株)   |
| 7014 | 名村造船所               | 29,400  | 459.00    | 13,494,600    | 貸付有価証券<br>22,100株(22,100株)   |
| 7022 | サノヤスホールディングス        | 12,900  | 191.00    | 2,463,900     | 貸付有価証券<br>7,300株(7,300株)     |
| 7102 | 日本車輛製造              | 3,600   | 2,309.00  | 8,312,400     | 貸付有価証券<br>3,200株(3,200株)     |
| 7105 | 三菱ロジスネクスト           | 11,600  | 1,087.00  | 12,609,200    | 貸付有価証券<br>9,100株(9,100株)     |
| 7122 | 近畿車輛                | 1,500   | 1,992.00  | 2,988,000     | 貸付有価証券<br>1,200株(1,200株)     |

|      |              |           |          |               |                              |
|------|--------------|-----------|----------|---------------|------------------------------|
| 7201 | 日産自動車        | 1,154,200 | 920.30   | 1,062,210,260 | 貸付有価証券<br>772,700株(772,700株) |
| 7202 | いすゞ自動車       | 309,400   | 1,606.50 | 497,051,100   |                              |
| 7203 | トヨタ自動車       | 1,090,600 | 6,689.00 | 7,295,023,400 |                              |
| 7205 | 日野自動車        | 122,200   | 1,123.00 | 137,230,600   |                              |
| 7211 | 三菱自動車工業      | 362,300   | 673.00   | 243,827,900   | 貸付有価証券<br>264,900株(264,900株) |
| 7212 | エフテック        | 6,800     | 1,001.00 | 6,806,800     |                              |
| 7213 | レシップホールディングス | 3,500     | 707.00   | 2,474,500     |                              |
| 7214 | GMB          | 1,900     | 962.00   | 1,827,800     | 貸付有価証券<br>800株(800株)         |
| 7215 | ファルテック       | 1,700     | 791.00   | 1,344,700     |                              |
| 7220 | 武蔵精密工業       | 23,700    | 1,582.00 | 37,493,400    | 貸付有価証券<br>11,800株(11,800株)   |
| 7222 | 日産車体         | 19,100    | 994.00   | 18,985,400    | 貸付有価証券<br>16,700株(16,700株)   |
| 7224 | 新明和工業        | 45,600    | 1,475.00 | 67,260,000    | 貸付有価証券<br>22,000株(22,000株)   |
| 7226 | 極東開発工業       | 19,500    | 1,534.00 | 29,913,000    | 貸付有価証券<br>12,200株(12,200株)   |
| 7230 | 日信工業         | 17,900    | 1,510.00 | 27,029,000    |                              |
| 7231 | トピー工業        | 8,000     | 2,332.00 | 18,656,000    |                              |
| 7236 | ティラド         | 3,500     | 2,321.00 | 8,123,500     |                              |
| 7238 | 曙ブレーキ工業      | 53,700    | 215.00   | 11,545,500    | 貸付有価証券<br>40,000株(40,000株)   |
| 7239 | タチエス         | 16,600    | 1,514.00 | 25,132,400    |                              |
| 7240 | NOK          | 52,600    | 1,710.00 | 89,946,000    | 貸付有価証券<br>26,700株(26,700株)   |
| 7241 | フタバ産業        | 27,200    | 573.00   | 15,585,600    | 貸付有価証券<br>11,900株(11,900株)   |
| 7242 | KYB          | 10,200    | 2,964.00 | 30,232,800    |                              |
| 7245 | 大同メタル工業      | 15,900    | 813.00   | 12,926,700    | 貸付有価証券<br>3,100株(3,100株)     |
| 7246 | プレス工業        | 48,500    | 580.00   | 28,130,000    |                              |
| 7247 | ミクニ          | 12,400    | 524.00   | 6,497,600     |                              |
| 7250 | 太平洋工業        | 20,500    | 1,520.00 | 31,160,000    | 貸付有価証券<br>17,400株(17,400株)   |
| 7251 | ケーヒン         | 22,500    | 1,962.00 | 44,145,000    |                              |
| 7256 | 河西工業         | 12,000    | 902.00   | 10,824,000    |                              |
| 7259 | アイシン精機       | 80,600    | 4,370.00 | 352,222,000   | 貸付有価証券<br>51,700株(51,700株)   |
| 7261 | マツダ          | 307,200   | 1,210.50 | 371,865,600   | 貸付有価証券<br>164,000株(164,000株) |
| 7266 | 今仙電機製作所      | 9,100     | 1,014.00 | 9,227,400     |                              |
| 7267 | 本田技研工業       | 825,600   | 3,250.00 | 2,683,200,000 |                              |

|      |             |         |           |               |                              |
|------|-------------|---------|-----------|---------------|------------------------------|
| 7269 | スズキ         | 179,000 | 5,696.00  | 1,019,584,000 | 貸付有価証券<br>67,900株(67,900株)   |
| 7270 | S U B A R U | 303,800 | 2,502.50  | 760,259,500   |                              |
| 7271 | 安永          | 4,700   | 1,385.00  | 6,509,500     | 貸付有価証券<br>1,800株(1,800株)     |
| 7272 | ヤマハ発動機      | 138,200 | 2,343.00  | 323,802,600   | 貸付有価証券<br>83,700株(83,700株)   |
| 7274 | ショーワ        | 23,100  | 1,391.00  | 32,132,100    |                              |
| 7277 | T B K       | 11,600  | 410.00    | 4,756,000     |                              |
| 7278 | エクセディ       | 13,300  | 2,712.00  | 36,069,600    |                              |
| 7282 | 豊田合成        | 31,600  | 2,422.00  | 76,535,200    | 貸付有価証券<br>17,800株(17,800株)   |
| 7283 | 愛三工業        | 15,300  | 779.00    | 11,918,700    |                              |
| 7284 | 盟和産業        | 1,500   | 1,050.00  | 1,575,000     | 貸付有価証券<br>400株(400株)         |
| 7291 | 日本プラス       | 7,700   | 764.00    | 5,882,800     |                              |
| 7294 | ヨロズ         | 9,100   | 1,492.00  | 13,577,200    | 貸付有価証券<br>2,100株(2,100株)     |
| 7296 | エフ・シー・シー    | 17,600  | 2,829.00  | 49,790,400    |                              |
| 7309 | シマノ         | 39,400  | 15,150.00 | 596,910,000   | 貸付有価証券<br>19,400株(19,400株)   |
| 7313 | テイ・エス テック   | 22,700  | 3,295.00  | 74,796,500    |                              |
| 7408 | ジャムコ        | 4,900   | 2,504.00  | 12,269,600    | 貸付有価証券<br>2,100株(2,100株)     |
| 4543 | テルモ         | 138,500 | 6,117.00  | 847,204,500   |                              |
| 5187 | クリエートメディック  | 3,200   | 977.00    | 3,126,400     |                              |
| 6376 | 日機装         | 31,600  | 989.00    | 31,252,400    |                              |
| 7701 | 島津製作所       | 125,900 | 2,476.00  | 311,728,400   |                              |
| 7702 | J M S       | 9,000   | 579.00    | 5,211,000     |                              |
| 7709 | クボテック       | 2,100   | 446.00    | 936,600       | 貸付有価証券<br>1,200株(1,200株)     |
| 7715 | 長野計器        | 7,700   | 810.00    | 6,237,000     |                              |
| 7717 | ブイ・テクノロジー   | 2,300   | 15,100.00 | 34,730,000    |                              |
| 7721 | 東京計器        | 6,200   | 936.00    | 5,803,200     | 貸付有価証券<br>4,800株(4,800株)     |
| 7723 | 愛知時計電機      | 1,300   | 3,765.00  | 4,894,500     |                              |
| 7725 | インターアクション   | 5,200   | 2,232.00  | 11,606,400    | 貸付有価証券<br>2,400株(2,400株)     |
| 7727 | オーバル        | 9,500   | 235.00    | 2,232,500     |                              |
| 7729 | 東京精密        | 17,700  | 3,110.00  | 55,047,000    |                              |
| 7730 | マニー         | 11,900  | 4,810.00  | 57,239,000    |                              |
| 7731 | ニコン         | 170,500 | 1,879.00  | 320,369,500   | 貸付有価証券<br>102,800株(102,800株) |
| 7732 | トプコン        | 52,600  | 1,553.00  | 81,687,800    |                              |
| 7733 | オリンパス       | 145,800 | 4,425.00  | 645,165,000   | 貸付有価証券<br>82,000株(82,000株)   |
| 7734 | 理研計器        | 8,600   | 1,983.00  | 17,053,800    |                              |

|      |                   |         |          |               |                            |
|------|-------------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| 7740 | タムロン              | 8,700   | 1,721.00 | 14,972,700    |                            |
| 7741 | HOYA              | 197,000 | 6,224.00 | 1,226,128,000 |                            |
| 7743 | シード               | 4,200   | 1,315.00 | 5,523,000     | 貸付有価証券<br>2,100株（2,100株）   |
| 7744 | ノーリツ鋼機            | 7,700   | 1,700.00 | 13,090,000    | 貸付有価証券<br>5,800株（5,800株）   |
| 7745 | エー・アンド・デイ         | 8,900   | 697.00   | 6,203,300     |                            |
| 7747 | 朝日インテック           | 35,400  | 4,585.00 | 162,309,000   | 貸付有価証券<br>13,400株（13,400株） |
| 7762 | シチズン時計            | 107,100 | 578.00   | 61,903,800    | 貸付有価証券<br>67,800株（67,800株） |
| 7769 | リズム時計工業           | 3,300   | 1,777.00 | 5,864,100     | 貸付有価証券<br>400株（400株）       |
| 7775 | 大研医器              | 7,700   | 598.00   | 4,604,600     |                            |
| 7780 | メニコン              | 13,400  | 2,729.00 | 36,568,600    | 貸付有価証券<br>3,000株（3,000株）   |
| 7782 | シンシア              | 1,500   | 504.00   | 756,000       | 貸付有価証券<br>400株（400株）       |
| 7979 | 松風                | 4,800   | 1,100.00 | 5,280,000     |                            |
| 8050 | セイコーホールディングス      | 15,100  | 2,328.00 | 35,152,800    |                            |
| 8086 | ニプロ               | 67,700  | 1,410.00 | 95,457,000    |                            |
| 7811 | 中本パックス            | 2,700   | 1,652.00 | 4,460,400     |                            |
| 7816 | スノーピーク            | 3,700   | 1,215.00 | 4,495,500     |                            |
| 7817 | パラマウントベッドホールディングス | 11,300  | 4,500.00 | 50,850,000    |                            |
| 7818 | トランザクション          | 5,300   | 706.00   | 3,741,800     |                            |
| 7819 | SHO-BI            | 2,900   | 354.00   | 1,026,600     | 貸付有価証券<br>1,700株（1,700株）   |
| 7820 | ニホンフラッシュ          | 4,200   | 1,669.00 | 7,009,800     | 貸付有価証券<br>1,400株（1,400株）   |
| 7821 | 前田工織              | 10,800  | 2,481.00 | 26,794,800    | 貸付有価証券<br>5,800株（5,800株）   |
| 7822 | 永大産業              | 12,800  | 431.00   | 5,516,800     |                            |
| 7823 | アートネイチャー          | 10,500  | 611.00   | 6,415,500     |                            |
| 7832 | バンダイナムコホールディングス   | 101,200 | 4,700.00 | 475,640,000   |                            |
| 7833 | アイフィスジャパン         | 2,200   | 617.00   | 1,357,400     | 貸付有価証券<br>300株（300株）       |
| 7838 | 共立印刷              | 16,300  | 203.00   | 3,308,900     |                            |
| 7839 | SHOEI             | 4,700   | 3,845.00 | 18,071,500    | 貸付有価証券<br>2,700株（2,700株）   |
| 7840 | フランスベッドホールディングス   | 13,800  | 892.00   | 12,309,600    |                            |
| 7846 | パイロットコーポレーション     | 17,100  | 5,180.00 | 88,578,000    | 貸付有価証券<br>12,300株（12,300株） |
| 7856 | 萩原工業              | 5,400   | 1,509.00 | 8,148,600     | 貸付有価証券<br>2,600株（2,600株）   |
| 7862 | トッパン・フォームズ        | 21,000  | 919.00   | 19,299,000    |                            |
| 7864 | フジシールインターナショナル    | 21,900  | 3,670.00 | 80,373,000    |                            |
| 7867 | タカラトミー            | 41,000  | 1,124.00 | 46,084,000    |                            |
| 7868 | 廣濟堂               | 9,100   | 609.00   | 5,541,900     |                            |

|      |               |         |           |               |                              |
|------|---------------|---------|-----------|---------------|------------------------------|
| 7872 | エステールホールディングス | 2,600   | 655.00    | 1,703,000     |                              |
| 7873 | アーク           | 37,400  | 89.00     | 3,328,600     |                              |
| 7885 | タカノ           | 3,800   | 819.00    | 3,112,200     |                              |
| 7893 | プロネクサス        | 8,400   | 999.00    | 8,391,600     |                              |
| 7897 | ホクシン          | 6,000   | 144.00    | 864,000       | 貸付有価証券<br>4,500株(4,500株)     |
| 7898 | ウッドワン         | 3,300   | 1,055.00  | 3,481,500     |                              |
| 7905 | 大建工業          | 7,400   | 1,870.00  | 13,838,000    | 貸付有価証券<br>2,100株(2,100株)     |
| 7911 | 凸版印刷          | 138,100 | 1,780.00  | 245,818,000   |                              |
| 7912 | 大日本印刷         | 137,900 | 2,500.00  | 344,750,000   | 貸付有価証券<br>53,500株(53,500株)   |
| 7913 | 図書印刷          | 9,200   | 940.00    | 8,648,000     |                              |
| 7914 | 共同印刷          | 3,000   | 2,361.00  | 7,083,000     |                              |
| 7915 | N I S S H A   | 20,100  | 1,429.00  | 28,722,900    | 貸付有価証券<br>13,200株(13,200株)   |
| 7916 | 光村印刷          | 800     | 2,077.00  | 1,661,600     | 貸付有価証券<br>500株(500株)         |
| 7921 | 宝印刷           | 5,100   | 1,596.00  | 8,139,600     | 貸付有価証券<br>300株(300株)         |
| 7936 | アシックス         | 97,200  | 1,562.00  | 151,826,400   | 貸付有価証券<br>54,700株(54,700株)   |
| 7937 | ツツミ           | 3,100   | 1,891.00  | 5,862,100     |                              |
| 7949 | 小松ウオール工業      | 3,000   | 1,921.00  | 5,763,000     |                              |
| 7951 | ヤマハ           | 58,200  | 4,670.00  | 271,794,000   |                              |
| 7952 | 河合楽器製作所       | 3,000   | 3,080.00  | 9,240,000     |                              |
| 7955 | クリナップ         | 9,100   | 601.00    | 5,469,100     |                              |
| 7956 | ビジョン          | 59,100  | 4,070.00  | 240,537,000   |                              |
| 7961 | 兼松サステック       | 600     | 1,559.00  | 935,400       |                              |
| 7962 | キングジム         | 8,100   | 807.00    | 6,536,700     |                              |
| 7966 | リンテック         | 23,300  | 2,424.00  | 56,479,200    |                              |
| 7972 | イトーキ          | 18,000  | 571.00    | 10,278,000    |                              |
| 7974 | 任天堂           | 60,300  | 32,910.00 | 1,984,473,000 |                              |
| 7976 | 三菱鉛筆          | 16,100  | 2,240.00  | 36,064,000    | 貸付有価証券<br>11,800株(11,800株)   |
| 7981 | タカラスタンダード     | 20,200  | 1,603.00  | 32,380,600    |                              |
| 7984 | コクヨ           | 46,900  | 1,576.00  | 73,914,400    |                              |
| 7987 | ナカバヤシ         | 9,600   | 536.00    | 5,145,600     |                              |
| 7990 | グローブライド       | 4,700   | 2,525.00  | 11,867,500    |                              |
| 7994 | オカムラ          | 34,200  | 1,417.00  | 48,461,400    | 貸付有価証券<br>27,600株(27,600株)   |
| 8022 | 美津濃           | 9,700   | 2,536.00  | 24,599,200    |                              |
| 9501 | 東京電力ホールディングス  | 781,300 | 722.00    | 564,098,600   |                              |
| 9502 | 中部電力          | 299,400 | 1,722.00  | 515,566,800   | 貸付有価証券<br>181,400株(181,400株) |

|      |             |         |          |               |                              |
|------|-------------|---------|----------|---------------|------------------------------|
| 9503 | 関西電力        | 399,300 | 1,655.50 | 661,041,150   |                              |
| 9504 | 中国電力        | 135,300 | 1,490.00 | 201,597,000   | 貸付有価証券<br>76,100株(76,100株)   |
| 9505 | 北陸電力        | 95,900  | 972.00   | 93,214,800    | 貸付有価証券<br>53,900株(53,900株)   |
| 9506 | 東北電力        | 229,200 | 1,502.00 | 344,258,400   |                              |
| 9507 | 四国電力        | 88,100  | 1,370.00 | 120,697,000   |                              |
| 9508 | 九州電力        | 201,700 | 1,352.00 | 272,698,400   | 貸付有価証券<br>121,600株(121,600株) |
| 9509 | 北海道電力       | 91,600  | 762.00   | 69,799,200    |                              |
| 9511 | 沖縄電力        | 18,100  | 2,065.00 | 37,376,500    | 貸付有価証券<br>13,700株(13,700株)   |
| 9513 | 電源開発        | 77,900  | 2,778.00 | 216,406,200   |                              |
| 9514 | エフオン        | 5,900   | 842.00   | 4,967,800     |                              |
| 9517 | イーレックス      | 17,000  | 628.00   | 10,676,000    | 貸付有価証券<br>7,500株(7,500株)     |
| 9519 | レノバ         | 10,200  | 1,092.00 | 11,138,400    | 貸付有価証券<br>3,800株(3,800株)     |
| 9531 | 東京瓦斯        | 192,000 | 2,818.50 | 541,152,000   |                              |
| 9532 | 大阪瓦斯        | 189,900 | 2,129.00 | 404,297,100   | 貸付有価証券<br>9,400株(9,400株)     |
| 9533 | 東邦瓦斯        | 48,500  | 4,765.00 | 231,102,500   | 貸付有価証券<br>28,000株(28,000株)   |
| 9534 | 北海道瓦斯       | 5,300   | 1,482.00 | 7,854,600     |                              |
| 9535 | 広島ガス        | 20,100  | 342.00   | 6,874,200     |                              |
| 9536 | 西部瓦斯        | 11,000  | 2,518.00 | 27,698,000    |                              |
| 9543 | 静岡ガス        | 30,100  | 919.00   | 27,661,900    |                              |
| 9551 | メタウォーター     | 4,700   | 2,944.00 | 13,836,800    |                              |
| 2384 | SBSホールディングス | 9,700   | 1,557.00 | 15,102,900    | 貸付有価証券<br>4,500株(4,500株)     |
| 9001 | 東武鉄道        | 103,200 | 3,000.00 | 309,600,000   | 貸付有価証券<br>11,700株(11,700株)   |
| 9003 | 相鉄ホールディングス  | 33,500  | 3,220.00 | 107,870,000   |                              |
| 9005 | 東京急行電鉄      | 265,800 | 1,804.00 | 479,503,200   | 貸付有価証券<br>31,400株(31,400株)   |
| 9006 | 京浜急行電鉄      | 134,100 | 1,788.00 | 239,770,800   | 貸付有価証券<br>70,500株(70,500株)   |
| 9007 | 小田急電鉄       | 156,800 | 2,410.00 | 377,888,000   | 貸付有価証券<br>88,000株(88,000株)   |
| 9008 | 京王電鉄        | 54,700  | 6,140.00 | 335,858,000   | 貸付有価証券<br>30,700株(30,700株)   |
| 9009 | 京成電鉄        | 73,300  | 3,385.00 | 248,120,500   |                              |
| 9010 | 富士急行        | 13,300  | 3,265.00 | 43,424,500    | 貸付有価証券<br>10,500株(10,500株)   |
| 9014 | 新京成電鉄       | 2,500   | 2,117.00 | 5,292,500     |                              |
| 9020 | 東日本旅客鉄道     | 174,000 | 9,860.00 | 1,715,640,000 |                              |
| 9021 | 西日本旅客鉄道     | 87,700  | 7,789.00 | 683,095,300   |                              |

|      |                  |         |           |               |                              |
|------|------------------|---------|-----------|---------------|------------------------------|
| 9022 | 東海旅客鉄道           | 87,600  | 22,990.00 | 2,013,924,000 |                              |
| 9024 | 西武ホールディングス       | 124,700 | 1,863.00  | 232,316,100   |                              |
| 9025 | 鴻池運輸             | 15,600  | 1,622.00  | 25,303,200    |                              |
| 9031 | 西日本鉄道            | 27,100  | 2,737.00  | 74,172,700    | 貸付有価証券<br>20,400株(20,400株)   |
| 9037 | ハマキョウレックス        | 7,500   | 3,560.00  | 26,700,000    |                              |
| 9039 | サカイ引越センター        | 5,100   | 5,740.00  | 29,274,000    | 貸付有価証券<br>2,900株(2,900株)     |
| 9041 | 近鉄グループホールディングス   | 92,700  | 4,705.00  | 436,153,500   | 貸付有価証券<br>54,000株(54,000株)   |
| 9042 | 阪急阪神ホールディングス     | 123,600 | 3,770.00  | 465,972,000   |                              |
| 9044 | 南海電気鉄道           | 41,300  | 2,879.00  | 118,902,700   |                              |
| 9045 | 京阪ホールディングス       | 41,300  | 4,380.00  | 180,894,000   | 貸付有価証券<br>23,200株(23,200株)   |
| 9046 | 神戸電鉄             | 2,400   | 3,920.00  | 9,408,000     |                              |
| 9048 | 名古屋鉄道            | 74,200  | 2,809.00  | 208,427,800   | 貸付有価証券<br>38,400株(38,400株)   |
| 9052 | 山陽電気鉄道           | 7,100   | 2,080.00  | 14,768,000    |                              |
| 9062 | 日本通運             | 36,400  | 6,490.00  | 236,236,000   |                              |
| 9064 | ヤマトホールディングス      | 162,500 | 2,914.50  | 473,606,250   | 貸付有価証券<br>102,500株(102,500株) |
| 9065 | 山九               | 25,800  | 5,200.00  | 134,160,000   |                              |
| 9067 | 丸運               | 5,300   | 301.00    | 1,595,300     |                              |
| 9068 | 丸全昭和運輸           | 7,500   | 2,641.00  | 19,807,500    |                              |
| 9069 | センコーグループホールディングス | 51,100  | 850.00    | 43,435,000    | 貸付有価証券<br>35,000株(35,000株)   |
| 9070 | トナミホールディングス      | 2,200   | 5,690.00  | 12,518,000    | 貸付有価証券<br>500株(500株)         |
| 9072 | ニッコンホールディングス     | 35,200  | 2,706.00  | 95,251,200    | 貸付有価証券<br>2,200株(2,200株)     |
| 9074 | 日本石油輸送           | 1,100   | 2,927.00  | 3,219,700     |                              |
| 9075 | 福山通運             | 11,900  | 4,335.00  | 51,586,500    |                              |
| 9076 | セイノーホールディングス     | 69,400  | 1,507.00  | 104,585,800   |                              |
| 9078 | エスライン            | 2,800   | 1,038.00  | 2,906,400     | 貸付有価証券<br>500株(500株)         |
| 9081 | 神奈川中央交通          | 2,300   | 3,720.00  | 8,556,000     |                              |
| 9086 | 日立物流             | 20,400  | 3,045.00  | 62,118,000    |                              |
| 9090 | 丸和運輸機関           | 4,900   | 3,520.00  | 17,248,000    | 貸付有価証券<br>600株(600株)         |
| 9099 | C & F ロジホールディングス | 9,400   | 1,155.00  | 10,857,000    | 貸付有価証券<br>3,500株(3,500株)     |
| 9142 | 九州旅客鉄道           | 77,800  | 3,685.00  | 286,693,000   |                              |
| 9143 | S Gホールディングス      | 87,600  | 2,874.00  | 251,762,400   |                              |
| 9101 | 日本郵船             | 77,500  | 1,818.00  | 140,895,000   | 貸付有価証券<br>46,500株(46,500株)   |
| 9104 | 商船三井             | 55,000  | 2,615.00  | 143,825,000   | 貸付有価証券<br>30,900株(30,900株)   |

|      |               |         |          |             |                            |
|------|---------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 9107 | 川崎汽船          | 28,500  | 1,457.00 | 41,524,500  | 貸付有価証券<br>25,700株(25,700株) |
| 9110 | NSユニテッド海運     | 5,100   | 2,900.00 | 14,790,000  | 貸付有価証券<br>3,500株(3,500株)   |
| 9115 | 明治海運          | 9,800   | 348.00   | 3,410,400   |                            |
| 9119 | 飯野海運          | 43,900  | 396.00   | 17,384,400  | 貸付有価証券<br>11,100株(11,100株) |
| 9130 | 共栄タンカー        | 800     | 1,524.00 | 1,219,200   |                            |
| 9308 | 乾汽船           | 8,300   | 722.00   | 5,992,600   |                            |
| 9201 | 日本航空          | 169,700 | 3,926.00 | 666,242,200 |                            |
| 9202 | ANAホールディングス   | 169,400 | 3,926.00 | 665,064,400 |                            |
| 9232 | パスコ           | 1,800   | 884.00   | 1,591,200   |                            |
| 9058 | トランコム         | 2,600   | 5,920.00 | 15,392,000  |                            |
| 9066 | 日新            | 8,000   | 1,790.00 | 14,320,000  |                            |
| 9301 | 三菱倉庫          | 32,100  | 2,736.00 | 87,825,600  | 貸付有価証券<br>18,000株(18,000株) |
| 9302 | 三井倉庫ホールディングス  | 11,300  | 1,920.00 | 21,696,000  |                            |
| 9303 | 住友倉庫          | 34,800  | 1,351.00 | 47,014,800  | 貸付有価証券<br>18,500株(18,500株) |
| 9304 | 澁澤倉庫          | 5,100   | 1,542.00 | 7,864,200   |                            |
| 9306 | 東陽倉庫          | 16,700  | 282.00   | 4,709,400   |                            |
| 9310 | 日本トランスシティ     | 20,400  | 433.00   | 8,833,200   |                            |
| 9312 | ケイヒン          | 1,800   | 1,291.00 | 2,323,800   |                            |
| 9319 | 中央倉庫          | 5,600   | 1,002.00 | 5,611,200   |                            |
| 9322 | 川西倉庫          | 1,900   | 1,174.00 | 2,230,600   | 貸付有価証券<br>100株(100株)       |
| 9324 | 安田倉庫          | 7,600   | 806.00   | 6,125,600   | 貸付有価証券<br>1,300株(1,300株)   |
| 9325 | ファイズ          | 900     | 1,061.00 | 954,900     |                            |
| 9351 | 東洋埠頭          | 2,800   | 1,450.00 | 4,060,000   |                            |
| 9358 | 宇徳            | 7,900   | 532.00   | 4,202,800   |                            |
| 9364 | 上組            | 57,200  | 2,377.00 | 135,964,400 |                            |
| 9366 | サンリツ          | 2,200   | 666.00   | 1,465,200   |                            |
| 9368 | キムラユニティー      | 2,500   | 1,101.00 | 2,752,500   |                            |
| 9369 | キューソー流通システム   | 2,300   | 2,032.00 | 4,673,600   |                            |
| 9375 | 近鉄エクスプレス      | 17,500  | 1,586.00 | 27,755,000  |                            |
| 9380 | 東海運           | 5,300   | 289.00   | 1,531,700   |                            |
| 9381 | エーアイティー       | 6,000   | 1,014.00 | 6,084,000   |                            |
| 9384 | 内外トランスライン     | 2,900   | 1,374.00 | 3,984,600   |                            |
| 9386 | 日本コンセプト       | 2,500   | 988.00   | 2,470,000   |                            |
| 1973 | NECネットエスアイ    | 10,600  | 2,286.00 | 24,231,600  |                            |
| 2307 | クロスキャット       | 1,400   | 1,050.00 | 1,470,000   |                            |
| 2317 | システナ          | 34,300  | 1,202.00 | 41,228,600  |                            |
| 2326 | デジタルアーツ       | 5,200   | 6,310.00 | 32,812,000  |                            |
| 2327 | 新日鉄住金ソリューションズ | 14,400  | 2,816.00 | 40,550,400  |                            |



|      |                     |         |          |             |                            |
|------|---------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 2335 | キューブシステム            | 5,100   | 650.00   | 3,315,000   |                            |
| 2352 | エイジア                | 1,900   | 1,121.00 | 2,129,900   |                            |
| 2359 | コア                  | 4,100   | 1,185.00 | 4,858,500   |                            |
| 3040 | ソリトンシステムズ           | 5,400   | 798.00   | 4,309,200   | 貸付有価証券<br>2,000株(2,000株)   |
| 3371 | ソフトクリエイトホールディングス    | 4,200   | 1,319.00 | 5,539,800   |                            |
| 3626 | T I S               | 32,000  | 4,710.00 | 150,720,000 |                            |
| 3627 | ネオス                 | 3,500   | 1,069.00 | 3,741,500   | 貸付有価証券<br>2,200株(2,200株)   |
| 3630 | 電算システム              | 3,700   | 2,324.00 | 8,598,800   | 貸付有価証券<br>2,600株(2,600株)   |
| 3632 | グリー                 | 51,500  | 492.00   | 25,338,000  |                            |
| 3635 | コーエーテックモホールディングス    | 19,600  | 1,851.00 | 36,279,600  |                            |
| 3636 | 三菱総合研究所             | 3,700   | 3,210.00 | 11,877,000  |                            |
| 3639 | ボルテージ               | 1,900   | 593.00   | 1,126,700   |                            |
| 3640 | 電算                  | 1,100   | 2,153.00 | 2,368,300   |                            |
| 3648 | A G S               | 5,400   | 662.00   | 3,574,800   |                            |
| 3649 | ファインデックス            | 8,100   | 581.00   | 4,706,100   | 貸付有価証券<br>3,200株(3,200株)   |
| 3654 | ヒト・コミュニケーションズ       | 2,200   | 1,480.00 | 3,256,000   | 貸付有価証券<br>800株(800株)       |
| 3655 | ブレインパッド             | 2,100   | 5,850.00 | 12,285,000  |                            |
| 3656 | K L a b             | 17,100  | 960.00   | 16,416,000  | 貸付有価証券<br>7,500株(7,500株)   |
| 3657 | ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ | 12,700  | 872.00   | 11,074,400  |                            |
| 3658 | イーブックイニシアティブジャパン    | 1,500   | 1,654.00 | 2,481,000   |                            |
| 3659 | ネクソン                | 244,500 | 1,656.00 | 404,892,000 | 貸付有価証券<br>87,400株(87,400株) |
| 3660 | アイスタイル              | 24,600  | 830.00   | 20,418,000  | 貸付有価証券<br>4,400株(4,400株)   |
| 3661 | エムアップ               | 3,300   | 1,766.00 | 5,827,800   |                            |
| 3662 | エイチーム               | 6,000   | 1,751.00 | 10,506,000  | 貸付有価証券<br>1,400株(1,400株)   |
| 3666 | テクノスジャパン            | 8,100   | 787.00   | 6,374,700   | 貸付有価証券<br>2,000株(2,000株)   |
| 3667 | e n i s h           | 3,300   | 507.00   | 1,673,100   | 貸付有価証券<br>2,900株(2,900株)   |
| 3668 | コロプラ                | 27,400  | 790.00   | 21,646,000  | 貸付有価証券<br>10,400株(10,400株) |
| 3672 | オルトプラス              | 5,900   | 341.00   | 2,011,900   | 貸付有価証券<br>4,700株(4,700株)   |
| 3673 | ブロードリーフ             | 47,600  | 543.00   | 25,846,800  |                            |
| 3675 | クロス・マーケティンググループ     | 2,700   | 350.00   | 945,000     |                            |
| 3676 | デジタルハーツホールディングス     | 4,400   | 1,440.00 | 6,336,000   |                            |
| 3678 | メディアドゥホールディングス      | 3,000   | 2,200.00 | 6,600,000   |                            |
| 3679 | じげん                 | 10,200  | 558.00   | 5,691,600   | 貸付有価証券<br>3,800株(3,800株)   |

|      |                      |         |          |            |                              |
|------|----------------------|---------|----------|------------|------------------------------|
| 3681 | バイキューブ               | 5,100   | 369.00   | 1,881,900  | 貸付有価証券<br>2,400株(2,400株)     |
| 3683 | サイバーリンクス             | 1,500   | 919.00   | 1,378,500  |                              |
| 3686 | ディー・エル・イー            | 6,200   | 160.00   | 992,000    |                              |
| 3687 | フィックスターズ             | 9,200   | 1,403.00 | 12,907,600 | 貸付有価証券<br>5,000株(5,000株)     |
| 3688 | CARTA HOLDINGS       | 5,100   | 1,062.00 | 5,416,200  |                              |
| 3694 | オブティム                | 2,100   | 4,595.00 | 9,649,500  | 貸付有価証券<br>1,200株(1,200株)     |
| 3696 | セレス                  | 3,100   | 1,552.00 | 4,811,200  | 貸付有価証券<br>1,900株(1,900株)     |
| 3724 | ベリサーブ                | 1,000   | 4,800.00 | 4,800,000  |                              |
| 3738 | ティーガイア               | 9,600   | 2,071.00 | 19,881,600 |                              |
| 3741 | セック                  | 1,600   | 3,545.00 | 5,672,000  |                              |
| 3751 | 日本アジアグループ            | 10,100  | 346.00   | 3,494,600  | 貸付有価証券<br>3,800株(3,800株)     |
| 3756 | 豆蔵ホールディングス           | 6,500   | 1,025.00 | 6,662,500  |                              |
| 3762 | テクマトリックス             | 6,800   | 1,812.00 | 12,321,600 |                              |
| 3763 | プロシップ                | 1,400   | 2,718.00 | 3,805,200  |                              |
| 3765 | ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 231,400 | 247.00   | 57,155,800 | 貸付有価証券<br>191,500株(191,500株) |
| 3769 | GMOペイメントゲートウェイ       | 15,800  | 5,360.00 | 84,688,000 | 貸付有価証券<br>13,600株(13,600株)   |
| 3770 | ザッパラス                | 4,600   | 370.00   | 1,702,000  |                              |
| 3771 | システムリサーチ             | 1,300   | 2,647.00 | 3,441,100  | 貸付有価証券<br>100株(100株)         |
| 3774 | インターネットイニシアティブ       | 15,600  | 2,510.00 | 39,156,000 | 貸付有価証券<br>10,000株(10,000株)   |
| 3778 | さくらインターネット           | 11,400  | 478.00   | 5,449,200  |                              |
| 3784 | ヴィンクス                | 3,200   | 1,302.00 | 4,166,400  | 貸付有価証券<br>1,200株(1,200株)     |
| 3788 | GMOクラウド              | 2,100   | 3,100.00 | 6,510,000  |                              |
| 3817 | SRAホールディングス          | 5,100   | 2,481.00 | 12,653,100 |                              |
| 3822 | Minorityソリューションズ     | 1,900   | 1,620.00 | 3,078,000  |                              |
| 3826 | システムインテグレータ          | 2,700   | 727.00   | 1,962,900  | 貸付有価証券<br>1,800株(1,800株)     |
| 3834 | 朝日ネット                | 7,800   | 509.00   | 3,970,200  |                              |
| 3835 | eBASE                | 2,900   | 1,733.00 | 5,025,700  |                              |
| 3836 | アバント                 | 2,600   | 1,201.00 | 3,122,600  |                              |
| 3837 | アドソル日進               | 3,400   | 1,504.00 | 5,113,600  |                              |
| 3843 | フリービット               | 6,400   | 823.00   | 5,267,200  |                              |
| 3844 | コムチュア                | 5,400   | 2,943.00 | 15,892,200 |                              |
| 3852 | サイバーコム               | 1,700   | 2,078.00 | 3,532,600  |                              |
| 3853 | アステリア                | 4,800   | 842.00   | 4,041,600  | 貸付有価証券<br>1,800株(1,800株)     |
| 3901 | マークライنز              | 3,300   | 1,268.00 | 4,184,400  |                              |

|      |                             |        |          |             |                            |
|------|-----------------------------|--------|----------|-------------|----------------------------|
| 3902 | メディカル・データ・ビジョン              | 8,500  | 990.00   | 8,415,000   | 貸付有価証券<br>4,800株(4,800株)   |
| 3903 | g u m i                     | 11,000 | 662.00   | 7,282,000   | 貸付有価証券<br>4,900株(4,900株)   |
| 3909 | ショーケース・ティービー                | 2,100  | 678.00   | 1,423,800   | 貸付有価証券<br>1,100株(1,100株)   |
| 3912 | モバイルファクトリー                  | 2,700  | 1,516.00 | 4,093,200   |                            |
| 3915 | テラスカイ                       | 600    | 3,685.00 | 2,211,000   |                            |
| 3916 | デジタル・インフォメーション・テクノロジー       | 4,200  | 1,301.00 | 5,464,200   |                            |
| 3918 | P C Iホールディングス               | 1,700  | 2,323.00 | 3,949,100   | 貸付有価証券<br>900株(900株)       |
| 3919 | パイブドHD                      | 1,500  | 919.00   | 1,378,500   | 貸付有価証券<br>500株(500株)       |
| 3920 | アイピーシー                      | 1,600  | 1,017.00 | 1,627,200   |                            |
| 3921 | ネオジャパン                      | 1,800  | 828.00   | 1,490,400   | 貸付有価証券<br>500株(500株)       |
| 3922 | P R T I M E S               | 600    | 2,359.00 | 1,415,400   | 貸付有価証券<br>200株(200株)       |
| 3924 | ランドコンピュータ                   | 1,100  | 991.00   | 1,090,100   | 貸付有価証券<br>400株(400株)       |
| 3925 | ダブルスタンダード                   | 600    | 3,690.00 | 2,214,000   |                            |
| 3926 | オーブンドア                      | 4,700  | 2,801.00 | 13,164,700  | 貸付有価証券<br>2,400株(2,400株)   |
| 3928 | マイネット                       | 3,100  | 1,897.00 | 5,880,700   |                            |
| 3932 | アカツキ                        | 3,400  | 6,090.00 | 20,706,000  |                            |
| 3934 | ベネフィットジャパン                  | 500    | 773.00   | 386,500     | 貸付有価証券<br>200株(200株)       |
| 3937 | U b i c o mホールディングス         | 1,700  | 1,214.00 | 2,063,800   | 貸付有価証券<br>600株(600株)       |
| 3938 | L I N E                     | 29,200 | 3,900.00 | 113,880,000 | 貸付有価証券<br>10,000株(10,000株) |
| 3939 | カナミックネットワーク                 | 1,500  | 1,751.00 | 2,626,500   | 貸付有価証券<br>500株(500株)       |
| 3940 | ノムラシステムコーポレーション             | 800    | 755.00   | 604,000     | 貸付有価証券<br>200株(200株)       |
| 3962 | チェンジ                        | 1,200  | 4,075.00 | 4,890,000   | 貸付有価証券<br>400株(400株)       |
| 3963 | シンクロ・フード                    | 4,100  | 614.00   | 2,517,400   | 貸付有価証券<br>1,500株(1,500株)   |
| 3964 | オークネット                      | 5,000  | 911.00   | 4,555,000   | 貸付有価証券<br>2,000株(2,000株)   |
| 3975 | A O I T Y O H o l d i n g s | 10,500 | 791.00   | 8,305,500   |                            |
| 3978 | マクロミル                       | 12,100 | 1,583.00 | 19,154,300  |                            |
| 3981 | ビーグリー                       | 1,800  | 864.00   | 1,555,200   | 貸付有価証券<br>600株(600株)       |
| 3983 | オロ                          | 900    | 4,340.00 | 3,906,000   | 貸付有価証券<br>300株(300株)       |
| 4284 | ソルクシーズ                      | 4,100  | 633.00   | 2,595,300   | 貸付有価証券<br>1,000株(1,000株)   |

|      |                       |         |          |             |                            |
|------|-----------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 4295 | フェイス                  | 3,800   | 841.00   | 3,195,800   | 貸付有価証券<br>100株(100株)       |
| 4299 | ハイマックス                | 1,100   | 1,789.00 | 1,967,900   |                            |
| 4307 | 野村総合研究所               | 61,100  | 4,525.00 | 276,477,500 |                            |
| 4312 | サイバネットシステム            | 7,900   | 584.00   | 4,613,600   |                            |
| 4320 | C E ホールディングス          | 2,500   | 693.00   | 1,732,500   |                            |
| 4323 | 日本システム技術              | 1,500   | 1,448.00 | 2,172,000   |                            |
| 4326 | インテージホールディングス         | 12,300  | 869.00   | 10,688,700  |                            |
| 4333 | 東邦システムサイエンス           | 2,800   | 906.00   | 2,536,800   |                            |
| 4344 | ソースネクスト               | 37,200  | 551.00   | 20,497,200  | 貸付有価証券<br>15,600株(15,600株) |
| 4348 | インフォコム                | 3,900   | 3,900.00 | 15,210,000  |                            |
| 4392 | F I G                 | 8,500   | 334.00   | 2,839,000   |                            |
| 4662 | フォーカスシステムズ            | 6,400   | 981.00   | 6,278,400   |                            |
| 4674 | クレスコ                  | 2,900   | 3,030.00 | 8,787,000   | 貸付有価証券<br>1,700株(1,700株)   |
| 4676 | フジ・メディア・ホールディングス      | 99,600  | 1,590.00 | 158,364,000 |                            |
| 4684 | オービック                 | 33,300  | 8,950.00 | 298,035,000 | 貸付有価証券<br>2,400株(2,400株)   |
| 4686 | ジャストシステム              | 13,700  | 2,219.00 | 30,400,300  |                            |
| 4687 | T D C ソフト             | 8,400   | 790.00   | 6,636,000   | 貸付有価証券<br>2,100株(2,100株)   |
| 4689 | ヤフー                   | 626,100 | 293.00   | 183,447,300 |                            |
| 4704 | トレンドマイクロ              | 51,200  | 6,420.00 | 328,704,000 |                            |
| 4709 | インフォメーション・ディベロプメント    | 2,700   | 1,365.00 | 3,685,500   |                            |
| 4716 | 日本オラクル                | 15,600  | 7,650.00 | 119,340,000 | 貸付有価証券<br>10,900株(10,900株) |
| 4719 | アルファシステムズ             | 3,000   | 2,512.00 | 7,536,000   |                            |
| 4722 | フューチャー                | 13,000  | 1,477.00 | 19,201,000  |                            |
| 4725 | C A C H o l d i n g s | 7,200   | 932.00   | 6,710,400   |                            |
| 4726 | ソフトバンク・テクノロジー         | 4,100   | 1,880.00 | 7,708,000   |                            |
| 4728 | トーセ                   | 2,600   | 830.00   | 2,158,000   | 貸付有価証券<br>1,300株(1,300株)   |
| 4733 | オービックビジネスコンサルタント      | 9,800   | 3,995.00 | 39,151,000  |                            |
| 4739 | 伊藤忠テクノソリューションズ        | 43,800  | 2,220.00 | 97,236,000  |                            |
| 4743 | アイティフォー               | 11,600  | 740.00   | 8,584,000   |                            |
| 4746 | 東計電算                  | 1,400   | 2,938.00 | 4,113,200   |                            |
| 4762 | エクスネット                | 1,800   | 829.00   | 1,492,200   |                            |
| 4768 | 大塚商会                  | 52,000  | 3,380.00 | 175,760,000 |                            |
| 4776 | サイボウズ                 | 11,200  | 649.00   | 7,268,800   |                            |
| 4779 | ソフトブレーン               | 7,500   | 436.00   | 3,270,000   |                            |
| 4812 | 電通国際情報サービス            | 5,900   | 2,908.00 | 17,157,200  |                            |
| 4819 | デジタルガレージ              | 18,700  | 2,555.00 | 47,778,500  | 貸付有価証券<br>5,200株(5,200株)   |
| 4820 | E M システムズ             | 7,800   | 1,114.00 | 8,689,200   |                            |

|      |                          |         |           |               |                            |
|------|--------------------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
| 4825 | ウェザーニューズ                 | 3,200   | 2,958.00  | 9,465,600     |                            |
| 4826 | C I J                    | 7,500   | 777.00    | 5,827,500     |                            |
| 4828 | 東洋ビジネスエンジニアリング           | 1,000   | 1,871.00  | 1,871,000     |                            |
| 4829 | 日本エンタープライズ               | 9,900   | 180.00    | 1,782,000     | 貸付有価証券<br>2,400株(2,400株)   |
| 4839 | WOWOW                    | 4,600   | 2,896.00  | 13,321,600    |                            |
| 4845 | スカラ                      | 7,700   | 715.00    | 5,505,500     |                            |
| 6879 | IMAGICA GROUP            | 8,100   | 513.00    | 4,155,300     | 貸付有価証券<br>3,100株(3,100株)   |
| 7518 | ネットワンシステムズ               | 34,000  | 2,149.00  | 73,066,000    | 貸付有価証券<br>25,700株(25,700株) |
| 7527 | システムソフト                  | 22,700  | 101.00    | 2,292,700     |                            |
| 7595 | アルゴグラフィックス               | 4,100   | 3,815.00  | 15,641,500    |                            |
| 7844 | マーベラス                    | 14,700  | 885.00    | 13,009,500    | 貸付有価証券<br>12,500株(12,500株) |
| 7860 | エイベックス                   | 16,500  | 1,448.00  | 23,892,000    |                            |
| 8056 | 日本ユニシス                   | 30,000  | 2,517.00  | 75,510,000    |                            |
| 8096 | 兼松エレクトロニクス               | 5,200   | 3,120.00  | 16,224,000    |                            |
| 9401 | 東京放送ホールディングス             | 63,700  | 1,874.00  | 119,373,800   |                            |
| 9404 | 日本テレビホールディングス            | 88,200  | 1,669.00  | 147,205,800   |                            |
| 9405 | 朝日放送グループホールディングス         | 9,500   | 710.00    | 6,745,000     |                            |
| 9409 | テレビ朝日ホールディングス            | 26,400  | 1,951.00  | 51,506,400    |                            |
| 9412 | スカパーJ S A Tホールディングス      | 73,300  | 479.00    | 35,110,700    |                            |
| 9413 | テレビ東京ホールディングス            | 7,900   | 2,266.00  | 17,901,400    |                            |
| 9414 | 日本BS放送                   | 3,200   | 1,064.00  | 3,404,800     |                            |
| 9416 | ビジョン                     | 3,000   | 4,120.00  | 12,360,000    |                            |
| 9417 | スマートバリュー                 | 1,200   | 796.00    | 955,200       |                            |
| 9418 | USEN-NEXT HOLDING<br>S   | 3,600   | 973.00    | 3,502,800     |                            |
| 9419 | ワイヤレスゲート                 | 4,200   | 485.00    | 2,037,000     |                            |
| 9422 | コネクシオ                    | 6,800   | 1,326.00  | 9,016,800     |                            |
| 9424 | 日本通信                     | 81,800  | 132.00    | 10,797,600    |                            |
| 9428 | クロップス                    | 1,700   | 637.00    | 1,082,900     |                            |
| 9432 | 日本電信電話                   | 656,800 | 4,629.00  | 3,040,327,200 |                            |
| 9433 | K D D I                  | 846,300 | 2,678.00  | 2,266,391,400 |                            |
| 9434 | ソフトバンク                   | 97,000  | 1,421.00  | 137,837,000   |                            |
| 9435 | 光通信                      | 11,300  | 17,020.00 | 192,326,000   |                            |
| 9437 | N T T ドコモ                | 689,600 | 2,572.50  | 1,773,996,000 |                            |
| 9438 | エムティーアイ                  | 11,100  | 629.00    | 6,981,900     | 貸付有価証券<br>6,200株(6,200株)   |
| 9449 | G M O インターネット            | 35,000  | 1,400.00  | 49,000,000    | 貸付有価証券<br>28,900株(28,900株) |
| 9466 | アイドママーケティングコミュニケー<br>ション | 2,100   | 515.00    | 1,081,500     |                            |
| 9468 | カドカワ                     | 28,000  | 1,146.00  | 32,088,000    | 貸付有価証券<br>22,500株(22,500株) |

|      |                      |         |           |               |                            |
|------|----------------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
| 9470 | 学研ホールディングス           | 3,200   | 4,015.00  | 12,848,000    | 貸付有価証券<br>2,600株(2,600株)   |
| 9474 | ゼンリン                 | 19,200  | 2,472.00  | 47,462,400    | 貸付有価証券<br>15,400株(15,400株) |
| 9475 | 昭文社                  | 4,400   | 481.00    | 2,116,400     |                            |
| 9479 | インプレスホールディングス        | 7,900   | 145.00    | 1,145,500     |                            |
| 9600 | アイネット                | 5,400   | 1,360.00  | 7,344,000     |                            |
| 9601 | 松竹                   | 6,400   | 10,790.00 | 69,056,000    | 貸付有価証券<br>5,100株(5,100株)   |
| 9602 | 東宝                   | 63,200  | 3,840.00  | 242,688,000   |                            |
| 9605 | 東映                   | 4,000   | 12,980.00 | 51,920,000    |                            |
| 9613 | エヌ・ティ・ティ・データ         | 255,700 | 1,277.00  | 326,528,900   |                            |
| 9629 | ピー・シー・エー             | 1,200   | 1,894.00  | 2,272,800     |                            |
| 9658 | ビジネスブレイン太田昭和         | 1,600   | 1,825.00  | 2,920,000     |                            |
| 9682 | D T S                | 10,700  | 3,785.00  | 40,499,500    |                            |
| 9684 | スクウェア・エニックス・ホールディングス | 44,700  | 3,530.00  | 157,791,000   |                            |
| 9692 | シーイーシー               | 10,300  | 1,904.00  | 19,611,200    |                            |
| 9697 | カブコン                 | 41,200  | 2,283.00  | 94,059,600    |                            |
| 9702 | アイ・エス・ピー             | 1,900   | 1,817.00  | 3,452,300     |                            |
| 9717 | ジャステック               | 5,600   | 927.00    | 5,191,200     |                            |
| 9719 | S C S K              | 25,300  | 4,325.00  | 109,422,500   |                            |
| 9739 | 日本システムウエア            | 3,200   | 1,672.00  | 5,350,400     |                            |
| 9742 | アイネス                 | 12,200  | 1,162.00  | 14,176,400    |                            |
| 9746 | T K C                | 8,100   | 3,795.00  | 30,739,500    |                            |
| 9749 | 富士ソフト                | 14,300  | 4,330.00  | 61,919,000    | 貸付有価証券<br>7,900株(7,900株)   |
| 9759 | N S D                | 15,800  | 2,198.00  | 34,728,400    |                            |
| 9766 | コナミホールディングス          | 39,200  | 5,020.00  | 196,784,000   |                            |
| 9790 | 福井コンピュータホールディングス     | 3,100   | 1,573.00  | 4,876,300     |                            |
| 9889 | J B C Cホールディングス      | 7,600   | 1,540.00  | 11,704,000    |                            |
| 9928 | ミロク情報サービス            | 9,500   | 2,436.00  | 23,142,000    | 貸付有価証券<br>5,000株(5,000株)   |
| 9984 | ソフトバンクグループ           | 401,300 | 8,076.00  | 3,240,898,800 |                            |
| 1352 | ハウスイ                 | 800     | 881.00    | 704,800       |                            |
| 2676 | 高千穂交易                | 3,700   | 965.00    | 3,570,500     |                            |
| 2692 | 伊藤忠食品                | 2,400   | 4,745.00  | 11,388,000    |                            |
| 2715 | エレマテック               | 4,500   | 1,869.00  | 8,410,500     |                            |
| 2729 | J A L U X            | 2,700   | 2,463.00  | 6,650,100     |                            |
| 2733 | あらた                  | 5,300   | 4,185.00  | 22,180,500    | 貸付有価証券<br>3,500株(3,500株)   |
| 2737 | トーメンデバイス             | 1,400   | 2,339.00  | 3,274,600     |                            |
| 2760 | 東京エレクトロン デバイス        | 3,500   | 1,795.00  | 6,282,500     |                            |
| 2767 | フィールズ                | 8,400   | 752.00    | 6,316,800     | 貸付有価証券<br>3,200株(3,200株)   |

|      |                     |         |          |             |                            |
|------|---------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 2768 | 双日                  | 532,400 | 413.00   | 219,881,200 |                            |
| 2784 | アルフレッサ ホールディングス     | 107,100 | 2,973.00 | 318,408,300 |                            |
| 2874 | 横浜冷凍                | 25,200  | 923.00   | 23,259,600  | 貸付有価証券<br>19,300株(19,300株) |
| 3004 | 神栄                  | 1,300   | 892.00   | 1,159,600   | 貸付有価証券<br>1,000株(1,000株)   |
| 3023 | ラサ商事                | 5,100   | 834.00   | 4,253,400   |                            |
| 3031 | ラクーンホールディングス        | 5,700   | 658.00   | 3,750,600   |                            |
| 3036 | アルコニックス             | 10,200  | 1,134.00 | 11,566,800  |                            |
| 3038 | 神戸物産                | 14,500  | 3,385.00 | 49,082,500  |                            |
| 3076 | あい ホールディングス         | 15,500  | 1,966.00 | 30,473,000  | 貸付有価証券<br>9,700株(9,700株)   |
| 3079 | ディーブイエックス           | 3,800   | 1,125.00 | 4,275,000   |                            |
| 3107 | ダイワボウホールディングス       | 8,800   | 5,620.00 | 49,456,000  |                            |
| 3132 | マクニカ・富士エレホールディングス   | 26,700  | 1,455.00 | 38,848,500  | 貸付有価証券<br>14,000株(14,000株) |
| 3139 | ラクト・ジャパン            | 2,100   | 7,480.00 | 15,708,000  | 貸付有価証券<br>800株(800株)       |
| 3151 | バイタルケーエスケー・ホールディングス | 18,100  | 1,120.00 | 20,272,000  | 貸付有価証券<br>13,500株(13,500株) |
| 3153 | 八洲電機                | 7,400   | 814.00   | 6,023,600   |                            |
| 3154 | メディアスホールディングス       | 5,300   | 695.00   | 3,683,500   |                            |
| 3156 | U K C ホールディングス      | 6,200   | 1,984.00 | 12,300,800  | 貸付有価証券<br>5,000株(5,000株)   |
| 3157 | ジューテックホールディングス      | 2,200   | 994.00   | 2,186,800   | 貸付有価証券<br>700株(700株)       |
| 3160 | 大光                  | 2,400   | 536.00   | 1,286,400   | 貸付有価証券<br>200株(200株)       |
| 3166 | O C H I ホールディングス    | 2,800   | 1,123.00 | 3,144,400   |                            |
| 3167 | T O K A I ホールディングス  | 50,900  | 864.00   | 43,977,600  |                            |
| 3168 | 黒谷                  | 1,600   | 481.00   | 769,600     |                            |
| 3173 | C o m i n i x       | 1,700   | 817.00   | 1,388,900   |                            |
| 3176 | 三洋貿易                | 4,800   | 1,809.00 | 8,683,200   |                            |
| 3180 | ビューティガレージ           | 1,400   | 1,525.00 | 2,135,000   | 貸付有価証券<br>500株(500株)       |
| 3183 | ウイン・パートナーズ          | 6,300   | 1,010.00 | 6,363,000   |                            |
| 3321 | ミタチ産業               | 2,400   | 722.00   | 1,732,800   | 貸付有価証券<br>1,800株(1,800株)   |
| 3360 | シップヘルスケアホールディングス    | 20,100  | 4,070.00 | 81,807,000  |                            |
| 3388 | 明治電機工業              | 3,000   | 1,708.00 | 5,124,000   |                            |
| 3392 | デリカフーズホールディングス      | 1,700   | 1,350.00 | 2,295,000   |                            |
| 3393 | スターティアホールディングス      | 1,900   | 602.00   | 1,143,800   |                            |
| 3543 | コメダホールディングス         | 22,300  | 2,063.00 | 46,004,900  |                            |
| 5009 | 富士興産                | 3,700   | 625.00   | 2,312,500   |                            |
| 6973 | 協栄産業                | 1,200   | 1,495.00 | 1,794,000   | 貸付有価証券<br>1,000株(1,000株)   |
| 7414 | 小野建                 | 8,500   | 1,660.00 | 14,110,000  |                            |

|      |               |         |          |             |                            |
|------|---------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 7417 | 南陽            | 1,500   | 2,327.00 | 3,490,500   |                            |
| 7420 | 佐鳥電機          | 7,100   | 888.00   | 6,304,800   |                            |
| 7427 | エコートレーディング    | 2,200   | 594.00   | 1,306,800   |                            |
| 7433 | 伯東            | 6,600   | 1,166.00 | 7,695,600   |                            |
| 7438 | コンドーテック       | 7,500   | 935.00   | 7,012,500   |                            |
| 7442 | 中山福           | 5,500   | 528.00   | 2,904,000   |                            |
| 7447 | ナガイレーベン       | 13,900  | 2,277.00 | 31,650,300  | 貸付有価証券<br>11,200株(11,200株) |
| 7451 | 三菱食品          | 10,600  | 2,897.00 | 30,708,200  | 貸付有価証券<br>8,500株(8,500株)   |
| 7456 | 松田産業          | 7,000   | 1,429.00 | 10,003,000  |                            |
| 7458 | 第一興商          | 14,300  | 5,190.00 | 74,217,000  |                            |
| 7459 | メディパルホールディングス | 104,000 | 2,411.00 | 250,744,000 |                            |
| 7466 | S P K         | 2,100   | 2,356.00 | 4,947,600   |                            |
| 7467 | 萩原電気ホールディングス  | 3,600   | 2,855.00 | 10,278,000  | 貸付有価証券<br>800株(800株)       |
| 7476 | アズワン          | 6,900   | 7,480.00 | 51,612,000  |                            |
| 7480 | スズデン          | 3,300   | 1,518.00 | 5,009,400   |                            |
| 7481 | 尾家産業          | 3,100   | 1,202.00 | 3,726,200   |                            |
| 7482 | シモジマ          | 5,900   | 1,066.00 | 6,289,400   |                            |
| 7483 | ドウシシャ         | 9,100   | 1,710.00 | 15,561,000  |                            |
| 7487 | 小津産業          | 2,100   | 1,863.00 | 3,912,300   |                            |
| 7504 | 高速            | 5,700   | 1,042.00 | 5,939,400   | 貸付有価証券<br>1,800株(1,800株)   |
| 7510 | たけびし          | 3,400   | 1,383.00 | 4,702,200   |                            |
| 7525 | リックス          | 2,200   | 1,479.00 | 3,253,800   |                            |
| 7537 | 丸文            | 8,500   | 721.00   | 6,128,500   |                            |
| 7552 | ハピネット         | 8,000   | 1,584.00 | 12,672,000  |                            |
| 7570 | 橋本総業ホールディングス  | 1,800   | 1,406.00 | 2,530,800   |                            |
| 7575 | 日本ライフライン      | 30,200  | 1,606.00 | 48,501,200  | 貸付有価証券<br>5,000株(5,000株)   |
| 7590 | タカショー         | 4,700   | 427.00   | 2,006,900   |                            |
| 7591 | エクセル          | 3,600   | 1,931.00 | 6,951,600   | 貸付有価証券<br>1,700株(1,700株)   |
| 7594 | マルカキカイ        | 3,100   | 2,060.00 | 6,386,000   |                            |
| 7599 | I D O M       | 32,500  | 402.00   | 13,065,000  | 貸付有価証券<br>21,000株(21,000株) |
| 7600 | 日本エム・ディ・エム    | 5,600   | 1,020.00 | 5,712,000   |                            |
| 7607 | 進和            | 5,700   | 2,137.00 | 12,180,900  |                            |
| 7608 | エスケイジャパン      | 2,300   | 710.00   | 1,633,000   | 貸付有価証券<br>1,800株(1,800株)   |
| 7609 | ダイトロン         | 4,400   | 1,357.00 | 5,970,800   |                            |
| 7613 | シークス          | 12,300  | 1,511.00 | 18,585,300  | 貸付有価証券<br>2,000株(2,000株)   |
| 7619 | 田中商事          | 3,200   | 546.00   | 1,747,200   |                            |
| 7628 | オーハシテクニカ      | 5,400   | 1,236.00 | 6,674,400   |                            |



|      |                 |         |          |               |                            |
|------|-----------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| 7637 | 白銅              | 3,100   | 1,630.00 | 5,053,000     | 貸付有価証券<br>1,400株(1,400株)   |
| 8001 | 伊藤忠商事           | 674,200 | 1,980.00 | 1,334,916,000 |                            |
| 8002 | 丸紅              | 950,500 | 819.40   | 778,839,700   |                            |
| 8007 | 高島              | 1,500   | 1,811.00 | 2,716,500     |                            |
| 8012 | 長瀬産業            | 54,200  | 1,577.00 | 85,473,400    | 貸付有価証券<br>30,800株(30,800株) |
| 8014 | 蝶理              | 6,200   | 1,651.00 | 10,236,200    |                            |
| 8015 | 豊田通商            | 107,600 | 3,445.00 | 370,682,000   |                            |
| 8018 | 三共生興            | 16,400  | 404.00   | 6,625,600     |                            |
| 8020 | 兼松              | 38,500  | 1,296.00 | 49,896,000    |                            |
| 8025 | ツカモトコーポレーション    | 1,700   | 1,030.00 | 1,751,000     | 貸付有価証券<br>300株(300株)       |
| 8031 | 三井物産            | 794,100 | 1,744.00 | 1,384,910,400 |                            |
| 8032 | 日本紙パルプ商事        | 5,500   | 3,965.00 | 21,807,500    |                            |
| 8036 | 日立ハイテクノロジー      | 29,300  | 3,960.00 | 116,028,000   |                            |
| 8037 | カメイ             | 12,600  | 1,166.00 | 14,691,600    |                            |
| 8038 | 東都水産            | 1,300   | 2,329.00 | 3,027,700     |                            |
| 8041 | OUGホールディングス     | 1,500   | 2,454.00 | 3,681,000     |                            |
| 8043 | スターゼン           | 3,600   | 3,860.00 | 13,896,000    |                            |
| 8051 | 山善              | 37,600  | 1,086.00 | 40,833,600    |                            |
| 8052 | 椿本興業            | 2,200   | 3,275.00 | 7,205,000     |                            |
| 8053 | 住友商事            | 570,100 | 1,664.50 | 948,931,450   |                            |
| 8057 | 内田洋行            | 4,400   | 2,342.00 | 10,304,800    |                            |
| 8058 | 三菱商事            | 676,400 | 3,108.00 | 2,102,251,200 |                            |
| 8059 | 第一実業            | 4,400   | 3,525.00 | 15,510,000    |                            |
| 8060 | キヤノンマーケティングジャパン | 27,500  | 2,010.00 | 55,275,000    |                            |
| 8061 | 西華産業            | 5,500   | 1,484.00 | 8,162,000     |                            |
| 8065 | 佐藤商事            | 8,600   | 900.00   | 7,740,000     |                            |
| 8068 | 菱洋エレクトロ         | 9,800   | 1,540.00 | 15,092,000    |                            |
| 8070 | 東京産業            | 9,600   | 571.00   | 5,481,600     |                            |
| 8074 | ユアサ商事           | 9,900   | 3,180.00 | 31,482,000    |                            |
| 8075 | 神鋼商事            | 2,200   | 2,492.00 | 5,482,400     |                            |
| 8077 | 小林産業            | 5,700   | 273.00   | 1,556,100     |                            |
| 8078 | 阪和興業            | 16,700  | 2,987.00 | 49,882,900    | 貸付有価証券<br>10,800株(10,800株) |
| 8079 | 正栄食品工業          | 5,100   | 2,600.00 | 13,260,000    | 貸付有価証券<br>2,100株(2,100株)   |
| 8081 | カナデン            | 9,200   | 1,221.00 | 11,233,200    |                            |
| 8084 | 菱電商事            | 7,600   | 1,370.00 | 10,412,000    |                            |
| 8087 | フルサト工業          | 5,300   | 1,571.00 | 8,326,300     |                            |
| 8088 | 岩谷産業            | 21,400  | 3,725.00 | 79,715,000    |                            |
| 8089 | すてきナイスグループ      | 4,100   | 880.00   | 3,608,000     |                            |
| 8090 | 昭光通商            | 3,400   | 638.00   | 2,169,200     |                            |

|      |                             |        |          |            |                            |
|------|-----------------------------|--------|----------|------------|----------------------------|
| 8091 | ニチモウ                        | 1,500  | 1,766.00 | 2,649,000  |                            |
| 8093 | 極東貿易                        | 3,000  | 1,614.00 | 4,842,000  |                            |
| 8095 | イワキ                         | 11,500 | 415.00   | 4,772,500  |                            |
| 8097 | 三愛石油                        | 25,900 | 942.00   | 24,397,800 |                            |
| 8098 | 稲畑産業                        | 23,200 | 1,447.00 | 33,570,400 |                            |
| 8101 | G S I クレオス                  | 2,600  | 1,271.00 | 3,304,600  |                            |
| 8103 | 明和産業                        | 8,900  | 415.00   | 3,693,500  |                            |
| 8125 | ワキタ                         | 20,500 | 1,149.00 | 23,554,500 |                            |
| 8129 | 東邦ホールディングス                  | 28,500 | 2,654.00 | 75,639,000 |                            |
| 8130 | サンゲツ                        | 29,100 | 2,006.00 | 58,374,600 | 貸付有価証券<br>22,000株（22,000株） |
| 8131 | ミツウロコグループホールディングス           | 14,000 | 779.00   | 10,906,000 |                            |
| 8132 | シナネンホールディングス                | 4,000  | 2,225.00 | 8,900,000  |                            |
| 8133 | 伊藤忠エネクス                     | 21,300 | 958.00   | 20,405,400 |                            |
| 8136 | サンリオ                        | 29,800 | 2,221.00 | 66,185,800 | 貸付有価証券<br>13,700株（13,700株） |
| 8137 | サンワテクノス                     | 5,900  | 1,040.00 | 6,136,000  |                            |
| 8140 | リョーサン                       | 10,600 | 3,015.00 | 31,959,000 | 貸付有価証券<br>8,100株（8,100株）   |
| 8141 | 新光商事                        | 9,100  | 1,698.00 | 15,451,800 | 貸付有価証券<br>6,800株（6,800株）   |
| 8142 | トーヨー                        | 4,300  | 2,063.00 | 8,870,900  |                            |
| 8150 | 三信電気                        | 8,000  | 1,758.00 | 14,064,000 | 貸付有価証券<br>6,000株（6,000株）   |
| 8151 | 東陽テクニカ                      | 11,100 | 791.00   | 8,780,100  |                            |
| 8153 | モスフードサービス                   | 12,600 | 2,787.00 | 35,116,200 | 貸付有価証券<br>10,200株（10,200株） |
| 8154 | 加賀電子                        | 9,600  | 2,067.00 | 19,843,200 |                            |
| 8158 | ソーダニッカ                      | 9,900  | 522.00   | 5,167,800  |                            |
| 8159 | 立花エレテック                     | 7,100  | 1,587.00 | 11,267,700 |                            |
| 8275 | フォーバル                       | 4,200  | 810.00   | 3,402,000  |                            |
| 8283 | P A L T A C                 | 17,400 | 5,070.00 | 88,218,000 |                            |
| 8285 | 三谷産業                        | 11,300 | 279.00   | 3,152,700  |                            |
| 8835 | 太平洋興発                       | 3,800  | 746.00   | 2,834,800  | 貸付有価証券<br>3,200株（3,200株）   |
| 9260 | 西本W i s m e t t a cホールディングス | 2,200  | 4,525.00 | 9,955,000  |                            |
| 9265 | ヤマシタヘルスケアホールディングス           | 800    | 1,194.00 | 955,200    |                            |
| 9274 | 国際紙パルプ商事                    | 16,900 | 266.00   | 4,495,400  | 貸付有価証券<br>6,400株（6,400株）   |
| 9305 | ヤマタネ                        | 4,800  | 1,618.00 | 7,766,400  |                            |
| 9763 | 丸紅建材リース                     | 900    | 1,862.00 | 1,675,800  |                            |
| 9810 | 日鉄住金物産                      | 6,900  | 4,630.00 | 31,947,000 |                            |
| 9824 | 泉州電業                        | 3,200  | 2,569.00 | 8,220,800  |                            |
| 9830 | トラスコ中山                      | 20,100 | 2,859.00 | 57,465,900 | 貸付有価証券<br>12,400株（12,400株） |

|      |                |         |          |             |                            |
|------|----------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 9832 | オートバックスセブン     | 38,300  | 1,838.00 | 70,395,400  | 貸付有価証券<br>19,100株(19,100株) |
| 9837 | モリト            | 7,000   | 731.00   | 5,117,000   | 貸付有価証券<br>100株(100株)       |
| 9869 | 加藤産業           | 15,100  | 3,135.00 | 47,338,500  | 貸付有価証券<br>1,600株(1,600株)   |
| 9872 | 北恵             | 1,800   | 945.00   | 1,701,000   |                            |
| 9880 | イノテック          | 6,300   | 983.00   | 6,192,900   |                            |
| 9882 | イエローハット        | 9,100   | 2,587.00 | 23,541,700  |                            |
| 9896 | JKホールディングス     | 8,700   | 549.00   | 4,776,300   |                            |
| 9902 | 日伝             | 8,000   | 1,584.00 | 12,672,000  |                            |
| 9930 | 北沢産業           | 7,200   | 260.00   | 1,872,000   | 貸付有価証券<br>6,400株(6,400株)   |
| 9932 | 杉本商事           | 5,200   | 1,791.00 | 9,313,200   |                            |
| 9934 | 因幡電機産業         | 13,700  | 4,095.00 | 56,101,500  |                            |
| 9957 | バイテックホールディングス  | 4,400   | 1,959.00 | 8,619,600   |                            |
| 9960 | 東テク            | 3,200   | 2,220.00 | 7,104,000   |                            |
| 9962 | ミスミグループ本社      | 120,600 | 2,500.00 | 301,500,000 | 貸付有価証券<br>87,600株(87,600株) |
| 9972 | アルテック          | 7,100   | 223.00   | 1,583,300   | 貸付有価証券<br>5,600株(5,600株)   |
| 9982 | タキヒヨー          | 2,900   | 1,788.00 | 5,185,200   |                            |
| 9986 | 蔵王産業           | 1,600   | 1,295.00 | 2,072,000   |                            |
| 9987 | スズケン           | 44,000  | 5,740.00 | 252,560,000 |                            |
| 9991 | ジェコス           | 6,600   | 1,021.00 | 6,738,600   |                            |
| 9995 | ルネサスイーストン      | 8,800   | 417.00   | 3,669,600   |                            |
| 2651 | ローソン           | 24,400  | 6,660.00 | 162,504,000 |                            |
| 2659 | サンエー           | 7,300   | 4,285.00 | 31,280,500  | 貸付有価証券<br>5,200株(5,200株)   |
| 2664 | カワチ薬品          | 7,500   | 2,049.00 | 15,367,500  |                            |
| 2670 | エービーシー・マート     | 15,000  | 6,160.00 | 92,400,000  |                            |
| 2674 | ハードオフコーポレーション  | 3,800   | 821.00   | 3,119,800   |                            |
| 2678 | アスクル           | 8,400   | 2,339.00 | 19,647,600  |                            |
| 2681 | ゲオホールディングス     | 14,700  | 1,651.00 | 24,269,700  |                            |
| 2685 | アダストリア         | 13,300  | 2,017.00 | 26,826,100  |                            |
| 2686 | ジーフット          | 5,800   | 668.00   | 3,874,400   |                            |
| 2687 | シー・ヴィ・エス・ベイエリア | 1,200   | 744.00   | 892,800     |                            |
| 2695 | くらコーポレーション     | 5,700   | 5,480.00 | 31,236,000  |                            |
| 2698 | キャンドゥ          | 4,600   | 1,546.00 | 7,111,600   |                            |
| 2726 | パルグループホールディングス | 4,900   | 3,125.00 | 15,312,500  |                            |
| 2730 | エディオン          | 40,800  | 1,119.00 | 45,655,200  | 貸付有価証券<br>30,700株(30,700株) |
| 2734 | サーラコーポレーション    | 19,600  | 575.00   | 11,270,000  | 貸付有価証券<br>6,700株(6,700株)   |
| 2735 | ワッツ            | 3,200   | 714.00   | 2,284,800   | 貸付有価証券<br>1,800株(1,800株)   |

|      |                    |         |          |             |                              |
|------|--------------------|---------|----------|-------------|------------------------------|
| 2742 | ハローズ               | 3,600   | 2,095.00 | 7,542,000   |                              |
| 2753 | あみやき亭              | 2,100   | 3,575.00 | 7,507,500   |                              |
| 2764 | ひらまつ               | 19,200  | 349.00   | 6,700,800   | 貸付有価証券<br>6,800株(6,800株)     |
| 2791 | 大黒天物産              | 2,300   | 4,210.00 | 9,683,000   |                              |
| 2792 | ハニーズホールディングス       | 9,300   | 897.00   | 8,342,100   |                              |
| 2796 | ファーマライズホールディングス    | 2,200   | 583.00   | 1,282,600   |                              |
| 3028 | アルペン               | 7,400   | 1,706.00 | 12,624,400  | 貸付有価証券<br>4,100株(4,100株)     |
| 3030 | ハブ                 | 3,100   | 899.00   | 2,786,900   |                              |
| 3034 | クオールホールディングス       | 14,200  | 1,696.00 | 24,083,200  | 貸付有価証券<br>1,800株(1,800株)     |
| 3046 | ジンス                | 6,600   | 5,560.00 | 36,696,000  | 貸付有価証券<br>5,000株(5,000株)     |
| 3048 | ビックカメラ             | 51,500  | 1,291.00 | 66,486,500  |                              |
| 3050 | D C Mホールディングス      | 52,000  | 1,109.00 | 57,668,000  | 貸付有価証券<br>26,800株(26,800株)   |
| 3053 | ベッパーフードサービス        | 7,600   | 2,603.00 | 19,782,800  | 貸付有価証券<br>5,300株(5,300株)     |
| 3064 | MonotaRO           | 60,900  | 2,405.00 | 146,464,500 | 貸付有価証券<br>46,200株(46,200株)   |
| 3067 | 東京一番フーズ            | 2,400   | 583.00   | 1,399,200   |                              |
| 3073 | DDホールディングス         | 2,100   | 2,153.00 | 4,521,300   | 貸付有価証券<br>700株(700株)         |
| 3082 | きちりホールディングス        | 2,600   | 676.00   | 1,757,600   |                              |
| 3085 | アークランドサービスホールディングス | 7,000   | 1,998.00 | 13,986,000  |                              |
| 3086 | J.フロントリテイリング       | 123,300 | 1,235.00 | 152,275,500 |                              |
| 3087 | ドトール・日レスホールディングス   | 16,900  | 2,119.00 | 35,811,100  |                              |
| 3088 | マツモトキヨシホールディングス    | 39,800  | 3,355.00 | 133,529,000 | 貸付有価証券<br>13,100株(13,100株)   |
| 3091 | ブロンコビリー            | 5,000   | 2,569.00 | 12,845,000  | 貸付有価証券<br>2,800株(2,800株)     |
| 3092 | ZOZO               | 104,200 | 2,158.00 | 224,863,600 |                              |
| 3093 | トレジャー・ファクトリー       | 2,800   | 796.00   | 2,228,800   |                              |
| 3097 | 物語コーポレーション         | 2,700   | 9,210.00 | 24,867,000  | 貸付有価証券<br>1,600株(1,600株)     |
| 3098 | ココカラファイン           | 10,800  | 4,935.00 | 53,298,000  |                              |
| 3099 | 三越伊勢丹ホールディングス      | 180,300 | 1,157.00 | 208,607,100 | 貸付有価証券<br>108,000株(108,000株) |
| 3134 | Hamee              | 2,400   | 898.00   | 2,155,200   | 貸付有価証券<br>400株(400株)         |
| 3141 | ウエルシアホールディングス      | 25,500  | 3,965.00 | 101,107,500 | 貸付有価証券<br>8,400株(8,400株)     |
| 3148 | クリエイトSDホールディングス    | 14,200  | 2,667.00 | 37,871,400  |                              |
| 3159 | 丸善CHIホールディングス      | 11,200  | 326.00   | 3,651,200   |                              |
| 3169 | ミサワ                | 1,700   | 452.00   | 768,400     | 貸付有価証券<br>500株(500株)         |

|      |                      |         |           |               |                            |
|------|----------------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
| 3172 | ティーライフ               | 1,300   | 915.00    | 1,189,500     |                            |
| 3175 | エー・ピーカンパニー           | 1,800   | 468.00    | 842,400       | 貸付有価証券<br>700株(700株)       |
| 3178 | チムニー                 | 2,900   | 2,512.00  | 7,284,800     |                            |
| 3179 | シュッピン                | 6,500   | 698.00    | 4,537,000     | 貸付有価証券<br>4,400株(4,400株)   |
| 3186 | ネクステージ               | 14,800  | 1,271.00  | 18,810,800    | 貸付有価証券<br>3,600株(3,600株)   |
| 3191 | ジョイフル本田              | 28,200  | 1,407.00  | 39,677,400    | 貸付有価証券<br>13,200株(13,200株) |
| 3193 | 鳥貴族                  | 3,200   | 1,847.00  | 5,910,400     | 貸付有価証券<br>1,500株(1,500株)   |
| 3194 | キリン堂ホールディングス         | 3,800   | 1,341.00  | 5,095,800     |                            |
| 3196 | ホットランド               | 5,000   | 1,262.00  | 6,310,000     |                            |
| 3197 | すかいらーくホールディングス       | 89,800  | 1,831.00  | 164,423,800   | 貸付有価証券<br>14,900株(14,900株) |
| 3199 | 綿半ホールディングス           | 3,600   | 2,149.00  | 7,736,400     |                            |
| 3221 | ヨシックス                | 1,600   | 2,800.00  | 4,480,000     |                            |
| 3222 | ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 28,000  | 1,147.00  | 32,116,000    | 貸付有価証券<br>21,200株(21,200株) |
| 3319 | ゴルフダイジェスト・オンライン      | 3,900   | 659.00    | 2,570,100     | 貸付有価証券<br>1,000株(1,000株)   |
| 3328 | B E E N O S          | 2,200   | 1,307.00  | 2,875,400     |                            |
| 3333 | あさひ                  | 8,000   | 1,405.00  | 11,240,000    |                            |
| 3341 | 日本調剤                 | 3,400   | 3,415.00  | 11,611,000    | 貸付有価証券<br>2,000株(2,000株)   |
| 3349 | コスモス薬品               | 4,900   | 19,990.00 | 97,951,000    | 貸付有価証券<br>1,900株(1,900株)   |
| 3361 | トーエル                 | 4,700   | 720.00    | 3,384,000     |                            |
| 3366 | 一六堂                  | 2,300   | 511.00    | 1,175,300     |                            |
| 3376 | オンリー                 | 1,600   | 998.00    | 1,596,800     |                            |
| 3382 | セブン&アイ・ホールディングス      | 404,000 | 4,677.00  | 1,889,508,000 |                            |
| 3385 | 薬王堂                  | 4,200   | 2,581.00  | 10,840,200    | 貸付有価証券<br>2,100株(2,100株)   |
| 3387 | クリエイト・レストランツ・ホールディング | 25,900  | 1,205.00  | 31,209,500    | 貸付有価証券<br>12,300株(12,300株) |
| 3391 | ツルハホールディングス          | 20,900  | 9,680.00  | 202,312,000   |                            |
| 3395 | サンマルクホールディングス        | 7,600   | 2,486.00  | 18,893,600    |                            |
| 3396 | フェリシモ                | 2,100   | 1,113.00  | 2,337,300     |                            |
| 3397 | トリドールホールディングス        | 11,900  | 1,963.00  | 23,359,700    | 貸付有価証券<br>3,400株(3,400株)   |
| 3415 | T O K Y O B A S E    | 8,600   | 714.00    | 6,140,400     | 貸付有価証券<br>1,100株(1,100株)   |
| 3538 | ウイルプラスホールディングス       | 900     | 819.00    | 737,100       |                            |
| 3539 | ジャパンミート              | 3,600   | 1,715.00  | 6,174,000     |                            |
| 3544 | サツドラホールディングス         | 1,600   | 1,901.00  | 3,041,600     | 貸付有価証券<br>200株(200株)       |
| 3545 | デファクトスタンダード          | 600     | 499.00    | 299,400       |                            |

|      |                   |        |           |             |                            |
|------|-------------------|--------|-----------|-------------|----------------------------|
| 3546 | ダイユー・リックホールディングス  | 5,200  | 993.00    | 5,163,600   |                            |
| 3548 | パロックジャパンリミテッド     | 7,800  | 900.00    | 7,020,000   |                            |
| 3549 | クスリのアオキホールディングス   | 7,700  | 7,030.00  | 54,131,000  | 貸付有価証券<br>6,100株(6,100株)   |
| 3561 | 力の源ホールディングス       | 2,700  | 845.00    | 2,281,500   | 貸付有価証券<br>1,000株(1,000株)   |
| 3563 | スシローグローバルホールディングス | 10,600 | 6,240.00  | 66,144,000  |                            |
| 3564 | L I X I L ビバ      | 8,200  | 1,582.00  | 12,972,400  |                            |
| 4350 | メディカルシステムネットワーク   | 10,200 | 419.00    | 4,273,800   |                            |
| 7416 | はるやまホールディングス      | 4,500  | 862.00    | 3,879,000   |                            |
| 7419 | ノジマ               | 17,100 | 2,147.00  | 36,713,700  |                            |
| 7421 | カップ・クリエイト         | 13,500 | 1,386.00  | 18,711,000  |                            |
| 7445 | ライトオン             | 8,100  | 835.00    | 6,763,500   |                            |
| 7448 | ジーンズメイト           | 2,900  | 372.00    | 1,078,800   | 貸付有価証券<br>2,400株(2,400株)   |
| 7453 | 良品計画              | 13,700 | 24,320.00 | 333,184,000 |                            |
| 7455 | 三城ホールディングス        | 11,900 | 411.00    | 4,890,900   |                            |
| 7463 | アドヴァン             | 14,700 | 890.00    | 13,083,000  | 貸付有価証券<br>7,400株(7,400株)   |
| 7475 | アルビス              | 3,700  | 2,485.00  | 9,194,500   |                            |
| 7494 | コナカ               | 12,300 | 448.00    | 5,510,400   |                            |
| 7506 | ハウス オブ ローゼ        | 1,200  | 1,830.00  | 2,196,000   |                            |
| 7508 | G - 7ホールディングス     | 2,800  | 2,075.00  | 5,810,000   |                            |
| 7512 | イオン北海道            | 9,700  | 793.00    | 7,692,100   |                            |
| 7513 | コジマ               | 14,200 | 553.00    | 7,852,600   |                            |
| 7514 | ヒマラヤ              | 3,000  | 937.00    | 2,811,000   |                            |
| 7516 | コーナン商事            | 12,600 | 2,709.00  | 34,133,400  |                            |
| 7520 | エコス               | 3,500  | 1,684.00  | 5,894,000   |                            |
| 7522 | ワタミ               | 12,700 | 1,378.00  | 17,500,600  | 貸付有価証券<br>4,700株(4,700株)   |
| 7524 | マルシェ              | 2,500  | 762.00    | 1,905,000   |                            |
| 7532 | ドンキホーテホールディングス    | 62,500 | 6,200.00  | 387,500,000 |                            |
| 7545 | 西松屋チェーン           | 21,100 | 900.00    | 18,990,000  |                            |
| 7550 | ゼンショーホールディングス     | 45,500 | 2,501.00  | 113,795,500 | 貸付有価証券<br>40,100株(40,100株) |
| 7554 | 幸楽苑ホールディングス       | 6,100  | 2,010.00  | 12,261,000  |                            |
| 7561 | ハークスレイ            | 2,000  | 1,094.00  | 2,188,000   |                            |
| 7581 | サイゼリヤ             | 15,900 | 2,048.00  | 32,563,200  | 貸付有価証券<br>12,800株(12,800株) |
| 7593 | V Tホールディングス       | 32,600 | 425.00    | 13,855,000  |                            |
| 7596 | 魚力                | 2,700  | 1,429.00  | 3,858,300   |                            |
| 7601 | ポプラ               | 2,500  | 628.00    | 1,570,000   |                            |
| 7605 | フジ・コーポレーション       | 1,900  | 2,045.00  | 3,885,500   |                            |
| 7606 | ユナイテッドアローズ        | 11,000 | 3,700.00  | 40,700,000  |                            |
| 7611 | ハイデイ日高            | 12,600 | 2,131.00  | 26,850,600  |                            |

|      |                      |        |           |             |                            |
|------|----------------------|--------|-----------|-------------|----------------------------|
| 7615 | 京都きもの友禅              | 6,100  | 423.00    | 2,580,300   | 貸付有価証券<br>5,000株（5,000株）   |
| 7616 | コロワイド                | 32,000 | 2,338.00  | 74,816,000  | 貸付有価証券<br>25,900株（25,900株） |
| 7618 | ピーシーデポコーポレーション       | 12,800 | 436.00    | 5,580,800   |                            |
| 7630 | 壱番屋                  | 6,800  | 4,475.00  | 30,430,000  | 貸付有価証券<br>5,100株（5,100株）   |
| 7640 | トップカルチャー             | 3,500  | 285.00    | 997,500     | 貸付有価証券<br>2,300株（2,300株）   |
| 7646 | P L A N T            | 2,200  | 1,006.00  | 2,213,200   |                            |
| 7649 | スギホールディングス           | 21,200 | 4,485.00  | 95,082,000  |                            |
| 7918 | ヴィア・ホールディングス         | 11,800 | 659.00    | 7,776,200   | 貸付有価証券<br>5,300株（5,300株）   |
| 8005 | スクロール                | 14,800 | 428.00    | 6,334,400   |                            |
| 8008 | ヨンドシーホールディングス        | 10,700 | 2,112.00  | 22,598,400  | 貸付有価証券<br>5,900株（5,900株）   |
| 8028 | ユニー・ファミリーマートホールディングス | 27,000 | 12,430.00 | 335,610,000 | 貸付有価証券<br>20,400株（20,400株） |
| 8160 | 木曾路                  | 11,800 | 2,473.00  | 29,181,400  | 貸付有価証券<br>9,500株（9,500株）   |
| 8163 | S R Sホールディングス        | 11,400 | 969.00    | 11,046,600  |                            |
| 8165 | 千趣会                  | 17,500 | 257.00    | 4,497,500   |                            |
| 8166 | タカキュー                | 7,400  | 187.00    | 1,383,800   |                            |
| 8168 | ケーヨー                 | 17,800 | 531.00    | 9,451,800   | 貸付有価証券<br>13,100株（13,100株） |
| 8173 | 上新電機                 | 11,400 | 2,357.00  | 26,869,800  |                            |
| 8174 | 日本瓦斯                 | 15,700 | 4,030.00  | 63,271,000  | 貸付有価証券<br>8,900株（8,900株）   |
| 8179 | ロイヤルホールディングス         | 16,800 | 2,643.00  | 44,402,400  | 貸付有価証券<br>13,000株（13,000株） |
| 8181 | 東天紅                  | 700    | 1,280.00  | 896,000     |                            |
| 8182 | いなげや                 | 10,700 | 1,331.00  | 14,241,700  | 貸付有価証券<br>7,700株（7,700株）   |
| 8184 | 島忠                   | 21,800 | 3,140.00  | 68,452,000  | 貸付有価証券<br>12,300株（12,300株） |
| 8185 | チヨダ                  | 10,100 | 1,837.00  | 18,553,700  |                            |
| 8194 | ライフコーポレーション          | 7,300  | 2,428.00  | 17,724,400  |                            |
| 8200 | リンガーハット              | 11,900 | 2,347.00  | 27,929,300  | 貸付有価証券<br>7,000株（7,000株）   |
| 8203 | M r M a x H D        | 13,200 | 508.00    | 6,705,600   |                            |
| 8207 | デンアライド               | 8,900  | 392.00    | 3,488,800   |                            |
| 8214 | A O K Iホールディングス      | 19,300 | 1,241.00  | 23,951,300  | 貸付有価証券<br>9,400株（9,400株）   |
| 8217 | オークワ                 | 13,700 | 1,020.00  | 13,974,000  |                            |
| 8218 | コメリ                  | 14,900 | 2,520.00  | 37,548,000  |                            |
| 8219 | 青山商事                 | 16,800 | 2,692.00  | 45,225,600  |                            |
| 8227 | しまむら                 | 11,200 | 9,240.00  | 103,488,000 | 貸付有価証券<br>6,300株（6,300株）   |

|      |                   |         |           |             |                              |
|------|-------------------|---------|-----------|-------------|------------------------------|
| 8230 | はせがわ              | 5,100   | 400.00    | 2,040,000   |                              |
| 8233 | 高島屋               | 75,600  | 1,475.00  | 111,510,000 |                              |
| 8237 | 松屋                | 19,400  | 998.00    | 19,361,200  | 貸付有価証券<br>15,600株(15,600株)   |
| 8242 | エイチ・ツー・オー リテイリング  | 49,500  | 1,558.00  | 77,121,000  | 貸付有価証券<br>40,000株(40,000株)   |
| 8244 | 近鉄百貨店             | 3,700   | 3,350.00  | 12,395,000  | 貸付有価証券<br>100株(100株)         |
| 8251 | パルコ               | 9,200   | 1,046.00  | 9,623,200   | 貸付有価証券<br>7,400株(7,400株)     |
| 8252 | 丸井グループ            | 81,600  | 2,184.00  | 178,214,400 |                              |
| 8255 | アクシアル リテイリング      | 8,000   | 3,495.00  | 27,960,000  |                              |
| 8260 | 井筒屋               | 4,900   | 205.00    | 1,004,500   | 貸付有価証券<br>4,200株(4,200株)     |
| 8267 | イオン               | 370,900 | 2,162.00  | 801,885,800 | 貸付有価証券<br>225,800株(225,800株) |
| 8273 | イズミ               | 19,600  | 5,370.00  | 105,252,000 |                              |
| 8276 | 平和堂               | 19,600  | 2,495.00  | 48,902,000  |                              |
| 8278 | フジ                | 11,600  | 1,882.00  | 21,831,200  |                              |
| 8279 | ヤオコー              | 10,900  | 5,600.00  | 61,040,000  |                              |
| 8281 | ゼビオホールディングス       | 11,600  | 1,263.00  | 14,650,800  |                              |
| 8282 | ケーズホールディングス       | 100,200 | 1,085.00  | 108,717,000 |                              |
| 8289 | O l y m p i cグループ | 5,700   | 672.00    | 3,830,400   | 貸付有価証券<br>4,500株(4,500株)     |
| 8291 | 日産東京販売ホールディングス    | 14,200  | 317.00    | 4,501,400   |                              |
| 9267 | Genky DrugStores  | 3,800   | 2,647.00  | 10,058,600  | 貸付有価証券<br>3,000株(3,000株)     |
| 9277 | 総合メディカルホールディングス   | 8,400   | 1,905.00  | 16,002,000  |                              |
| 9278 | ブックオフグループホールディングス | 5,000   | 758.00    | 3,790,000   |                              |
| 9627 | アインホールディングス       | 12,900  | 7,930.00  | 102,297,000 |                              |
| 9828 | 元気寿司              | 2,700   | 4,560.00  | 12,312,000  |                              |
| 9831 | ヤマダ電機             | 293,700 | 539.00    | 158,304,300 | 貸付有価証券<br>249,900株(249,900株) |
| 9842 | アークランドサカモト        | 16,300  | 1,340.00  | 21,842,000  |                              |
| 9843 | ニトリホールディングス       | 41,700  | 14,045.00 | 585,676,500 | 貸付有価証券<br>21,500株(21,500株)   |
| 9850 | グルメ杵屋             | 6,900   | 1,148.00  | 7,921,200   |                              |
| 9854 | 愛眼                | 7,700   | 296.00    | 2,279,200   | 貸付有価証券<br>6,200株(6,200株)     |
| 9856 | ケーユーホールディングス      | 5,000   | 796.00    | 3,980,000   |                              |
| 9861 | 吉野家ホールディングス       | 33,600  | 1,743.00  | 58,564,800  | 貸付有価証券<br>26,700株(26,700株)   |
| 9887 | 松屋フーズホールディングス     | 4,600   | 3,600.00  | 16,560,000  |                              |
| 9900 | サガミホールディングス       | 12,900  | 1,330.00  | 17,157,000  | 貸付有価証券<br>10,000株(10,000株)   |
| 9919 | 関西スーパーマーケット       | 7,300   | 993.00    | 7,248,900   |                              |



|      |                     |           |           |               |                              |
|------|---------------------|-----------|-----------|---------------|------------------------------|
| 9936 | 王将フードサービス           | 7,100     | 6,950.00  | 49,345,000    |                              |
| 9945 | プレナス                | 10,800    | 1,864.00  | 20,131,200    | 貸付有価証券<br>6,100株(6,100株)     |
| 9946 | ミニストップ              | 7,100     | 1,996.00  | 14,171,600    |                              |
| 9948 | アークス                | 18,100    | 2,423.00  | 43,856,300    |                              |
| 9956 | パローホールディングス         | 20,800    | 2,593.00  | 53,934,400    |                              |
| 9966 | 藤久                  | 800       | 755.00    | 604,000       |                              |
| 9974 | ベルク                 | 4,800     | 4,830.00  | 23,184,000    |                              |
| 9979 | 大庄                  | 5,200     | 1,551.00  | 8,065,200     |                              |
| 9983 | ファーストリテイリング         | 12,900    | 50,170.00 | 647,193,000   | 貸付有価証券<br>10,100株(10,100株)   |
| 9989 | サンドラッグ              | 36,300    | 3,430.00  | 124,509,000   |                              |
| 9990 | サックスパーホールディングス      | 8,200     | 1,076.00  | 8,823,200     |                              |
| 9993 | ヤマザワ                | 2,000     | 1,775.00  | 3,550,000     |                              |
| 9994 | やまや                 | 1,600     | 2,197.00  | 3,515,200     |                              |
| 9997 | ベルーナ                | 23,600    | 1,022.00  | 24,119,200    | 貸付有価証券<br>19,400株(19,400株)   |
| 7150 | 島根銀行                | 2,000     | 708.00    | 1,416,000     |                              |
| 7161 | じもとホールディングス         | 65,200    | 121.00    | 7,889,200     |                              |
| 7167 | めぶきフィナンシャルグループ      | 501,600   | 307.00    | 153,991,200   |                              |
| 7173 | 東京きらぼしフィナンシャルグループ   | 13,000    | 1,551.00  | 20,163,000    | 貸付有価証券<br>10,800株(10,800株)   |
| 7180 | 九州フィナンシャルグループ       | 158,400   | 432.00    | 68,428,800    |                              |
| 7182 | ゆうちょ銀行              | 273,500   | 1,244.00  | 340,234,000   | 貸付有価証券<br>170,800株(170,800株) |
| 7184 | 富山第一銀行              | 23,000    | 389.00    | 8,947,000     |                              |
| 7186 | コンコルディア・フィナンシャルグループ | 614,800   | 449.00    | 276,045,200   |                              |
| 7189 | 西日本フィナンシャルホールディングス  | 61,800    | 1,001.00  | 61,861,800    |                              |
| 7321 | 関西みらいフィナンシャルグループ    | 45,300    | 814.00    | 36,874,200    | 貸付有価証券<br>33,700株(33,700株)   |
| 7322 | 三十三フィナンシャルグループ      | 8,300     | 1,669.00  | 13,852,700    | 貸付有価証券<br>5,500株(5,500株)     |
| 7327 | 第四北越フィナンシャルグループ     | 16,800    | 3,110.00  | 52,248,000    |                              |
| 8303 | 新生銀行                | 70,800    | 1,459.00  | 103,297,200   | 貸付有価証券<br>47,000株(47,000株)   |
| 8304 | あおぞら銀行              | 53,900    | 3,335.00  | 179,756,500   |                              |
| 8306 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ   | 6,722,500 | 581.10    | 3,906,444,750 |                              |
| 8308 | りそなホールディングス         | 1,059,300 | 550.70    | 583,356,510   |                              |
| 8309 | 三井住友トラスト・ホールディングス   | 189,800   | 4,248.00  | 806,270,400   |                              |
| 8316 | 三井住友フィナンシャルグループ     | 680,300   | 4,006.00  | 2,725,281,800 |                              |
| 8331 | 千葉銀行                | 341,900   | 660.00    | 225,654,000   | 貸付有価証券<br>210,000株(210,000株) |
| 8334 | 群馬銀行                | 193,100   | 475.00    | 91,722,500    |                              |

|      |                 |         |          |             |                            |
|------|-----------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 8336 | 武蔵野銀行           | 14,400  | 2,516.00 | 36,230,400  |                            |
| 8337 | 千葉興業銀行          | 26,500  | 353.00   | 9,354,500   |                            |
| 8338 | 筑波銀行            | 40,100  | 220.00   | 8,822,000   | 貸付有価証券<br>24,800株（24,800株） |
| 8341 | 七十七銀行           | 30,300  | 1,934.00 | 58,600,200  |                            |
| 8342 | 青森銀行            | 7,500   | 2,777.00 | 20,827,500  | 貸付有価証券<br>5,700株（5,700株）   |
| 8343 | 秋田銀行            | 6,200   | 2,150.00 | 13,330,000  |                            |
| 8344 | 山形銀行            | 10,800  | 1,980.00 | 21,384,000  | 貸付有価証券<br>8,800株（8,800株）   |
| 8345 | 岩手銀行            | 6,700   | 3,365.00 | 22,545,500  | 貸付有価証券<br>5,400株（5,400株）   |
| 8346 | 東邦銀行            | 86,300  | 313.00   | 27,011,900  | 貸付有価証券<br>69,000株（69,000株） |
| 8349 | 東北銀行            | 4,900   | 1,095.00 | 5,365,500   |                            |
| 8350 | みちのく銀行          | 6,200   | 1,710.00 | 10,602,000  | 貸付有価証券<br>3,900株（3,900株）   |
| 8354 | ふくおかフィナンシャルグループ | 78,400  | 2,416.00 | 189,414,400 | 貸付有価証券<br>44,200株（44,200株） |
| 8355 | 静岡銀行            | 243,000 | 904.00   | 219,672,000 |                            |
| 8356 | 十六銀行            | 13,000  | 2,351.00 | 30,563,000  |                            |
| 8358 | スルガ銀行           | 98,800  | 459.00   | 45,349,200  |                            |
| 8359 | 八十二銀行           | 174,700 | 462.00   | 80,711,400  |                            |
| 8360 | 山梨中央銀行          | 12,000  | 1,453.00 | 17,436,000  | 貸付有価証券<br>9,600株（9,600株）   |
| 8361 | 大垣共立銀行          | 15,300  | 2,247.00 | 34,379,100  | 貸付有価証券<br>6,800株（6,800株）   |
| 8362 | 福井銀行            | 8,300   | 1,610.00 | 13,363,000  | 貸付有価証券<br>5,500株（5,500株）   |
| 8363 | 北國銀行            | 10,300  | 3,440.00 | 35,432,000  | 貸付有価証券<br>6,100株（6,100株）   |
| 8364 | 清水銀行            | 4,000   | 1,587.00 | 6,348,000   | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株）   |
| 8365 | 富山銀行            | 1,900   | 3,180.00 | 6,042,000   | 貸付有価証券<br>500株（500株）       |
| 8366 | 滋賀銀行            | 19,400  | 2,572.00 | 49,896,800  | 貸付有価証券<br>10,200株（10,200株） |
| 8367 | 南都銀行            | 11,300  | 2,212.00 | 24,995,600  |                            |
| 8368 | 百五銀行            | 86,900  | 393.00   | 34,151,700  | 貸付有価証券<br>38,300株（38,300株） |
| 8369 | 京都銀行            | 34,600  | 4,575.00 | 158,295,000 | 貸付有価証券<br>20,800株（20,800株） |
| 8370 | 紀陽銀行            | 34,200  | 1,537.00 | 52,565,400  | 貸付有価証券<br>30,600株（30,600株） |
| 8377 | ほくほくフィナンシャルグループ | 64,300  | 1,254.00 | 80,632,200  |                            |
| 8379 | 広島銀行            | 142,500 | 626.00   | 89,205,000  |                            |
| 8381 | 山陰合同銀行          | 57,200  | 786.00   | 44,959,200  |                            |
| 8382 | 中国銀行            | 62,300  | 961.00   | 59,870,300  |                            |
| 8383 | 鳥取銀行            | 3,300   | 1,378.00 | 4,547,400   |                            |

|      |                |            |          |               |                                      |
|------|----------------|------------|----------|---------------|--------------------------------------|
| 8385 | 伊予銀行           | 127,900    | 598.00   | 76,484,200    | 貸付有価証券<br>13,200株(13,200株)           |
| 8386 | 百十四銀行          | 10,300     | 2,549.00 | 26,254,700    | 貸付有価証券<br>400株(400株)                 |
| 8387 | 四国銀行           | 13,800     | 1,054.00 | 14,545,200    |                                      |
| 8388 | 阿波銀行           | 15,500     | 2,908.00 | 45,074,000    | 貸付有価証券<br>8,800株(8,800株)             |
| 8392 | 大分銀行           | 5,900      | 3,350.00 | 19,765,000    | 貸付有価証券<br>3,300株(3,300株)             |
| 8393 | 宮崎銀行           | 6,400      | 2,732.00 | 17,484,800    |                                      |
| 8395 | 佐賀銀行           | 5,900      | 1,751.00 | 10,330,900    |                                      |
| 8396 | 十八銀行           | 5,900      | 2,668.00 | 15,741,200    |                                      |
| 8397 | 沖縄銀行           | 8,800      | 3,060.00 | 26,928,000    | 貸付有価証券<br>7,300株(7,300株)             |
| 8399 | 琉球銀行           | 22,300     | 1,133.00 | 25,265,900    | 貸付有価証券<br>16,000株(16,000株)           |
| 8410 | セブン銀行          | 326,100    | 326.00   | 106,308,600   | 貸付有価証券<br>203,600株(203,600株)         |
| 8411 | みずほフィナンシャルグループ | 13,116,600 | 178.40   | 2,340,001,440 | 貸付有価証券<br>4,127,500株<br>(4,127,500株) |
| 8416 | 高知銀行           | 3,500      | 768.00   | 2,688,000     |                                      |
| 8418 | 山口フィナンシャルグループ  | 120,500    | 1,087.00 | 130,983,500   |                                      |
| 8521 | 長野銀行           | 3,200      | 1,582.00 | 5,062,400     | 貸付有価証券<br>2,500株(2,500株)             |
| 8522 | 名古屋銀行          | 7,800      | 3,225.00 | 25,155,000    | 貸付有価証券<br>6,500株(6,500株)             |
| 8524 | 北洋銀行           | 145,500    | 292.00   | 42,486,000    | 貸付有価証券<br>81,800株(81,800株)           |
| 8527 | 愛知銀行           | 3,500      | 3,685.00 | 12,897,500    |                                      |
| 8530 | 中京銀行           | 4,000      | 2,140.00 | 8,560,000     | 貸付有価証券<br>3,200株(3,200株)             |
| 8537 | 大光銀行           | 3,300      | 1,692.00 | 5,583,600     | 貸付有価証券<br>100株(100株)                 |
| 8541 | 愛媛銀行           | 13,500     | 1,050.00 | 14,175,000    | 貸付有価証券<br>9,000株(9,000株)             |
| 8542 | トマト銀行          | 3,700      | 1,070.00 | 3,959,000     |                                      |
| 8544 | 京葉銀行           | 42,600     | 707.00   | 30,118,200    | 貸付有価証券<br>22,500株(22,500株)           |
| 8550 | 栃木銀行           | 50,000     | 236.00   | 11,800,000    |                                      |
| 8551 | 北日本銀行          | 3,000      | 2,125.00 | 6,375,000     |                                      |
| 8558 | 東和銀行           | 16,900     | 720.00   | 12,168,000    |                                      |
| 8562 | 福島銀行           | 8,400      | 386.00   | 3,242,400     |                                      |
| 8563 | 大東銀行           | 4,600      | 603.00   | 2,773,800     |                                      |
| 8600 | トモニホールディングス    | 74,600     | 403.00   | 30,063,800    | 貸付有価証券<br>59,900株(59,900株)           |
| 8713 | フィデアホールディングス   | 93,700     | 136.00   | 12,743,200    |                                      |
| 8714 | 池田泉州ホールディングス   | 102,500    | 301.00   | 30,852,500    |                                      |

|      |                          |           |          |               |                              |
|------|--------------------------|-----------|----------|---------------|------------------------------|
| 7148 | F P G                    | 30,300    | 1,150.00 | 34,845,000    |                              |
| 7190 | マーキュリアインベストメント           | 3,700     | 711.00   | 2,630,700     |                              |
| 8473 | S B Iホールディングス            | 115,000   | 2,311.00 | 265,765,000   | 貸付有価証券<br>65,300株（65,300株）   |
| 8518 | 日本アジア投資                  | 8,200     | 200.00   | 1,640,000     |                              |
| 8595 | ジャフコ                     | 15,800    | 3,805.00 | 60,119,000    | 貸付有価証券<br>7,400株（7,400株）     |
| 8601 | 大和証券グループ本社               | 774,500   | 591.00   | 457,729,500   | 貸付有価証券<br>344,300株（344,300株） |
| 8604 | 野村ホールディングス               | 1,771,400 | 452.30   | 801,204,220   | 貸付有価証券<br>322,500株（322,500株） |
| 8609 | 岡三証券グループ                 | 82,200    | 525.00   | 43,155,000    | 貸付有価証券<br>43,000株（43,000株）   |
| 8613 | 丸三証券                     | 28,700    | 810.00   | 23,247,000    | 貸付有価証券<br>23,200株（23,200株）   |
| 8614 | 東洋証券                     | 34,500    | 177.00   | 6,106,500     | 貸付有価証券<br>14,000株（14,000株）   |
| 8616 | 東海東京フィナンシャル・ホールディングス     | 115,100   | 506.00   | 58,240,600    |                              |
| 8617 | 光世証券                     | 2,300     | 774.00   | 1,780,200     |                              |
| 8622 | 水戸証券                     | 27,900    | 269.00   | 7,505,100     |                              |
| 8624 | いちよし証券                   | 20,300    | 838.00   | 17,011,400    |                              |
| 8628 | 松井証券                     | 47,300    | 1,182.00 | 55,908,600    | 貸付有価証券<br>39,600株（39,600株）   |
| 8692 | だいこう証券ビジネス               | 3,900     | 406.00   | 1,583,400     |                              |
| 8698 | マネックスグループ                | 90,100    | 398.00   | 35,859,800    | 貸付有価証券<br>76,000株（76,000株）   |
| 8703 | カブドットコム証券                | 72,200    | 524.00   | 37,832,800    |                              |
| 8706 | 極東証券                     | 12,900    | 1,135.00 | 14,641,500    |                              |
| 8707 | 岩井コスモホールディングス            | 9,900     | 1,305.00 | 12,919,500    |                              |
| 8708 | 藍澤證券                     | 18,100    | 641.00   | 11,602,100    | 貸付有価証券<br>6,800株（6,800株）     |
| 8732 | マネーパートナーズグループ            | 11,300    | 297.00   | 3,356,100     |                              |
| 8742 | 小林洋行                     | 2,800     | 257.00   | 719,600       | 貸付有価証券<br>100株（100株）         |
| 7181 | かんぼ生命保険                  | 36,500    | 2,457.00 | 89,680,500    | 貸付有価証券<br>22,700株（22,700株）   |
| 8630 | S O M P Oホールディングス        | 170,200   | 4,022.00 | 684,544,400   |                              |
| 8715 | アニコムホールディングス             | 7,700     | 3,105.00 | 23,908,500    | 貸付有価証券<br>2,500株（2,500株）     |
| 8725 | M S & A Dインシュアランスグループホール | 252,400   | 3,200.00 | 807,680,000   |                              |
| 8729 | ソニーフィナンシャルホールディングス       | 79,300    | 2,062.00 | 163,516,600   |                              |
| 8750 | 第一生命ホールディングス             | 546,100   | 1,751.50 | 956,494,150   |                              |
| 8766 | 東京海上ホールディングス             | 349,900   | 5,285.00 | 1,849,221,500 |                              |

|      |                 |         |          |               |                              |
|------|-----------------|---------|----------|---------------|------------------------------|
| 8795 | T & Dホールディングス   | 298,500 | 1,358.50 | 405,512,250   | 貸付有価証券<br>111,700株(111,700株) |
| 8798 | アドバンスクリエイト      | 2,300   | 1,722.00 | 3,960,600     |                              |
| 7164 | 全国保証            | 27,200  | 3,815.00 | 103,768,000   | 貸付有価証券<br>19,000株(19,000株)   |
| 7187 | ジェイリース          | 2,000   | 379.00   | 758,000       | 貸付有価証券<br>700株(700株)         |
| 7191 | イントラスト          | 2,700   | 450.00   | 1,215,000     | 貸付有価証券<br>1,000株(1,000株)     |
| 7192 | 日本モーゲージサービス     | 1,300   | 1,335.00 | 1,735,500     |                              |
| 7196 | C a s a         | 3,200   | 1,172.00 | 3,750,400     |                              |
| 7198 | アルヒ             | 8,800   | 2,307.00 | 20,301,600    | 貸付有価証券<br>3,300株(3,300株)     |
| 7199 | プレミアグループ        | 1,500   | 3,320.00 | 4,980,000     |                              |
| 8253 | クレディセゾン         | 67,600  | 1,436.00 | 97,073,600    |                              |
| 8424 | 芙蓉総合リース         | 11,000  | 5,360.00 | 58,960,000    | 貸付有価証券<br>2,100株(2,100株)     |
| 8425 | 興銀リース           | 18,100  | 2,459.00 | 44,507,900    |                              |
| 8439 | 東京センチュリー        | 19,400  | 4,820.00 | 93,508,000    | 貸付有価証券<br>4,600株(4,600株)     |
| 8511 | 日本証券金融          | 42,500  | 609.00   | 25,882,500    | 貸付有価証券<br>34,400株(34,400株)   |
| 8515 | アイフル            | 147,300 | 271.00   | 39,918,300    | 貸付有価証券<br>33,000株(33,000株)   |
| 8566 | リコーリース          | 7,600   | 3,285.00 | 24,966,000    |                              |
| 8570 | イオンフィナンシャルサービス  | 61,700  | 2,129.00 | 131,359,300   | 貸付有価証券<br>31,500株(31,500株)   |
| 8572 | アコム             | 193,100 | 380.00   | 73,378,000    | 貸付有価証券<br>109,100株(109,100株) |
| 8584 | ジャックス           | 10,700  | 1,877.00 | 20,083,900    | 貸付有価証券<br>8,600株(8,600株)     |
| 8585 | オリエントコーポレーション   | 261,100 | 132.00   | 34,465,200    | 貸付有価証券<br>155,900株(155,900株) |
| 8586 | 日立キャピタル         | 22,800  | 2,436.00 | 55,540,800    | 貸付有価証券<br>10,700株(10,700株)   |
| 8589 | アプラスフィナンシャル     | 46,300  | 82.00    | 3,796,600     | 貸付有価証券<br>28,600株(28,600株)   |
| 8591 | オリックス           | 644,000 | 1,683.50 | 1,084,174,000 |                              |
| 8593 | 三菱UFJリース        | 217,800 | 553.00   | 120,443,400   |                              |
| 8596 | 九州リースサービス       | 4,700   | 692.00   | 3,252,400     |                              |
| 8697 | 日本取引所グループ       | 260,800 | 1,969.00 | 513,515,200   |                              |
| 8771 | イー・ギャランティ       | 9,000   | 990.00   | 8,910,000     | 貸付有価証券<br>6,800株(6,800株)     |
| 8772 | アサックス           | 4,000   | 548.00   | 2,192,000     |                              |
| 8793 | NECキャピタルソリューション | 3,900   | 1,611.00 | 6,282,900     | 貸付有価証券<br>800株(800株)         |
| 2337 | いちご             | 122,700 | 366.00   | 44,908,200    |                              |

|      |                  |         |          |             |                            |
|------|------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 2353 | 日本駐車場開発          | 116,400 | 151.00   | 17,576,400  |                            |
| 3003 | ヒューリック           | 201,500 | 983.00   | 198,074,500 | 貸付有価証券<br>91,600株(91,600株) |
| 3228 | 三栄建築設計           | 3,900   | 1,682.00 | 6,559,800   |                            |
| 3230 | スター・マイカ          | 4,400   | 1,422.00 | 6,256,800   | 貸付有価証券<br>2,300株(2,300株)   |
| 3231 | 野村不動産ホールディングス    | 64,300  | 2,098.00 | 134,901,400 |                            |
| 3232 | 三重交通グループホールディングス | 19,600  | 604.00   | 11,838,400  |                            |
| 3244 | サムティ             | 13,300  | 1,509.00 | 20,069,700  |                            |
| 3245 | ディア・ライフ          | 12,300  | 450.00   | 5,535,000   |                            |
| 3246 | コーセーアールイー        | 2,800   | 910.00   | 2,548,000   | 貸付有価証券<br>1,000株(1,000株)   |
| 3250 | エー・ディー・ワークス      | 148,100 | 37.00    | 5,479,700   |                            |
| 3252 | 日本商業開発           | 6,000   | 1,516.00 | 9,096,000   |                            |
| 3254 | プレサンスコーポレーション    | 15,300  | 1,513.00 | 23,148,900  | 貸付有価証券<br>8,000株(8,000株)   |
| 3258 | ユニゾホールディングス      | 14,600  | 2,118.00 | 30,922,800  | 貸付有価証券<br>3,400株(3,400株)   |
| 3271 | THEグローバル社        | 4,500   | 545.00   | 2,452,500   |                            |
| 3276 | 日本管理センター         | 6,400   | 860.00   | 5,504,000   |                            |
| 3277 | サンセイランディック       | 2,600   | 804.00   | 2,090,400   |                            |
| 3280 | エストラスト           | 1,300   | 771.00   | 1,002,300   |                            |
| 3284 | フージャースホールディングス   | 21,600  | 630.00   | 13,608,000  | 貸付有価証券<br>6,200株(6,200株)   |
| 3288 | オープンハウス          | 15,700  | 4,445.00 | 69,786,500  | 貸付有価証券<br>6,400株(6,400株)   |
| 3289 | 東急不動産ホールディングス    | 259,600 | 579.00   | 150,308,400 |                            |
| 3291 | 飯田グループホールディングス   | 80,500  | 1,980.00 | 159,390,000 | 貸付有価証券<br>35,000株(35,000株) |
| 3294 | イーグランド           | 1,400   | 682.00   | 954,800     | 貸付有価証券<br>200株(200株)       |
| 3299 | ムゲンエステート         | 6,700   | 626.00   | 4,194,200   | 貸付有価証券<br>2,100株(2,100株)   |
| 3452 | ビーロット            | 1,500   | 1,332.00 | 1,998,000   | 貸付有価証券<br>100株(100株)       |
| 3454 | ファーストブラザーズ       | 2,600   | 1,035.00 | 2,691,000   | 貸付有価証券<br>1,700株(1,700株)   |
| 3457 | ハウスドゥ            | 3,500   | 1,310.00 | 4,585,000   |                            |
| 3458 | シーアールイー          | 3,200   | 974.00   | 3,116,800   |                            |
| 3464 | プロパティエージェント      | 1,000   | 1,001.00 | 1,001,000   | 貸付有価証券<br>300株(300株)       |
| 3465 | ケイアイスター不動産       | 2,600   | 1,814.00 | 4,716,400   |                            |
| 3467 | アグレ都市デザイン        | 1,200   | 619.00   | 742,800     |                            |
| 3475 | グッドコムアセット        | 1,700   | 1,451.00 | 2,466,700   | 貸付有価証券<br>600株(600株)       |
| 3480 | ジェイ・エス・ビー        | 300     | 3,605.00 | 1,081,500   |                            |
| 3484 | テンポイノベーション       | 800     | 1,562.00 | 1,249,600   |                            |
| 3486 | グローバル・リンク・マネジメント | 500     | 851.00   | 425,500     |                            |

|      |              |         |          |               |                              |
|------|--------------|---------|----------|---------------|------------------------------|
| 4666 | パーク24        | 56,400  | 2,607.00 | 147,034,800   | 貸付有価証券<br>28,400株(28,400株)   |
| 4809 | パラカ          | 2,500   | 1,678.00 | 4,195,000     | 貸付有価証券<br>1,700株(1,700株)     |
| 8801 | 三井不動産        | 512,100 | 2,558.00 | 1,309,951,800 | 貸付有価証券<br>256,000株(256,000株) |
| 8802 | 三菱地所         | 676,300 | 1,844.50 | 1,247,435,350 |                              |
| 8803 | 平和不動産        | 18,300  | 1,911.00 | 34,971,300    |                              |
| 8804 | 東京建物         | 105,500 | 1,296.00 | 136,728,000   |                              |
| 8806 | ダイビル         | 28,400  | 1,072.00 | 30,444,800    |                              |
| 8818 | 京阪神ビルディング    | 17,200  | 908.00   | 15,617,600    |                              |
| 8830 | 住友不動産        | 217,000 | 4,109.00 | 891,653,000   | 貸付有価証券<br>130,000株(130,000株) |
| 8841 | テーオーシー       | 22,100  | 817.00   | 18,055,700    |                              |
| 8842 | 東京楽天地        | 1,400   | 4,720.00 | 6,608,000     |                              |
| 8848 | レオパレス21      | 119,100 | 519.00   | 61,812,900    |                              |
| 8850 | スターツコーポレーション | 13,100  | 2,415.00 | 31,636,500    |                              |
| 8860 | フジ住宅         | 12,300  | 838.00   | 10,307,400    | 貸付有価証券<br>3,900株(3,900株)     |
| 8864 | 空港施設         | 11,300  | 526.00   | 5,943,800     |                              |
| 8869 | 明和地所         | 5,300   | 595.00   | 3,153,500     |                              |
| 8871 | ゴールドクレスト     | 7,600   | 1,600.00 | 12,160,000    | 貸付有価証券<br>3,500株(3,500株)     |
| 8877 | 日本エスリード      | 3,800   | 1,535.00 | 5,833,000     |                              |
| 8881 | 日神不動産        | 14,300  | 444.00   | 6,349,200     |                              |
| 8892 | 日本エスコン       | 17,400  | 846.00   | 14,720,400    | 貸付有価証券<br>8,000株(8,000株)     |
| 8897 | タカラレーベン      | 45,200  | 346.00   | 15,639,200    | 貸付有価証券<br>34,500株(34,500株)   |
| 8904 | サンヨーハウジング名古屋 | 5,400   | 924.00   | 4,989,600     |                              |
| 8905 | イオンモール       | 48,400  | 1,793.00 | 86,781,200    | 貸付有価証券<br>35,100株(35,100株)   |
| 8908 | 毎日コムネット      | 1,600   | 740.00   | 1,184,000     |                              |
| 8917 | ファースト住建      | 3,600   | 1,153.00 | 4,150,800     |                              |
| 8918 | ランド          | 394,100 | 8.00     | 3,152,800     | 貸付有価証券<br>148,500株(148,500株) |
| 8919 | カチタス         | 10,800  | 2,929.00 | 31,633,200    | 貸付有価証券<br>4,000株(4,000株)     |
| 8923 | トーセイ         | 13,300  | 1,000.00 | 13,300,000    |                              |
| 8928 | 穴吹興産         | 1,100   | 2,830.00 | 3,113,000     |                              |
| 8934 | サンフロンティア不動産  | 13,300  | 1,187.00 | 15,787,100    | 貸付有価証券<br>400株(400株)         |
| 8935 | エフ・ジェー・ネクスト  | 8,400   | 937.00   | 7,870,800     |                              |
| 8940 | インテリックス      | 2,700   | 663.00   | 1,790,100     |                              |

|      |                 |        |          |             |                            |
|------|-----------------|--------|----------|-------------|----------------------------|
| 8944 | ランドビジネス         | 4,900  | 780.00   | 3,822,000   | 貸付有価証券<br>4,000株(4,000株)   |
| 8999 | グランディハウス        | 8,400  | 418.00   | 3,511,200   |                            |
| 9706 | 日本空港ビルデング       | 30,800 | 3,960.00 | 121,968,000 | 貸付有価証券<br>25,500株(25,500株) |
| 1954 | 日本工営            | 6,300  | 2,512.00 | 15,825,600  | 貸付有価証券<br>5,600株(5,600株)   |
| 2120 | L I F U L L     | 32,500 | 738.00   | 23,985,000  |                            |
| 2124 | ジェイエイシーリクルートメント | 7,500  | 2,142.00 | 16,065,000  |                            |
| 2127 | 日本M&Aセンター       | 69,700 | 2,553.00 | 177,944,100 | 貸付有価証券<br>51,200株(51,200株) |
| 2130 | メンバーズ           | 3,100  | 1,096.00 | 3,397,600   | 貸付有価証券<br>1,500株(1,500株)   |
| 2139 | 中広              | 1,000  | 571.00   | 571,000     |                            |
| 2151 | タケエイ            | 9,700  | 695.00   | 6,741,500   |                            |
| 2153 | E・Jホールディングス     | 1,200  | 1,005.00 | 1,206,000   | 貸付有価証券<br>400株(400株)       |
| 2154 | トラスト・テック        | 4,500  | 3,170.00 | 14,265,000  | 貸付有価証券<br>2,200株(2,200株)   |
| 2157 | コシダカホールディングス    | 25,000 | 1,421.00 | 35,525,000  | 貸付有価証券<br>12,800株(12,800株) |
| 2163 | アルトナー           | 1,700  | 705.00   | 1,198,500   |                            |
| 2168 | パソナグループ         | 8,900  | 1,313.00 | 11,685,700  |                            |
| 2169 | C D S           | 2,300  | 1,133.00 | 2,605,900   |                            |
| 2170 | リンクアンドモチベーション   | 17,200 | 889.00   | 15,290,800  |                            |
| 2174 | G C A           | 9,500  | 722.00   | 6,859,000   |                            |
| 2175 | エス・エム・エス        | 34,400 | 1,724.00 | 59,305,600  | 貸付有価証券<br>20,600株(20,600株) |
| 2180 | サニーサイドアップ       | 700    | 1,343.00 | 940,100     |                            |
| 2181 | パーソルホールディングス    | 93,500 | 1,884.00 | 176,154,000 | 貸付有価証券<br>56,700株(56,700株) |
| 2183 | リニカル            | 5,300  | 1,386.00 | 7,345,800   | 貸付有価証券<br>3,200株(3,200株)   |
| 2193 | クックパッド          | 29,400 | 316.00   | 9,290,400   |                            |
| 2196 | エスクリ            | 2,500  | 605.00   | 1,512,500   |                            |
| 2198 | アイ・ケイ・ケイ        | 4,600  | 742.00   | 3,413,200   |                            |
| 2301 | 学情              | 3,800  | 1,243.00 | 4,723,400   |                            |
| 2305 | スタジオアリス         | 4,700  | 2,415.00 | 11,350,500  |                            |
| 2309 | シミックホールディングス    | 5,200  | 1,660.00 | 8,632,000   |                            |
| 2325 | N J S           | 2,100  | 1,543.00 | 3,240,300   |                            |
| 2331 | 総合警備保障          | 37,200 | 4,870.00 | 181,164,000 |                            |
| 2371 | カカクコム           | 70,400 | 1,865.00 | 131,296,000 | 貸付有価証券<br>34,900株(34,900株) |
| 2372 | アイロムグループ        | 3,600  | 1,560.00 | 5,616,000   | 貸付有価証券<br>2,300株(2,300株)   |
| 2374 | セントケア・ホールディング   | 5,100  | 533.00   | 2,718,300   |                            |
| 2376 | サイネックス          | 1,600  | 687.00   | 1,099,200   |                            |



|      |                  |         |          |             |                            |
|------|------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 2378 | ルネサンス            | 5,200   | 2,115.00 | 10,998,000  |                            |
| 2379 | ディップ             | 15,100  | 1,952.00 | 29,475,200  |                            |
| 2389 | オプトホールディング       | 5,700   | 1,533.00 | 8,738,100   |                            |
| 2395 | 新日本科学            | 12,700  | 754.00   | 9,575,800   |                            |
| 2398 | ツクイ              | 22,000  | 793.00   | 17,446,000  | 貸付有価証券<br>19,400株(19,400株) |
| 2410 | キャリアデザインセンター     | 2,400   | 1,143.00 | 2,743,200   |                            |
| 2412 | ベネフィット・ワン        | 13,000  | 3,400.00 | 44,200,000  |                            |
| 2413 | エムスリー            | 196,900 | 1,554.00 | 305,982,600 | 貸付有価証券<br>76,000株(76,000株) |
| 2418 | ツカダ・グローバルホールディング | 6,000   | 617.00   | 3,702,000   |                            |
| 2424 | プラス              | 700     | 566.00   | 396,200     |                            |
| 2427 | アウトソーシング         | 49,300  | 1,226.00 | 60,441,800  | 貸付有価証券<br>13,000株(13,000株) |
| 2428 | ウェルネット           | 9,400   | 974.00   | 9,155,600   | 貸付有価証券<br>3,600株(3,600株)   |
| 2429 | ワールドホールディングス     | 2,600   | 2,626.00 | 6,827,600   |                            |
| 2432 | ディー・エヌ・エー        | 50,400  | 1,930.00 | 97,272,000  |                            |
| 2433 | 博報堂DYホールディングス    | 130,000 | 1,636.00 | 212,680,000 |                            |
| 2440 | ぐるなび             | 13,300  | 731.00   | 9,722,300   |                            |
| 2445 | エスアールジータカミヤ      | 9,700   | 700.00   | 6,790,000   | 貸付有価証券<br>4,100株(4,100株)   |
| 2453 | ジャパンベストレスキューシステム | 7,400   | 1,292.00 | 9,560,800   |                            |
| 2461 | ファンコミュニケーションズ    | 25,700  | 547.00   | 14,057,900  |                            |
| 2462 | ライク              | 3,700   | 1,113.00 | 4,118,100   | 貸付有価証券<br>3,300株(3,300株)   |
| 2464 | ビジネス・ブレークスルー     | 3,900   | 320.00   | 1,248,000   |                            |
| 2475 | WDBホールディングス      | 4,300   | 2,624.00 | 11,283,200  | 貸付有価証券<br>2,200株(2,200株)   |
| 2485 | ティア              | 4,700   | 605.00   | 2,843,500   |                            |
| 2487 | CDG              | 900     | 1,379.00 | 1,241,100   |                            |
| 2491 | バリューコマース         | 6,300   | 1,434.00 | 9,034,200   | 貸付有価証券<br>5,200株(5,200株)   |
| 2492 | インフォマート          | 51,200  | 1,117.00 | 57,190,400  | 貸付有価証券<br>27,000株(27,000株) |
| 2749 | J Pホールディングス      | 26,700  | 277.00   | 7,395,900   |                            |
| 3521 | エコナックホールディングス    | 16,900  | 115.00   | 1,943,500   |                            |
| 4282 | E P Sホールディングス    | 14,100  | 1,675.00 | 23,617,500  |                            |
| 4286 | レグス              | 2,300   | 937.00   | 2,155,100   |                            |
| 4290 | プレステージ・インターナショナル | 17,500  | 1,299.00 | 22,732,500  | 貸付有価証券<br>9,600株(9,600株)   |
| 4301 | アミューズ            | 5,700   | 2,388.00 | 13,611,600  |                            |
| 4310 | ドリームインキュベータ      | 2,800   | 1,540.00 | 4,312,000   |                            |
| 4318 | クイック             | 5,800   | 1,413.00 | 8,195,400   |                            |
| 4319 | T A C            | 5,100   | 230.00   | 1,173,000   | 貸付有価証券<br>4,300株(4,300株)   |

|      |                |         |           |               |                              |
|------|----------------|---------|-----------|---------------|------------------------------|
| 4321 | ケネディクス         | 87,500  | 558.00    | 48,825,000    | 貸付有価証券<br>66,900株(66,900株)   |
| 4324 | 電通             | 113,900 | 5,110.00  | 582,029,000   | 貸付有価証券<br>54,200株(54,200株)   |
| 4331 | テイクアンドギヴ・ニーズ   | 3,600   | 1,790.00  | 6,444,000     |                              |
| 4337 | びあ             | 2,700   | 3,665.00  | 9,895,500     | 貸付有価証券<br>2,000株(2,000株)     |
| 4343 | イオンファンタジー      | 3,000   | 2,645.00  | 7,935,000     | 貸付有価証券<br>1,200株(1,200株)     |
| 4345 | シーティーエス        | 10,500  | 739.00    | 7,759,500     | 貸付有価証券<br>4,400株(4,400株)     |
| 4346 | ネクシィーズグループ     | 2,900   | 1,910.00  | 5,539,000     |                              |
| 4544 | みらかホールディングス    | 26,100  | 2,756.00  | 71,931,600    | 貸付有価証券<br>15,100株(15,100株)   |
| 4641 | アルプス技研         | 8,200   | 1,756.00  | 14,399,200    |                              |
| 4651 | サニックス          | 16,400  | 206.00    | 3,378,400     |                              |
| 4653 | ダイオーズ          | 2,100   | 1,295.00  | 2,719,500     |                              |
| 4658 | 日本空調サービス       | 10,600  | 652.00    | 6,911,200     |                              |
| 4661 | オリエンタルランド      | 110,500 | 10,825.00 | 1,196,162,500 |                              |
| 4665 | ダスキン           | 25,200  | 2,477.00  | 62,420,400    | 貸付有価証券<br>5,600株(5,600株)     |
| 4668 | 明光ネットワークジャパン   | 11,800  | 971.00    | 11,457,800    |                              |
| 4671 | ファルコホールディングス   | 5,100   | 1,516.00  | 7,731,600     |                              |
| 4678 | 秀英予備校          | 2,000   | 489.00    | 978,000       |                              |
| 4679 | 田谷             | 1,700   | 624.00    | 1,060,800     |                              |
| 4680 | ラウンドワン         | 29,000  | 1,190.00  | 34,510,000    | 貸付有価証券<br>16,300株(16,300株)   |
| 4681 | リゾートトラスト       | 39,600  | 1,590.00  | 62,964,000    | 貸付有価証券<br>34,600株(34,600株)   |
| 4694 | ビー・エム・エル       | 12,000  | 2,957.00  | 35,484,000    |                              |
| 4696 | ワタベウェディング      | 1,500   | 703.00    | 1,054,500     | 貸付有価証券<br>800株(800株)         |
| 4708 | りらいあコミュニケーションズ | 16,900  | 969.00    | 16,376,100    |                              |
| 4714 | リソー教育          | 47,500  | 439.00    | 20,852,500    |                              |
| 4718 | 早稲田アカデミー       | 1,300   | 1,886.00  | 2,451,800     |                              |
| 4732 | ユー・エス・エス       | 114,200 | 1,852.00  | 211,498,400   |                              |
| 4745 | 東京個別指導学院       | 3,300   | 1,282.00  | 4,230,600     |                              |
| 4751 | サイバーエージェント     | 57,600  | 4,195.00  | 241,632,000   | 貸付有価証券<br>23,000株(23,000株)   |
| 4755 | 楽天             | 435,900 | 839.00    | 365,720,100   | 貸付有価証券<br>207,000株(207,000株) |
| 4763 | クリーク・アンド・リバー社  | 5,500   | 1,158.00  | 6,369,000     |                              |
| 4767 | テー・オー・ダブリュー    | 8,900   | 704.00    | 6,265,600     |                              |
| 4801 | セントラルスポーツ      | 3,500   | 3,380.00  | 11,830,000    |                              |
| 4848 | フルキャストホールディングス | 9,400   | 1,812.00  | 17,032,800    |                              |
| 4849 | エン・ジャパン        | 10,200  | 3,925.00  | 40,035,000    |                              |

|      |                     |         |          |               |                          |
|------|---------------------|---------|----------|---------------|--------------------------|
| 5261 | リソルホールディングス         | 1,000   | 4,015.00 | 4,015,000     |                          |
| 6028 | テクノプロ・ホールディングス      | 17,600  | 5,460.00 | 96,096,000    |                          |
| 6029 | アトラ                 | 1,900   | 455.00   | 864,500       | 貸付有価証券<br>700株(700株)     |
| 6032 | インターワークス            | 1,800   | 724.00   | 1,303,200     |                          |
| 6035 | アイ・アールジャパンホールディングス  | 2,800   | 1,299.00 | 3,637,200     |                          |
| 6036 | KeepEr 技研           | 3,000   | 943.00   | 2,829,000     | 貸付有価証券<br>1,400株(1,400株) |
| 6037 | ファーストロジック           | 1,800   | 650.00   | 1,170,000     |                          |
| 6044 | 三機サービス              | 1,400   | 1,388.00 | 1,943,200     | 貸付有価証券<br>600株(600株)     |
| 6047 | Gunosy              | 5,700   | 2,629.00 | 14,985,300    | 貸付有価証券<br>2,100株(2,100株) |
| 6048 | デザインワン・ジャパン         | 1,800   | 323.00   | 581,400       |                          |
| 6050 | イー・ガーディアン           | 4,400   | 2,107.00 | 9,270,800     |                          |
| 6054 | リブセンス               | 5,100   | 275.00   | 1,402,500     |                          |
| 6055 | ジャパンマテリアル           | 25,600  | 1,215.00 | 31,104,000    |                          |
| 6058 | ベクトル                | 11,400  | 1,373.00 | 15,652,200    | 貸付有価証券<br>4,800株(4,800株) |
| 6059 | ウチヤマホールディングス        | 4,600   | 450.00   | 2,070,000     |                          |
| 6062 | チャーム・ケア・コーポレーション    | 1,400   | 1,391.00 | 1,947,400     |                          |
| 6065 | ライクキッズネクスト          | 1,900   | 829.00   | 1,575,100     |                          |
| 6070 | キャリアリンク             | 3,400   | 344.00   | 1,169,600     |                          |
| 6071 | I B J               | 6,300   | 879.00   | 5,537,700     |                          |
| 6073 | アサンテ                | 3,800   | 2,132.00 | 8,101,600     |                          |
| 6077 | N・フィールド             | 6,000   | 960.00   | 5,760,000     |                          |
| 6078 | パリュウHR              | 2,000   | 1,779.00 | 3,558,000     |                          |
| 6080 | M&Aキャピタルパートナーズ      | 2,400   | 4,700.00 | 11,280,000    |                          |
| 6082 | ライドオンエクスプレスホールディングス | 3,800   | 1,209.00 | 4,594,200     |                          |
| 6083 | ERIホールディングス         | 2,600   | 767.00   | 1,994,200     |                          |
| 6087 | アピスト                | 1,500   | 3,270.00 | 4,905,000     |                          |
| 6088 | シグマクシス              | 4,500   | 817.00   | 3,676,500     |                          |
| 6089 | ウィルグループ             | 6,100   | 907.00   | 5,532,700     |                          |
| 6093 | エスクロー・エージェント・ジャパン   | 12,900  | 256.00   | 3,302,400     |                          |
| 6097 | 日本ビューホテル            | 3,000   | 1,093.00 | 3,279,000     |                          |
| 6098 | リクルートホールディングス       | 669,900 | 2,791.50 | 1,870,025,850 |                          |
| 6099 | エラン                 | 6,400   | 1,373.00 | 8,787,200     | 貸付有価証券<br>3,200株(3,200株) |
| 6171 | 土木管理総合試験所           | 4,100   | 511.00   | 2,095,100     | 貸付有価証券<br>1,800株(1,800株) |
| 6178 | 日本郵政                | 766,500 | 1,327.00 | 1,017,145,500 |                          |
| 6183 | ベルシステム24ホールディングス    | 15,700  | 1,429.00 | 22,435,300    |                          |
| 6184 | 鎌倉新書                | 6,800   | 1,355.00 | 9,214,000     | 貸付有価証券<br>3,200株(3,200株) |

|      |                       |        |          |             |                            |
|------|-----------------------|--------|----------|-------------|----------------------------|
| 6186 | 一蔵                    | 1,000  | 593.00   | 593,000     |                            |
| 6187 | LITALICO              | 2,100  | 1,972.00 | 4,141,200   | 貸付有価証券<br>1,000株（1,000株）   |
| 6189 | グローバルグループ             | 1,100  | 948.00   | 1,042,800   |                            |
| 6191 | エボラブルアジア              | 2,700  | 2,257.00 | 6,093,900   | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株）   |
| 6194 | アトラエ                  | 1,800  | 2,068.00 | 3,722,400   | 貸付有価証券<br>600株（600株）       |
| 6196 | ストライク                 | 2,400  | 1,825.00 | 4,380,000   |                            |
| 6197 | ソラスト                  | 22,700 | 1,006.00 | 22,836,200  |                            |
| 6199 | セラク                   | 2,100  | 569.00   | 1,194,900   | 貸付有価証券<br>800株（800株）       |
| 6200 | インソース                 | 3,100  | 2,186.00 | 6,776,600   |                            |
| 6532 | バイカレント・コンサルティング       | 3,800  | 3,155.00 | 11,989,000  |                            |
| 6533 | Orchestra Holdings    | 900    | 917.00   | 825,300     |                            |
| 6535 | アイモバイル                | 2,200  | 733.00   | 1,612,600   |                            |
| 6538 | キャリアインデックス            | 3,200  | 1,287.00 | 4,118,400   |                            |
| 6539 | MS - Japan            | 3,800  | 1,396.00 | 5,304,800   |                            |
| 6540 | 船場                    | 1,500  | 835.00   | 1,252,500   |                            |
| 6541 | グレイステクノロジー            | 2,500  | 1,820.00 | 4,550,000   | 貸付有価証券<br>900株（900株）       |
| 6544 | ジャパンエレベーターサービスホールディング | 5,500  | 1,692.00 | 9,306,000   | 貸付有価証券<br>2,000株（2,000株）   |
| 6546 | フルテック                 | 1,000  | 1,078.00 | 1,078,000   | 貸付有価証券<br>300株（300株）       |
| 6547 | グリーンズ                 | 2,000  | 1,328.00 | 2,656,000   |                            |
| 6551 | ツナグ・ソリューションズ          | 800    | 670.00   | 536,000     |                            |
| 6569 | 日総工産                  | 2,300  | 2,044.00 | 4,701,200   |                            |
| 6571 | キュービーネットホールディングス      | 4,800  | 1,832.00 | 8,793,600   |                            |
| 7030 | スプリックス                | 2,600  | 2,240.00 | 5,824,000   | 貸付有価証券<br>1,000株（1,000株）   |
| 8769 | アドバンテッジリスクマネジメント      | 3,700  | 901.00   | 3,333,700   | 貸付有価証券<br>1,400株（1,400株）   |
| 8876 | リログループ                | 51,100 | 2,779.00 | 142,006,900 | 貸付有価証券<br>31,000株（31,000株） |
| 8920 | 東祥                    | 5,800  | 3,140.00 | 18,212,000  | 貸付有価証券<br>2,800株（2,800株）   |
| 9603 | エイチ・アイ・エス             | 16,700 | 4,020.00 | 67,134,000  |                            |
| 9612 | ラックランド                | 1,800  | 2,051.00 | 3,691,800   | 貸付有価証券<br>300株（300株）       |
| 9616 | 共立メンテナンス              | 14,300 | 4,865.00 | 69,569,500  | 貸付有価証券<br>12,000株（12,000株） |
| 9619 | イチネンホールディングス          | 9,700  | 1,200.00 | 11,640,000  |                            |
| 9621 | 建設技術研究所               | 6,500  | 1,395.00 | 9,067,500   | 貸付有価証券<br>4,300株（4,300株）   |
| 9622 | スペース                  | 6,100  | 1,235.00 | 7,533,500   |                            |
| 9624 | 長大                    | 3,700  | 703.00   | 2,601,100   |                            |

|      |                    |        |          |             |                            |
|------|--------------------|--------|----------|-------------|----------------------------|
| 9628 | 燦ホールディングス          | 2,000  | 2,413.00 | 4,826,000   |                            |
| 9632 | スバル興業              | 600    | 5,580.00 | 3,348,000   |                            |
| 9633 | 東京テアトル             | 3,700  | 1,230.00 | 4,551,000   | 貸付有価証券<br>1,500株(1,500株)   |
| 9644 | タナベ経営              | 1,800  | 1,304.00 | 2,347,200   |                            |
| 9663 | ナガワ                | 2,600  | 5,390.00 | 14,014,000  | 貸付有価証券<br>1,100株(1,100株)   |
| 9671 | よみうりランド            | 2,000  | 3,810.00 | 7,620,000   |                            |
| 9672 | 東京都競馬              | 6,100  | 2,898.00 | 17,677,800  | 貸付有価証券<br>4,600株(4,600株)   |
| 9675 | 常磐興産               | 3,700  | 1,581.00 | 5,849,700   |                            |
| 9678 | カナモト               | 14,000 | 3,015.00 | 42,210,000  |                            |
| 9681 | 東京ドーム              | 35,000 | 919.00   | 32,165,000  | 貸付有価証券<br>26,500株(26,500株) |
| 9699 | 西尾レントオール           | 9,500  | 3,385.00 | 32,157,500  |                            |
| 9704 | アゴーラ・ホスピタリティー・グループ | 51,400 | 27.00    | 1,387,800   | 貸付有価証券<br>37,000株(37,000株) |
| 9715 | トランス・コスモス          | 10,400 | 2,244.00 | 23,337,600  |                            |
| 9716 | 乃村工藝社              | 21,900 | 2,918.00 | 63,904,200  | 貸付有価証券<br>17,600株(17,600株) |
| 9722 | 藤田観光               | 3,700  | 2,738.00 | 10,130,600  | 貸付有価証券<br>600株(600株)       |
| 9726 | KNT-CTホールディングス     | 5,000  | 1,272.00 | 6,360,000   | 貸付有価証券<br>3,000株(3,000株)   |
| 9728 | 日本管財               | 10,000 | 1,893.00 | 18,930,000  |                            |
| 9729 | トーカイ               | 9,000  | 2,780.00 | 25,020,000  |                            |
| 9731 | 白洋舎                | 1,100  | 2,727.00 | 2,999,700   |                            |
| 9735 | セコム                | 99,200 | 9,054.00 | 898,156,800 |                            |
| 9740 | セントラル警備保障          | 4,500  | 4,290.00 | 19,305,000  | 貸付有価証券<br>2,800株(2,800株)   |
| 9743 | 丹青社                | 17,700 | 1,134.00 | 20,071,800  |                            |
| 9744 | メイテック              | 11,900 | 4,645.00 | 55,275,500  |                            |
| 9755 | 応用地質               | 10,100 | 1,128.00 | 11,392,800  |                            |
| 9757 | 船井総研ホールディングス       | 19,400 | 1,748.00 | 33,911,200  | 貸付有価証券<br>17,200株(17,200株) |
| 9760 | 進学会ホールディングス        | 4,300  | 596.00   | 2,562,800   |                            |
| 9765 | オオバ                | 7,300  | 610.00   | 4,453,000   |                            |
| 9768 | いであ                | 1,900  | 961.00   | 1,825,900   |                            |
| 9769 | 学究社                | 3,100  | 1,353.00 | 4,194,300   |                            |
| 9783 | ベネッセホールディングス       | 34,300 | 2,848.00 | 97,686,400  | 貸付有価証券<br>19,300株(19,300株) |
| 9787 | イオンディライト           | 11,500 | 3,995.00 | 45,942,500  | 貸付有価証券<br>6,600株(6,600株)   |
| 9788 | ナック                | 5,900  | 1,022.00 | 6,029,800   |                            |
| 9792 | ニチイ学館              | 13,300 | 977.00   | 12,994,100  |                            |
| 9793 | ダイセキ               | 15,700 | 2,430.00 | 38,151,000  |                            |
| 9795 | ステップ               | 3,400  | 1,224.00 | 4,161,600   |                            |

|     |             |                 |  |
|-----|-------------|-----------------|--|
| 合 計 | 112,867,700 | 215,537,065,230 |  |
|-----|-------------|-----------------|--|

(注1)貸付株式の( )内は、委託者の利害関係人であるモルガン・スタンレーMUFJ証券株式会社に対する貸付で、内書であります。

## (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)

[平成31年 1月28日現在]

|             |                 |
|-------------|-----------------|
| 資産の部        |                 |
| 流動資産        |                 |
| 預金          | 8,158,844,157   |
| コール・ローン     | 629,090,826     |
| 株式          | 304,150,572,543 |
| 投資証券        | 7,890,652,715   |
| 派生商品評価勘定    | 591,857,506     |
| 未収配当金       | 309,136,134     |
| 差入委託証拠金     | 2,272,947,758   |
| 流動資産合計      | 324,003,101,639 |
| 資産合計        | 324,003,101,639 |
| 負債の部        |                 |
| 流動負債        |                 |
| 派生商品評価勘定    | 1,712,747       |
| 未払解約金       | 521,279,380     |
| 未払利息        | 1,201           |
| その他未払費用     | 222             |
| 流動負債合計      | 522,993,550     |
| 負債合計        | 522,993,550     |
| 純資産の部       |                 |
| 元本等         |                 |
| 元本          | 126,097,074,687 |
| 剰余金         |                 |
| 剰余金又は欠損金( ) | 197,383,033,402 |
| 元本等合計       | 323,480,108,089 |
| 純資産合計       | 323,480,108,089 |
| 負債純資産合計     | 324,003,101,639 |

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

|                                  | [平成31年 1月28日現在]  |
|----------------------------------|------------------|
| 1. 期首                            | 平成30年 1月27日      |
| 期首元本額                            | 151,705,309,998円 |
| 期中追加設定元本額                        | 109,833,521,348円 |
| 期中一部解約元本額                        | 135,441,756,659円 |
| 元本の内訳                            |                  |
| ファンド・マネジャー（海外株式）                 | 136,064,002円     |
| eMAXIS 先進国株式インデックス               | 13,468,808,449円  |
| eMAXIS バランス（8資産均等型）              | 1,373,533,931円   |
| eMAXIS バランス（波乗り型）                | 65,698,878円      |
| コアバランス                           | 273,225円         |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金） | 9,462,963円       |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金） | 16,958,535円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金） | 14,029,211円      |
| eMAXIS Slim 先進国株式インデックス          | 12,280,864,055円  |
| 海外株式セレクション（ラップ向け）                | 1,597,585,441円   |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）         | 997,093,739円     |
| つみたて先進国株式                        | 971,953,340円     |
| つみたて8資産均等バランス                    | 273,620,009円     |
| つみたて4資産均等バランス                    | 65,710,172円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s            | 1,060,910円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s            | 1,414,058円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s            | 1,630,540円       |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金） | 1,704,095円       |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金） | 1,654,069円       |

[平成31年 1月28日現在]

|                                       |                 |
|---------------------------------------|-----------------|
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)      | 1,628,647円      |
| eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本)               | 1,289,013,497円  |
| eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)             | 99,294,345円     |
| eMAXIS Slim 全世界株式(オール・カンントリー)         | 361,302,337円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)      | 900,845円        |
| 三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド                | 12,482,471,986円 |
| eMAXIS 全世界株式インデックス                    | 2,625,321,235円  |
| eMAXIS バランス(4資産均等型)                   | 137,947,611円    |
| eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)             | 28,637,889円     |
| eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)             | 44,658,982円     |
| eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)            | 180,279,973円    |
| eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)               | 136,848,338円    |
| eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)              | 363,401,348円    |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)         | 46,457,559円     |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)         | 10,861,257,958円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)       | 165,916,282円    |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)       | 1,877,687,418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)        | 38,907,763,898円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定)       | 54,829,393円     |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)       | 17,393,735円     |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)         | 1,444,733,396円  |
| MSCIコクサイインデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)  | 3,167,117,406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)       | 8,758,136,579円  |
| アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)         | 38,899,759円     |
| アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)         | 223,630,677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) | 450,479,020円    |
| 世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)            | 38,894,447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)      | 1,419,717,519円  |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンド                  | 2,410,421,784円  |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA            | 1,729,956円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA          | 6,333,373円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA            | 8,209,620円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA            | 7,623,149円      |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA                | 54,963,316円     |



|   | [平成31年 1月28日現在]  |
|---|------------------|
| 三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）                | 15,537,213円      |
| 三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）                | 101,390,979円     |
| 三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）                | 20,808,138円      |
| 三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）                | 135,866,022円     |
| 三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド                  | 4,732,047,848円   |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド<br>（安定型）   | 173,375,889円     |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド<br>（安定成長型） | 675,685,431円     |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド<br>（成長型）   | 659,899,661円     |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド<br>（積極型）   | 589,440,607円     |
| 合計  | 126,097,074,687円 |
| 2. 受益権の総数                                 | 126,097,074,687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 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日  |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。   |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>  |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                         | [平成31年 1月28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<br>売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。<br>(2) デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。<br>(3) 上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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)

## 売買目的有価証券

| 種類   | [平成31年 1月28日現在]    |
|------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式   | 14,940,910,627     |
| 投資証券 | 236,005,548        |
| 合計   | 14,704,905,079     |

(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

[平成31年 1月28日現在]

| 区分   | 種類             | 契約額等(円)        |       | 時価(円)          | 評価損益(円)     |
|------|----------------|----------------|-------|----------------|-------------|
|      |                |                | うち1年超 |                |             |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 11,078,865,254 |       | 11,669,130,633 | 590,265,379 |
|      | 合計             | 11,078,865,254 |       | 11,669,130,633 | 590,265,379 |

(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

[平成31年 1月28日現在]

| 区分        | 種類           | 契約額等（円）     |       | 時価（円）       | 評価損益（円） |
|-----------|--------------|-------------|-------|-------------|---------|
|           |              |             | うち1年超 |             |         |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引<br>買建 |             |       |             |         |
|           | アメリカドル       | 257,091,810 |       | 256,929,500 | 162,310 |
|           | カナダドル        | 8,272,000   |       | 8,272,000   |         |
|           | イギリスポンド      | 28,819,100  |       | 28,868,000  | 48,900  |
|           | スイスフラン       | 11,015,350  |       | 11,015,000  | 350     |
|           | 香港ドル         | 9,757,860   |       | 9,751,000   | 6,860   |
|           | ユーロ          | 37,428,000  |       | 37,428,000  |         |
|           | 合計           | 352,384,120 |       | 352,263,500 | 120,620 |

## (注)時価の算定方法

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

## (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)

|              | [平成31年 1月28日現在] |
|--------------|-----------------|
| 1口当たり純資産額    | 2.5653円         |
| (1万口当たり純資産額) | (25,653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               | ANADARKO PETROLEUM CORP      | 42,251  | 46.89        | 1,981,149.39  |    |
|                      | ANTERO RESOURCES CORP        | 15,368  | 10.41        | 159,980.88    |    |
|                      | APACHE CORP                  | 31,070  | 32.06        | 996,104.20    |    |
|                      | BAKER HUGHES A GE CO         | 39,351  | 23.49        | 924,354.99    |    |
|                      | CABOT OIL & GAS CORP         | 35,092  | 25.91        | 909,233.72    |    |
|                      | CHENIERE ENERGY INC          | 17,755  | 63.55        | 1,128,330.25  |    |
|                      | CHEVRON CORP                 | 157,255 | 113.22       | 17,804,411.10 |    |
|                      | CIMAREX ENERGY CO            | 8,343   | 75.70        | 631,565.10    |    |
|                      | CONCHO RESOURCES INC         | 16,507  | 118.55       | 1,956,904.85  |    |
|                      | CONOCOPHILLIPS               | 95,555  | 66.99        | 6,401,229.45  |    |
|                      | CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 7,031   | 47.26        | 332,285.06    |    |
|                      | DEVON ENERGY CORP            | 40,521  | 27.25        | 1,104,197.25  |    |
|                      | DIAMONDBACK ENERGY INC       | 12,909  | 102.21       | 1,319,428.89  |    |
|                      | EOG RESOURCES INC            | 47,683  | 99.10        | 4,725,385.30  |    |
|                      | EXXON MOBIL CORP             | 347,477 | 71.72        | 24,921,050.44 |    |
|                      | HALLIBURTON CO               | 72,921  | 32.10        | 2,340,764.10  |    |
|                      | HELMERICH & PAYNE            | 8,879   | 53.42        | 474,316.18    |    |
|                      | HESS CORP                    | 21,577  | 53.10        | 1,145,738.70  |    |
|                      | HOLLYFRONTIER CORP           | 13,550  | 55.06        | 746,063.00    |    |
|                      | KINDER MORGAN INC            | 163,619 | 17.74        | 2,902,601.06  |    |
|                      | MARATHON OIL CORP            | 69,984  | 15.90        | 1,112,745.60  |    |
|                      | MARATHON PETROLEUM CORP      | 56,721  | 64.08        | 3,634,681.68  |    |
|                      | NATIONAL OILWELL VARCO INC   | 32,566  | 30.44        | 991,309.04    |    |
|                      | NOBLE ENERGY INC             | 41,322  | 21.93        | 906,191.46    |    |
|                      | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 62,795  | 66.53        | 4,177,751.35  |    |
|                      | ONEOK INC                    | 33,841  | 62.44        | 2,113,032.04  |    |
|                      | PARSLEY ENERGY INC-CLASS A   | 20,325  | 18.46        | 375,199.50    |    |
|                      | PHILLIPS 66                  | 36,222  | 93.02        | 3,369,370.44  |    |
|                      | PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 14,055  | 140.23       | 1,970,932.65  |    |
|                      | SCHLUMBERGER LTD             | 113,658 | 45.00        | 5,114,610.00  |    |
| TARGA RESOURCES CORP | 18,732                       | 42.55   | 797,046.60   |               |    |
| TECHNIPFMC PLC       | 36,699                       | 23.30   | 855,086.70   |               |    |
| VALERO ENERGY CORP   | 35,109                       | 82.19   | 2,885,608.71 |               |    |
| WILLIAMS COS INC     | 100,521                      | 26.67   | 2,680,895.07 |               |    |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 17,947  | 160.91 | 2,887,851.77  |
| ALBEMARLE CORP               | 8,903   | 76.58  | 681,791.74    |
| AVERY DENNISON CORP          | 7,313   | 97.20  | 710,823.60    |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD   | 16,209  | 25.55  | 414,139.95    |
| BALL CORP                    | 27,347  | 51.75  | 1,415,207.25  |
| CELANESE CORP                | 11,351  | 97.27  | 1,104,111.77  |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   | 19,934  | 42.55  | 848,191.70    |
| CHEMOURS CO/THE              | 13,587  | 35.73  | 485,463.51    |
| CROWN HOLDINGS INC           | 10,743  | 49.42  | 530,919.06    |
| DOWDUPONT INC                | 189,317 | 57.76  | 10,934,949.92 |
| EASTMAN CHEMICAL CO          | 11,427  | 80.86  | 923,987.22    |
| ECOLAB INC                   | 21,296  | 153.89 | 3,277,241.44  |
| FMC CORP                     | 10,954  | 79.37  | 869,418.98    |
| FREEMPORT-MCMORAN INC        | 114,096 | 11.24  | 1,282,439.04  |
| INTERNATIONAL PAPER CO       | 32,230  | 46.97  | 1,513,843.10  |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 6,805   | 137.80 | 937,729.00    |
| LINDE PLC                    | 45,174  | 158.84 | 7,175,438.16  |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 27,080  | 86.21  | 2,334,566.80  |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 5,008   | 175.70 | 879,905.60    |
| MOSAIC CO/THE                | 30,975  | 31.89  | 987,792.75    |
| NEWMONT MINING CORP          | 43,692  | 33.16  | 1,448,826.72  |
| NUCOR CORP                   | 26,163  | 58.10  | 1,520,070.30  |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | 7,676   | 94.26  | 723,539.76    |
| PPG INDUSTRIES INC           | 20,031  | 103.50 | 2,073,208.50  |
| SEALED AIR CORP              | 13,562  | 37.95  | 514,677.90    |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE      | 6,914   | 392.83 | 2,716,026.62  |
| STEEL DYNAMICS INC           | 20,151  | 35.44  | 714,151.44    |
| VULCAN MATERIALS CO          | 11,023  | 100.77 | 1,110,787.71  |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP       | 3,087   | 75.10  | 231,833.70    |
| WESTROCK CO                  | 21,765  | 42.29  | 920,441.85    |
| 3M CO                        | 48,121  | 195.90 | 9,426,903.90  |
| ACUITY BRANDS INC            | 3,210   | 118.79 | 381,315.90    |
| AERCAP HOLDINGS NV           | 9,672   | 46.99  | 454,487.28    |
| ALLEGION PLC                 | 7,694   | 84.19  | 647,757.86    |
| AMETEK INC                   | 19,192  | 71.32  | 1,368,773.44  |
| ARCONIC INC                  | 37,740  | 18.54  | 699,699.60    |
| BOEING CO/THE                | 44,781  | 364.20 | 16,309,240.20 |
| CATERPILLAR INC              | 48,769  | 136.86 | 6,674,525.34  |
| CUMMINS INC                  | 12,699  | 146.84 | 1,864,721.16  |
| DEERE & CO                   | 25,072  | 161.50 | 4,049,128.00  |
| DOVER CORP                   | 11,884  | 79.48  | 944,540.32    |
| EATON CORP PLC               | 35,414  | 71.07  | 2,516,872.98  |

|                              |         |        |              |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| EMERSON ELECTRIC CO          | 51,457  | 63.94  | 3,290,160.58 |
| FASTENAL CO                  | 23,062  | 59.53  | 1,372,880.86 |
| FLOWSERVE CORP               | 10,204  | 42.76  | 436,323.04   |
| FLUOR CORP                   | 11,662  | 37.32  | 435,225.84   |
| FORTIVE CORP                 | 24,579  | 72.25  | 1,775,832.75 |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI | 12,083  | 41.95  | 506,881.85   |
| GENERAL DYNAMICS CORP        | 20,628  | 171.22 | 3,531,926.16 |
| GENERAL ELECTRIC CO          | 713,414 | 9.16   | 6,534,872.24 |
| HARRIS CORP                  | 9,814   | 143.48 | 1,408,112.72 |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC       | 13,461  | 40.72  | 548,131.92   |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | 60,840  | 141.71 | 8,621,636.40 |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 3,449   | 202.08 | 696,973.92   |
| IDEX CORP                    | 6,420   | 137.26 | 881,209.20   |
| ILLINOIS TOOL WORKS          | 24,737  | 133.25 | 3,296,205.25 |
| INGERSOLL-RAND PLC           | 20,073  | 94.47  | 1,896,296.31 |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 9,760   | 63.77  | 622,395.20   |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   | 17,800  | 66.01  | 1,174,978.00 |
| JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD  | 18,100  | 37.84  | 684,904.00   |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 76,627  | 32.71  | 2,506,469.17 |
| L3 TECHNOLOGIES INC          | 6,323   | 184.49 | 1,166,530.27 |
| LENNOX INTERNATIONAL INC     | 3,070   | 224.30 | 688,601.00   |
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 21,013  | 287.04 | 6,031,571.52 |
| MASCO CORP                   | 25,772  | 31.62  | 814,910.64   |
| MIDDLEBY CORP                | 4,709   | 117.00 | 550,953.00   |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 13,561  | 272.84 | 3,699,983.24 |
| OWENS CORNING                | 8,305   | 48.31  | 401,214.55   |
| PACCAR INC                   | 28,702  | 62.69  | 1,799,328.38 |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 10,855  | 160.99 | 1,747,546.45 |
| PENTAIR PLC                  | 14,686  | 41.06  | 603,007.16   |
| RAYTHEON COMPANY             | 23,361  | 167.61 | 3,915,537.21 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 10,253  | 166.36 | 1,705,689.08 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       | 8,458   | 283.15 | 2,394,882.70 |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 14,145  | 47.29  | 668,917.05   |
| SMITH (A.O.) CORP            | 11,803  | 47.60  | 561,822.80   |
| SNAP-ON INC                  | 4,806   | 163.22 | 784,435.32   |
| SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A | 8,426   | 79.70  | 671,552.20   |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   | 12,599  | 120.58 | 1,519,187.42 |
| TEXTRON INC                  | 19,864  | 52.60  | 1,044,846.40 |
| TRANSDIGM GROUP INC          | 3,898   | 351.86 | 1,371,550.28 |
| UNITED RENTALS INC           | 7,024   | 127.26 | 893,874.24   |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP     | 67,100  | 115.81 | 7,770,851.00 |
| WABCO HOLDINGS INC           | 4,664   | 112.55 | 524,933.20   |

|                             |         |        |              |
|-----------------------------|---------|--------|--------------|
| WABTEC CORP                 | 6,726   | 68.54  | 461,000.04   |
| WW GRAINGER INC             | 3,863   | 291.83 | 1,127,339.29 |
| XYLEM INC                   | 14,613  | 69.86  | 1,020,864.18 |
| CINTAS CORP                 | 7,506   | 184.98 | 1,388,459.88 |
| COPART INC                  | 17,867  | 50.08  | 894,779.36   |
| COSTAR GROUP INC            | 3,062   | 384.01 | 1,175,838.62 |
| EQUIFAX INC                 | 10,163  | 105.63 | 1,073,517.69 |
| IHS MARKIT LTD              | 32,046  | 51.52  | 1,651,009.92 |
| MANPOWERGROUP INC           | 5,311   | 74.74  | 396,944.14   |
| NIELSEN HOLDINGS PLC        | 30,106  | 25.68  | 773,122.08   |
| REPUBLIC SERVICES INC       | 18,926  | 76.24  | 1,442,918.24 |
| ROBERT HALF INTL INC        | 10,058  | 60.99  | 613,437.42   |
| ROLLINS INC                 | 11,100  | 38.13  | 423,243.00   |
| TRANSUNION                  | 14,660  | 60.37  | 885,024.20   |
| VERISK ANALYTICS INC        | 12,714  | 117.24 | 1,490,589.36 |
| WASTE CONNECTIONS INC       | 21,543  | 80.98  | 1,744,552.14 |
| WASTE MANAGEMENT INC        | 35,077  | 94.90  | 3,328,807.30 |
| AMERCO                      | 657     | 351.77 | 231,112.89   |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 9,768   | 34.98  | 341,684.64   |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 11,769  | 87.05  | 1,024,491.45 |
| CSX CORP                    | 66,921  | 66.20  | 4,430,170.20 |
| DELTA AIR LINES INC         | 14,988  | 47.69  | 714,777.72   |
| EXPEDITORS INTL WASH INC    | 14,585  | 69.33  | 1,011,178.05 |
| FEDEX CORP                  | 20,604  | 175.36 | 3,613,117.44 |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 7,468   | 104.36 | 779,360.48   |
| KANSAS CITY SOUTHERN        | 8,569   | 108.91 | 933,249.79   |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION | 10,111  | 30.78  | 311,216.58   |
| NORFOLK SOUTHERN CORP       | 22,952  | 165.12 | 3,789,834.24 |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE   | 5,220   | 134.56 | 702,403.20   |
| RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR | 2,000   | 69.96  | 139,920.00   |
| SOUTHWEST AIRLINES CO       | 11,118  | 54.98  | 611,267.64   |
| UNION PACIFIC CORP          | 60,648  | 160.95 | 9,761,295.60 |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS | 5,859   | 84.14  | 492,976.26   |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B  | 56,913  | 100.83 | 5,738,537.79 |
| XPO LOGISTICS INC           | 9,725   | 62.13  | 604,214.25   |
| APTIV PLC                   | 21,834  | 73.00  | 1,593,882.00 |
| AUTOLIV INC                 | 6,972   | 80.97  | 564,522.84   |
| BORGWARNER INC              | 17,531  | 40.98  | 718,420.38   |
| FORD MOTOR CO               | 306,751 | 8.86   | 2,717,813.86 |
| GENERAL MOTORS CO           | 104,297 | 38.64  | 4,030,036.08 |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO   | 19,139  | 20.53  | 392,923.67   |
| HARLEY-DAVIDSON INC         | 13,910  | 36.88  | 513,000.80   |

|                              |         |          |               |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| LEAR CORP                    | 5,109   | 158.79   | 811,258.11    |
| TESLA INC                    | 10,509  | 297.04   | 3,121,593.36  |
| CAPRI HOLDINGS LTD           | 11,382  | 42.41    | 482,710.62    |
| DR HORTON INC                | 29,934  | 37.30    | 1,116,538.20  |
| GARMIN LTD                   | 9,485   | 68.58    | 650,481.30    |
| HANESBRANDS INC              | 26,627  | 15.20    | 404,730.40    |
| HASBRO INC                   | 10,186  | 90.13    | 918,064.18    |
| LEGGETT & PLATT INC          | 9,839   | 39.97    | 393,264.83    |
| LENNAR CORP-A                | 24,203  | 44.56    | 1,078,485.68  |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 8,431   | 151.89   | 1,280,584.59  |
| MATTEL INC                   | 24,774  | 12.43    | 307,940.82    |
| MOHAWK INDUSTRIES INC        | 4,889   | 127.56   | 623,640.84    |
| NEWELL BRANDS INC            | 37,442  | 21.32    | 798,263.44    |
| NIKE INC -CL B               | 105,035 | 80.61    | 8,466,871.35  |
| NVR INC                      | 287     | 2,517.06 | 722,396.22    |
| POLARIS INDUSTRIES INC       | 4,436   | 87.11    | 386,419.96    |
| PULTEGROUP INC               | 22,982  | 26.96    | 619,594.72    |
| PVH CORP                     | 6,275   | 108.37   | 680,021.75    |
| RALPH LAUREN CORP            | 4,173   | 113.64   | 474,219.72    |
| TAPESTRY INC                 | 24,591  | 37.50    | 922,162.50    |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A     | 13,777  | 21.44    | 295,378.88    |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C     | 17,239  | 19.49    | 335,988.11    |
| VF CORP                      | 28,150  | 83.50    | 2,350,525.00  |
| WHIRLPOOL CORP               | 5,647   | 125.07   | 706,270.29    |
| ARAMARK                      | 20,664  | 32.51    | 671,786.64    |
| CARNIVAL CORP                | 34,672  | 55.51    | 1,924,642.72  |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 2,087   | 543.37   | 1,134,013.19  |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 10,355  | 106.43   | 1,102,082.65  |
| DOMINO'S PIZZA INC           | 3,212   | 284.16   | 912,721.92    |
| H&R BLOCK INC                | 18,342  | 25.91    | 475,241.22    |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 23,227  | 71.76    | 1,666,769.52  |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 32,290  | 56.95    | 1,838,915.50  |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 24,167  | 109.85   | 2,654,744.95  |
| MCDONALD'S CORP              | 63,625  | 184.00   | 11,707,000.00 |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR   | 18,377  | 21.64    | 397,678.28    |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 42,520  | 28.70    | 1,220,324.00  |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN | 18,122  | 47.93    | 868,587.46    |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 13,889  | 111.74   | 1,551,956.86  |
| STARBUCKS CORP               | 110,635 | 67.09    | 7,422,502.15  |
| VAIL RESORTS INC             | 3,238   | 183.90   | 595,468.20    |
| WYNN RESORTS LTD             | 8,302   | 118.53   | 984,036.06    |
| YUM! BRANDS INC              | 25,975  | 92.71    | 2,408,142.25  |



|                               |         |          |               |
|-------------------------------|---------|----------|---------------|
| ACTIVISION BLIZZARD INC       | 59,401  | 47.80    | 2,839,367.80  |
| ALPHABET INC-CL A             | 24,533  | 1,101.51 | 27,023,344.83 |
| ALPHABET INC-CL C             | 25,833  | 1,090.99 | 28,183,544.67 |
| CBS CORP-CLASS B NON VOTING   | 28,020  | 49.17    | 1,377,743.40  |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A  | 13,328  | 291.41   | 3,883,912.48  |
| COMCAST CORP-CLASS A          | 375,200 | 35.78    | 13,424,656.00 |
| DISCOVERY INC - A             | 12,579  | 27.68    | 348,186.72    |
| DISCOVERY INC-C               | 26,507  | 25.77    | 683,085.39    |
| DISH NETWORK CORP-A           | 18,217  | 30.08    | 547,967.36    |
| ELECTRONIC ARTS INC           | 24,985  | 91.74    | 2,292,123.90  |
| FACEBOOK INC-CLASS A          | 197,892 | 149.01   | 29,487,886.92 |
| IAC/INTERACTIVECORP           | 6,463   | 211.36   | 1,366,019.68  |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC  | 31,846  | 22.41    | 713,668.86    |
| LIBERTY BROADBAND-C           | 8,866   | 74.94    | 664,418.04    |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C         | 42,571  | 22.35    | 951,461.85    |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A          | 14,529  | 23.15    | 336,346.35    |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A  | 7,102   | 38.67    | 274,634.34    |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C  | 15,261  | 38.84    | 592,737.24    |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C  | 16,786  | 31.25    | 524,562.50    |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN  | 11,884  | 53.39    | 634,486.76    |
| NETFLIX INC                   | 35,747  | 338.05   | 12,084,273.35 |
| NEWS CORP - CLASS A           | 28,536  | 12.69    | 362,121.84    |
| OMNICOM GROUP                 | 18,406  | 76.40    | 1,406,218.40  |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC        | 132,166 | 5.82     | 769,206.12    |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 9,367   | 103.70   | 971,357.90    |
| TRIPADVISOR INC               | 8,162   | 57.23    | 467,111.26    |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B  | 35,943  | 48.97    | 1,760,128.71  |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A    | 86,554  | 49.24    | 4,261,918.96  |
| TWITTER INC                   | 54,703  | 32.90    | 1,799,728.70  |
| VIACOM INC-CLASS B            | 30,124  | 28.99    | 873,294.76    |
| WALT DISNEY CO/THE            | 122,018 | 111.09   | 13,554,979.62 |
| ZILLOW GROUP INC - C          | 9,580   | 32.55    | 311,829.00    |
| ADVANCE AUTO PARTS INC        | 6,244   | 153.22   | 956,705.68    |
| AMAZON.COM INC                | 34,024  | 1,670.57 | 56,839,473.68 |
| AUTOZONE INC                  | 2,165   | 814.64   | 1,763,695.60  |
| BEST BUY CO INC               | 20,839  | 59.34    | 1,236,586.26  |
| BOOKING HOLDINGS INC          | 3,894   | 1,802.20 | 7,017,766.80  |
| BURLINGTON STORES INC         | 5,400   | 167.99   | 907,146.00    |
| CARMAX INC                    | 14,978  | 60.31    | 903,323.18    |
| DOLLAR GENERAL CORP           | 21,729  | 114.20   | 2,481,451.80  |
| DOLLAR TREE INC               | 19,490  | 96.92    | 1,888,970.80  |
| EBAY INC                      | 77,094  | 33.72    | 2,599,609.68  |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| EXPEDIA GROUP INC            | 10,053  | 117.11 | 1,177,306.83  |
| GAP INC/THE                  | 19,267  | 25.68  | 494,776.56    |
| GENUINE PARTS CO             | 11,834  | 96.80  | 1,145,531.20  |
| GRUBHUB INC                  | 7,161   | 80.77  | 578,393.97    |
| HOME DEPOT INC               | 93,866  | 180.40 | 16,933,426.40 |
| KOHL'S CORP                  | 14,104  | 70.70  | 997,152.80    |
| L BRANDS INC                 | 20,700  | 27.65  | 572,355.00    |
| LKQ CORP                     | 25,950  | 26.08  | 676,776.00    |
| LOWE'S COS INC               | 66,517  | 93.82  | 6,240,624.94  |
| MACY'S INC                   | 26,297  | 25.51  | 670,836.47    |
| MERCADOLIBRE INC             | 3,430   | 342.88 | 1,176,078.40  |
| NORDSTROM INC                | 9,614   | 47.08  | 452,627.12    |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 6,606   | 337.44 | 2,229,128.64  |
| QURATE RETAIL INC            | 35,552  | 21.61  | 768,278.72    |
| ROSS STORES INC              | 30,837  | 92.51  | 2,852,730.87  |
| TARGET CORP                  | 40,967  | 72.39  | 2,965,601.13  |
| TIFFANY & CO                 | 8,668   | 88.88  | 770,411.84    |
| TJX COMPANIES INC            | 101,675 | 48.87  | 4,968,857.25  |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY       | 10,349  | 89.60  | 927,270.40    |
| ULTA BEAUTY INC              | 4,717   | 290.72 | 1,371,326.24  |
| WAYFAIR INC- CLASS A         | 4,501   | 102.19 | 459,957.19    |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 35,955  | 209.07 | 7,517,111.85  |
| DAIRY FARM INTL HLDGS LTD    | 27,000  | 9.48   | 255,960.00    |
| KROGER CO                    | 65,729  | 28.12  | 1,848,299.48  |
| SYSCO CORP                   | 40,433  | 62.02  | 2,507,654.66  |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 69,129  | 71.89  | 4,969,683.81  |
| WALMART INC                  | 120,972 | 96.94  | 11,727,025.68 |
| ALTRIA GROUP INC             | 154,594 | 44.24  | 6,839,238.56  |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    | 45,741  | 43.72  | 1,999,796.52  |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    | 22,312  | 45.50  | 1,015,196.00  |
| BUNGE LTD                    | 12,099  | 53.29  | 644,755.71    |
| CAMPBELL SOUP CO             | 14,637  | 34.24  | 501,170.88    |
| COCA-COLA CO/THE             | 331,341 | 47.37  | 15,695,623.17 |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS  | 17,043  | 45.08  | 768,298.44    |
| CONAGRA BRANDS INC           | 38,359  | 21.01  | 805,922.59    |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 13,869  | 166.80 | 2,313,349.20  |
| GENERAL MILLS INC            | 49,789  | 43.29  | 2,155,365.81  |
| HERSHEY CO/THE               | 11,625  | 104.30 | 1,212,487.50  |
| HORMEL FOODS CORP            | 24,534  | 41.46  | 1,017,179.64  |
| INGREDION INC                | 6,169   | 97.31  | 600,305.39    |
| JM SMUCKER CO/THE            | 9,187   | 101.44 | 931,929.28    |
| KELLOGG CO                   | 21,585  | 57.78  | 1,247,181.30  |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| KRAFT HEINZ CO/THE           | 50,298  | 46.75  | 2,351,431.50  |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC     | 11,599  | 71.10  | 824,688.90    |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 9,735   | 121.36 | 1,181,439.60  |
| MOLSON COORS BREWING CO -B   | 15,747  | 64.40  | 1,014,106.80  |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 120,172 | 42.72  | 5,133,747.84  |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 34,264  | 55.85  | 1,913,644.40  |
| PEPSICO INC                  | 116,003 | 109.35 | 12,684,928.05 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 127,527 | 72.73  | 9,275,038.71  |
| TYSON FOODS INC-CL A         | 24,225  | 60.72  | 1,470,942.00  |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 20,218  | 63.59  | 1,285,662.62  |
| CLOROX COMPANY               | 10,506  | 147.69 | 1,551,631.14  |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 67,643  | 61.84  | 4,183,043.12  |
| COTY INC-CL A                | 40,836  | 7.31   | 298,511.16    |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 18,381  | 128.07 | 2,354,054.67  |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 28,521  | 108.12 | 3,083,690.52  |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 204,188 | 93.60  | 19,111,996.80 |
| ABBOTT LABORATORIES          | 143,939 | 71.15  | 10,241,259.85 |
| ABIOMED INC                  | 3,522   | 349.37 | 1,230,481.14  |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | 6,165   | 227.22 | 1,400,811.30  |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 13,797  | 79.66  | 1,099,069.02  |
| ANTHEM INC                   | 21,316  | 272.68 | 5,812,446.88  |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     | 41,641  | 70.33  | 2,928,611.53  |
| BECTON DICKINSON AND CO      | 21,951  | 243.06 | 5,335,410.06  |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       | 113,463 | 37.45  | 4,249,189.35  |
| CARDINAL HEALTH INC          | 25,673  | 49.35  | 1,266,962.55  |
| CENTENE CORP                 | 17,116  | 129.00 | 2,207,964.00  |
| CERNER CORP                  | 24,322  | 54.90  | 1,335,277.80  |
| CIGNA CORP                   | 31,184  | 196.28 | 6,120,795.52  |
| COOPER COS INC/THE           | 4,064   | 275.61 | 1,120,079.04  |
| CVS HEALTH CORP              | 106,045 | 65.45  | 6,940,645.25  |
| DANAHER CORP                 | 51,650  | 106.33 | 5,491,944.50  |
| DAVITA INC                   | 10,326  | 57.09  | 589,511.34    |
| DENTSPLY SIRONA INC          | 18,574  | 41.41  | 769,149.34    |
| DEXCOM INC                   | 6,966   | 145.01 | 1,010,139.66  |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP    | 17,189  | 170.64 | 2,933,130.96  |
| HCA HEALTHCARE INC           | 22,719  | 132.90 | 3,019,355.10  |
| HENRY SCHEIN INC             | 12,952  | 77.25  | 1,000,542.00  |
| HOLOGIC INC                  | 22,983  | 44.83  | 1,030,327.89  |
| HUMANA INC                   | 11,299  | 300.68 | 3,397,383.32  |
| IDEXX LABORATORIES INC       | 7,137   | 208.85 | 1,490,562.45  |
| INTUITIVE SURGICAL INC       | 9,337   | 515.04 | 4,808,928.48  |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 8,538   | 137.40 | 1,173,121.20  |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| MCKESSON CORP                | 16,401  | 127.05 | 2,083,747.05  |
| MEDTRONIC PLC                | 110,769 | 87.02  | 9,639,118.38  |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 10,904  | 85.41  | 931,310.64    |
| RESMED INC                   | 11,759  | 94.56  | 1,111,931.04  |
| STRYKER CORP                 | 27,609  | 165.76 | 4,576,467.84  |
| TELEFLEX INC                 | 3,631   | 268.83 | 976,121.73    |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 78,967  | 268.05 | 21,167,104.35 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 7,356   | 131.14 | 964,665.84    |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC   | 7,519   | 130.96 | 984,688.24    |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    | 9,973   | 109.20 | 1,089,051.60  |
| WELLCARE HEALTH PLANS INC    | 3,956   | 275.13 | 1,088,414.28  |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 16,379  | 107.41 | 1,759,268.39  |
| ABBVIE INC                   | 124,293 | 80.54  | 10,010,558.22 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 26,214  | 73.65  | 1,930,661.10  |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 18,676  | 121.44 | 2,268,013.44  |
| ALKERMES PLC                 | 12,980  | 34.07  | 442,228.60    |
| ALLERGAN PLC                 | 27,854  | 160.66 | 4,475,023.64  |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 6,993   | 83.05  | 580,768.65    |
| AMGEN INC                    | 53,125  | 198.77 | 10,559,656.25 |
| BEIGENE LTD-ADR              | 2,558   | 126.13 | 322,640.54    |
| BIOGEN INC                   | 16,534  | 336.77 | 5,568,155.18  |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 14,236  | 95.44  | 1,358,683.84  |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 133,925 | 48.93  | 6,552,950.25  |
| CELGENE CORP                 | 57,761  | 87.62  | 5,061,018.82  |
| ELI LILLY & CO               | 79,317  | 114.97 | 9,119,075.49  |
| GILEAD SCIENCES INC          | 106,407 | 68.90  | 7,331,442.30  |
| ILLUMINA INC                 | 12,072  | 293.88 | 3,547,719.36  |
| INCYTE CORP                  | 14,869  | 79.95  | 1,188,776.55  |
| IQVIA HOLDINGS INC           | 13,124  | 125.98 | 1,653,361.52  |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC     | 5,035   | 126.93 | 639,092.55    |
| JOHNSON & JOHNSON            | 220,136 | 128.23 | 28,228,039.28 |
| MERCK & CO. INC.             | 218,224 | 72.95  | 15,919,440.80 |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 2,050   | 614.55 | 1,259,827.50  |
| MYLAN NV                     | 41,536  | 29.04  | 1,206,205.44  |
| NEKTAR THERAPEUTICS          | 13,315  | 43.92  | 584,794.80    |
| PERRIGO CO PLC               | 10,460  | 45.90  | 480,114.00    |
| PFIZER INC                   | 480,988 | 40.64  | 19,547,352.32 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 6,567   | 418.29 | 2,746,910.43  |
| SEATTLE GENETICS INC         | 9,288   | 72.74  | 675,609.12    |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   | 79,575  | 19.56  | 1,556,487.00  |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 33,060  | 240.90 | 7,964,154.00  |
| UNITED THERAPEUTICS CORP     | 3,363   | 115.93 | 389,872.59    |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 20,981  | 189.50 | 3,975,899.50  |
| WATERS CORP                  | 6,378   | 229.16 | 1,461,582.48  |
| ZOETIS INC                   | 39,579  | 84.69  | 3,351,945.51  |
| BANK OF AMERICA CORP         | 778,338 | 29.58  | 23,023,238.04 |
| BB&T CORP                    | 63,353  | 49.37  | 3,127,737.61  |
| CIT GROUP INC                | 9,372   | 44.25  | 414,711.00    |
| CITIGROUP INC                | 206,384 | 64.02  | 13,212,703.68 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 39,777  | 35.44  | 1,409,696.88  |
| COMERICA INC                 | 13,971  | 82.07  | 1,146,599.97  |
| EAST WEST BANCORP INC        | 11,889  | 52.36  | 622,508.04    |
| FIFTH THIRD BANCORP          | 56,073  | 27.78  | 1,557,707.94  |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA       | 13,502  | 97.12  | 1,311,314.24  |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC    | 92,275  | 13.55  | 1,250,326.25  |
| JPMORGAN CHASE & CO          | 275,705 | 103.39 | 28,505,139.95 |
| KEYCORP                      | 87,480  | 16.81  | 1,470,538.80  |
| M & T BANK CORP              | 11,235  | 168.31 | 1,890,962.85  |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL    | 32,704  | 16.75  | 547,792.00    |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 38,048  | 124.92 | 4,752,956.16  |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 92,694  | 15.65  | 1,450,661.10  |
| SIGNATURE BANK               | 4,475   | 125.93 | 563,536.75    |
| SUNTRUST BANKS INC           | 37,649  | 61.90  | 2,330,473.10  |
| SVB FINANCIAL GROUP          | 4,278   | 242.09 | 1,035,661.02  |
| US BANCORP                   | 126,745 | 51.37  | 6,510,890.65  |
| WELLS FARGO & CO             | 375,320 | 50.13  | 18,814,791.60 |
| ZIONS BANCORP NA             | 14,853  | 48.68  | 723,044.04    |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP    | 4,013   | 109.62 | 439,905.06    |
| ALLY FINANCIAL INC           | 33,184  | 25.77  | 855,151.68    |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 60,048  | 100.77 | 6,051,036.96  |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 11,899  | 121.12 | 1,441,206.88  |
| AXA EQUITABLE HOLDINGS INC   | 18,600  | 18.65  | 346,890.00    |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 81,965  | 53.40  | 4,376,931.00  |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 106,448 | 202.75 | 21,582,332.00 |
| BLACKROCK INC                | 9,816   | 409.95 | 4,024,069.20  |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 39,202  | 79.62  | 3,121,263.24  |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC      | 9,355   | 96.03  | 898,360.65    |
| CME GROUP INC                | 29,285  | 185.94 | 5,445,252.90  |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | 28,225  | 66.73  | 1,883,454.25  |
| E*TRADE FINANCIAL CORP       | 21,199  | 47.77  | 1,012,676.23  |
| EATON VANCE CORP             | 10,791  | 39.79  | 429,373.89    |
| FRANKLIN RESOURCES INC       | 26,923  | 31.59  | 850,497.57    |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      | 29,444  | 200.74 | 5,910,588.56  |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 46,961  | 75.76  | 3,557,765.36  |

|                              |         |          |              |
|------------------------------|---------|----------|--------------|
| INVESCO LTD                  | 33,181  | 19.02    | 631,102.62   |
| JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN | 25,624  | 20.37    | 521,960.88   |
| MOODY'S CORP                 | 14,200  | 156.53   | 2,222,726.00 |
| MORGAN STANLEY               | 107,422 | 42.98    | 4,616,997.56 |
| MSCI INC                     | 7,210   | 163.83   | 1,181,214.30 |
| NASDAQ INC                   | 9,700   | 85.69    | 831,193.00   |
| NORTHERN TRUST CORP          | 17,470  | 91.13    | 1,592,041.10 |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | 10,668  | 81.06    | 864,748.08   |
| S&P GLOBAL INC               | 20,646  | 189.31   | 3,908,494.26 |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 99,780  | 47.97    | 4,786,446.60 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | 11,604  | 49.30    | 572,077.20   |
| STATE STREET CORP            | 31,139  | 72.64    | 2,261,936.96 |
| SYNCHRONY FINANCIAL          | 58,589  | 29.79    | 1,745,366.31 |
| T ROWE PRICE GROUP INC       | 19,563  | 94.55    | 1,849,681.65 |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP   | 23,546  | 56.26    | 1,324,697.96 |
| VOYA FINANCIAL INC           | 13,039  | 46.74    | 609,442.86   |
| AFLAC INC                    | 62,861  | 47.57    | 2,990,297.77 |
| ALLEGHANY CORP               | 1,277   | 618.33   | 789,607.41   |
| ALLSTATE CORP                | 28,330  | 86.15    | 2,440,629.50 |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 5,983   | 94.75    | 566,889.25   |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 72,907  | 43.18    | 3,148,124.26 |
| AON PLC                      | 19,900  | 154.39   | 3,072,361.00 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       | 31,704  | 28.83    | 914,026.32   |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      | 14,935  | 73.50    | 1,097,722.50 |
| ASSURANT INC                 | 4,061   | 95.24    | 386,769.64   |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A   | 12,328  | 42.87    | 528,501.36   |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC    | 9,073   | 37.67    | 341,779.91   |
| CHUBB LTD                    | 37,961  | 132.29   | 5,021,860.69 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    | 12,956  | 79.35    | 1,028,058.60 |
| EVEREST RE GROUP LTD         | 3,429   | 213.42   | 731,817.18   |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL  | 21,662  | 35.11    | 760,552.82   |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP  | 29,524  | 46.76    | 1,380,542.24 |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 17,714  | 59.49    | 1,053,805.86 |
| LOEWS CORP                   | 22,852  | 47.79    | 1,092,097.08 |
| MARKEL CORP                  | 1,130   | 1,038.74 | 1,173,776.20 |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 41,400  | 83.52    | 3,457,728.00 |
| METLIFE INC                  | 69,344  | 45.47    | 3,153,071.68 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 23,316  | 50.08    | 1,167,665.28 |
| PROGRESSIVE CORP             | 47,792  | 65.30    | 3,120,817.60 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 34,214  | 92.91    | 3,178,822.74 |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 5,414   | 148.44   | 803,654.16   |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD   | 3,165   | 133.05   | 421,103.25   |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| TORCHMARK CORP               | 8,220   | 83.27  | 684,479.40    |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 21,926  | 124.98 | 2,740,311.48  |
| UNUM GROUP                   | 16,863  | 34.37  | 579,581.31    |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 10,735  | 158.69 | 1,703,537.15  |
| WR BERKLEY CORP              | 7,865   | 75.00  | 589,875.00    |
| CBRE GROUP INC - A           | 26,006  | 44.65  | 1,161,167.90  |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | 94,100  | 7.07   | 665,287.00    |
| JONES LANG LASALLE INC       | 3,625   | 140.75 | 510,218.75    |
| SBA COMMUNICATIONS CORP      | 9,445   | 177.27 | 1,674,315.15  |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 52,457  | 151.85 | 7,965,595.45  |
| ADOBE INC                    | 40,160  | 244.95 | 9,837,192.00  |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC      | 14,312  | 65.44  | 936,577.28    |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP   | 3,799   | 177.71 | 675,120.29    |
| ANSYS INC                    | 6,732   | 161.65 | 1,088,227.80  |
| AUTODESK INC                 | 18,146  | 142.08 | 2,578,183.68  |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING    | 35,881  | 136.41 | 4,894,527.21  |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 9,612   | 101.84 | 978,886.08    |
| CADENCE DESIGN SYS INC       | 22,558  | 46.59  | 1,050,977.22  |
| CDK GLOBAL INC               | 9,355   | 51.39  | 480,753.45    |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    | 10,512  | 107.99 | 1,135,190.88  |
| CITRIX SYSTEMS INC           | 11,297  | 102.65 | 1,159,637.05  |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 47,505  | 70.02  | 3,326,300.10  |
| DXC TECHNOLOGY CO            | 23,245  | 63.34  | 1,472,338.30  |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV  | 26,934  | 105.43 | 2,839,651.62  |
| FIRST DATA CORP- CLASS A     | 42,989  | 25.11  | 1,079,453.79  |
| FISERV INC                   | 33,495  | 85.07  | 2,849,419.65  |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC    | 7,295   | 199.77 | 1,457,322.15  |
| FORTINET INC                 | 12,219  | 73.59  | 899,196.21    |
| GARTNER INC                  | 7,715   | 131.87 | 1,017,377.05  |
| GLOBAL PAYMENTS INC          | 13,135  | 113.23 | 1,487,276.05  |
| GODADDY INC - CLASS A        | 14,206  | 66.40  | 943,278.40    |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP  | 74,851  | 133.97 | 10,027,788.47 |
| INTUIT INC                   | 19,970  | 214.30 | 4,279,571.00  |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC  | 5,985   | 132.45 | 792,713.25    |
| LEIDOS HOLDINGS INC          | 12,335  | 57.05  | 703,711.75    |
| MASTERCARD INC - A           | 75,649  | 202.94 | 15,352,208.06 |
| MICROSOFT CORP               | 597,733 | 107.17 | 64,059,045.61 |
| ORACLE CORP                  | 244,840 | 49.80  | 12,193,032.00 |
| PALO ALTO NETWORKS INC       | 7,567   | 209.72 | 1,586,951.24  |
| PAYCHEX INC                  | 26,342  | 70.39  | 1,854,213.38  |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 92,225  | 94.28  | 8,694,973.00  |
| PTC INC                      | 8,871   | 81.45  | 722,542.95    |

|                            |         |        |               |
|----------------------------|---------|--------|---------------|
| RED HAT INC                | 14,650  | 176.50 | 2,585,725.00  |
| SABRE CORP                 | 22,958  | 23.02  | 528,493.16    |
| SALESFORCE.COM INC         | 58,959  | 149.74 | 8,828,520.66  |
| SERVICENOW INC             | 14,587  | 191.08 | 2,787,283.96  |
| SPLUNK INC                 | 11,981  | 122.06 | 1,462,400.86  |
| SQUARE INC - A             | 25,185  | 77.97  | 1,963,674.45  |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 18,176  | 50.68  | 921,159.68    |
| SYMANTEC CORP              | 49,501  | 20.38  | 1,008,830.38  |
| SYNOPSYS INC               | 12,366  | 93.55  | 1,156,839.30  |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC  | 13,449  | 88.31  | 1,187,681.19  |
| VERISIGN INC               | 9,148   | 165.96 | 1,518,202.08  |
| VISA INC-CLASS A SHARES    | 145,686 | 138.67 | 20,202,277.62 |
| VMWARE INC-CLASS A         | 6,280   | 149.43 | 938,420.40    |
| WESTERN UNION CO           | 38,397  | 18.23  | 699,977.31    |
| WIX.COM LTD                | 3,400   | 106.52 | 362,168.00    |
| WORKDAY INC-CLASS A        | 11,997  | 175.58 | 2,106,433.26  |
| WORLDPAY INC-CLASS A       | 24,928  | 83.20  | 2,074,009.60  |
| AMPHENOL CORP-CL A         | 24,661  | 86.30  | 2,128,244.30  |
| APPLE INC                  | 396,389 | 157.76 | 62,534,328.64 |
| ARISTA NETWORKS INC        | 4,346   | 227.26 | 987,671.96    |
| ARROW ELECTRONICS INC      | 6,674   | 75.57  | 504,354.18    |
| CDW CORP/DE                | 12,702  | 81.96  | 1,041,055.92  |
| CISCO SYSTEMS INC          | 385,835 | 46.13  | 17,798,568.55 |
| COGNEX CORP                | 15,243  | 43.77  | 667,186.11    |
| COMMSCOPE HOLDING CO INC   | 16,514  | 19.04  | 314,426.56    |
| CORNING INC                | 67,016  | 30.36  | 2,034,605.76  |
| DELL TECHNOLOGIES -C       | 10,404  | 45.91  | 477,647.64    |
| F5 NETWORKS INC            | 5,179   | 158.50 | 820,871.50    |
| FLEX LTD                   | 43,666  | 8.78   | 383,387.48    |
| FLIR SYSTEMS INC           | 10,640  | 46.91  | 499,122.40    |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE | 123,970 | 15.35  | 1,902,939.50  |
| HP INC                     | 129,943 | 22.10  | 2,871,740.30  |
| IPG PHOTONICS CORP         | 3,076   | 135.30 | 416,182.80    |
| JUNIPER NETWORKS INC       | 27,024  | 28.38  | 766,941.12    |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN   | 15,106  | 71.07  | 1,073,583.42  |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC     | 13,324  | 116.18 | 1,547,982.32  |
| NETAPP INC                 | 20,688  | 63.73  | 1,318,446.24  |
| SEAGATE TECHNOLOGY         | 23,082  | 43.66  | 1,007,760.12  |
| TE CONNECTIVITY LTD        | 28,607  | 80.15  | 2,292,851.05  |
| TRIMBLE INC                | 21,386  | 37.22  | 795,986.92    |
| WESTERN DIGITAL CORP       | 23,030  | 43.16  | 993,974.80    |
| XEROX CORP                 | 19,653  | 24.54  | 482,284.62    |



|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| AT&T INC                     | 595,697 | 30.66  | 18,264,070.02 |
| CENTURYLINK INC              | 80,155  | 14.99  | 1,201,523.45  |
| SPRINT CORP                  | 72,427  | 6.18   | 447,598.86    |
| T-MOBILE US INC              | 27,775  | 68.48  | 1,902,032.00  |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 338,948 | 56.40  | 19,116,667.20 |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC      | 17,058  | 26.70  | 455,448.60    |
| AES CORP                     | 53,205  | 15.88  | 844,895.40    |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 18,845  | 43.10  | 812,219.50    |
| AMEREN CORPORATION           | 19,919  | 67.94  | 1,353,296.86  |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 40,566  | 76.80  | 3,115,468.80  |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 14,617  | 93.27  | 1,363,327.59  |
| ATMOS ENERGY CORP            | 9,683   | 94.83  | 918,238.89    |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 41,331  | 29.79  | 1,231,250.49  |
| CMS ENERGY CORP              | 23,897  | 50.81  | 1,214,206.57  |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 25,197  | 75.95  | 1,913,712.15  |
| DOMINION ENERGY INC          | 60,528  | 69.16  | 4,186,116.48  |
| DTE ENERGY COMPANY           | 15,009  | 114.13 | 1,712,977.17  |
| DUKE ENERGY CORP             | 58,552  | 85.85  | 5,026,689.20  |
| EDISON INTERNATIONAL         | 26,840  | 55.43  | 1,487,741.20  |
| ENERGY CORP                  | 14,784  | 87.10  | 1,287,686.40  |
| EVERGY INC                   | 21,966  | 56.78  | 1,247,229.48  |
| EVERSOURCE ENERGY            | 26,176  | 67.28  | 1,761,121.28  |
| EXELON CORP                  | 79,419  | 46.43  | 3,687,424.17  |
| FIRSTENERGY CORP             | 41,180  | 38.79  | 1,597,372.20  |
| NEXTERA ENERGY INC           | 38,744  | 174.20 | 6,749,204.80  |
| NISOURCE INC                 | 28,849  | 26.36  | 760,459.64    |
| NRG ENERGY INC               | 24,006  | 40.93  | 982,565.58    |
| OGE ENERGY CORP              | 15,848  | 40.31  | 638,832.88    |
| PINNACLE WEST CAPITAL        | 9,570   | 86.94  | 832,015.80    |
| PPL CORP                     | 57,760  | 30.67  | 1,771,499.20  |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 42,319  | 52.65  | 2,228,095.35  |
| SEMPRA ENERGY                | 22,517  | 113.10 | 2,546,672.70  |
| SOUTHERN CO/THE              | 83,437  | 47.50  | 3,963,257.50  |
| UGI CORP                     | 13,961  | 55.95  | 781,117.95    |
| VISTRA ENERGY CORP           | 27,938  | 24.65  | 688,671.70    |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 26,027  | 71.04  | 1,848,958.08  |
| XCEL ENERGY INC              | 42,832  | 50.54  | 2,164,729.28  |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 76,097  | 21.93  | 1,668,807.21  |
| ANALOG DEVICES INC           | 30,584  | 97.67  | 2,987,139.28  |
| APPLIED MATERIALS INC        | 80,745  | 39.19  | 3,164,396.55  |
| BROADCOM INC                 | 35,426  | 267.94 | 9,492,042.44  |
| INTEL CORP                   | 378,368 | 47.04  | 17,798,430.72 |

|       |                              |            |        |                                       |  |
|-------|------------------------------|------------|--------|---------------------------------------|--|
|       | KLA-TENCOR CORP              | 12,497     | 101.39 | 1,267,070.83                          |  |
|       | LAM RESEARCH CORP            | 12,692     | 165.49 | 2,100,399.08                          |  |
|       | MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 51,416     | 18.57  | 954,795.12                            |  |
|       | MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    | 23,227     | 56.27  | 1,306,983.29                          |  |
|       | MICROCHIP TECHNOLOGY INC     | 19,362     | 80.63  | 1,561,158.06                          |  |
|       | MICRON TECHNOLOGY INC        | 95,161     | 38.96  | 3,707,472.56                          |  |
|       | NVIDIA CORP                  | 47,420     | 160.15 | 7,594,313.00                          |  |
|       | NXP SEMICONDUCTORS NV        | 28,282     | 85.24  | 2,410,757.68                          |  |
|       | ON SEMICONDUCTOR CORP        | 33,036     | 20.12  | 664,684.32                            |  |
|       | QORVO INC                    | 10,646     | 65.76  | 700,080.96                            |  |
|       | QUALCOMM INC                 | 115,428    | 51.30  | 5,921,456.40                          |  |
|       | SKYWORKS SOLUTIONS INC       | 14,883     | 72.47  | 1,078,571.01                          |  |
|       | TEXAS INSTRUMENTS INC        | 79,783     | 104.41 | 8,330,143.03                          |  |
|       | XILINX INC                   | 20,393     | 110.37 | 2,250,775.41                          |  |
|       | アメリカドル 小計                    | 24,927,387 |        | 1,881,536,630.49<br>(205,746,030,544) |  |
| カナダドル | ARC RESOURCES LTD            | 25,100     | 9.63   | 241,713.00                            |  |
|       | CAMECO CORP                  | 34,900     | 16.00  | 558,400.00                            |  |
|       | CANADIAN NATURAL RESOURCES   | 100,700    | 34.91  | 3,515,437.00                          |  |
|       | CENOVUS ENERGY INC           | 80,900     | 10.28  | 831,652.00                            |  |
|       | ENBRIDGE INC                 | 166,100    | 47.74  | 7,929,614.00                          |  |
|       | ENCANA CORP                  | 72,900     | 9.24   | 673,596.00                            |  |
|       | HUSKY ENERGY INC             | 26,678     | 15.99  | 426,581.22                            |  |
|       | IMPERIAL OIL LTD             | 23,300     | 36.99  | 861,867.00                            |  |
|       | INTER PIPELINE LTD           | 30,100     | 21.01  | 632,401.00                            |  |
|       | KEYERA CORP                  | 17,500     | 27.47  | 480,725.00                            |  |
|       | PEMBINA PIPELINE CORP        | 40,732     | 44.89  | 1,828,459.48                          |  |
|       | PRAIRIESKY ROYALTY LTD       | 15,088     | 19.23  | 290,142.24                            |  |
|       | SEVEN GENERATIONS ENERGY - A | 22,800     | 9.90   | 225,720.00                            |  |
|       | SUNCOR ENERGY INC            | 133,700    | 42.35  | 5,662,195.00                          |  |
|       | TOURMALINE OIL CORP          | 20,800     | 18.42  | 383,136.00                            |  |
|       | TRANSCANADA CORP             | 74,800     | 55.33  | 4,138,684.00                          |  |
|       | VERMILION ENERGY INC         | 12,900     | 30.92  | 398,868.00                            |  |
|       | AGNICO EAGLE MINES LTD       | 18,700     | 54.64  | 1,021,768.00                          |  |
|       | BARRICK GOLD CORP            | 143,500    | 16.20  | 2,324,700.00                          |  |
|       | CCL INDUSTRIES INC - CL B    | 12,400     | 54.84  | 680,016.00                            |  |
|       | FIRST QUANTUM MINERALS LTD   | 54,900     | 13.09  | 718,641.00                            |  |
|       | FRANCO-NEVADA CORP           | 15,400     | 96.35  | 1,483,790.00                          |  |
|       | GOLDCORP INC                 | 70,700     | 14.29  | 1,010,303.00                          |  |
|       | KINROSS GOLD CORP            | 110,200    | 4.28   | 471,656.00                            |  |
|       | LUNDIN MINING CORP           | 47,500     | 5.85   | 277,875.00                            |  |
|       | METHANEX CORP                | 5,500      | 76.36  | 419,980.00                            |  |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| NUTRIEN LTD                  | 50,559  | 68.37  | 3,456,718.83  |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B     | 40,600  | 30.34  | 1,231,804.00  |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 105,800 | 2.20   | 232,760.00    |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD    | 4,900   | 77.35  | 379,015.00    |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 34,700  | 25.89  | 898,383.00    |
| BOMBARDIER INC-B             | 174,600 | 2.00   | 349,200.00    |
| CAE INC                      | 23,200  | 27.71  | 642,872.00    |
| FINNING INTERNATIONAL INC    | 16,200  | 24.83  | 402,246.00    |
| SNC-LAVALIN GROUP INC        | 13,300  | 48.50  | 645,050.00    |
| WSP GLOBAL INC               | 8,300   | 64.10  | 532,030.00    |
| THOMSON REUTERS CORP         | 16,432  | 67.55  | 1,109,981.60  |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     | 60,100  | 110.37 | 6,633,237.00  |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 11,900  | 271.50 | 3,230,850.00  |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      | 27,300  | 69.29  | 1,891,617.00  |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        | 17,600  | 43.98  | 774,048.00    |
| RESTAURANT BRANDS INTERN     | 19,910  | 83.49  | 1,662,285.90  |
| STARS GROUP INC/THE          | 14,000  | 23.82  | 333,480.00    |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B    | 37,500  | 26.23  | 983,625.00    |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A   | 5,200   | 147.87 | 768,924.00    |
| DOLLARAMA INC                | 26,600  | 35.06  | 932,596.00    |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B  | 35,100  | 70.28  | 2,466,828.00  |
| EMPIRE CO LTD 'A'            | 15,400  | 29.93  | 460,922.00    |
| LOBLAW COMPANIES LTD         | 14,900  | 63.20  | 941,680.00    |
| METRO INC                    | 20,200  | 48.98  | 989,396.00    |
| WESTON (GEORGE) LTD          | 6,711   | 94.19  | 632,109.09    |
| SAPUTO INC                   | 18,600  | 38.56  | 717,216.00    |
| AURORA CANNABIS INC          | 48,900  | 8.88   | 434,232.00    |
| BAUSCH HEALTH COS INC        | 24,800  | 31.48  | 780,704.00    |
| CANOPY GROWTH CORP           | 15,600  | 64.10  | 999,960.00    |
| BANK OF MONTREAL             | 52,400  | 97.24  | 5,095,376.00  |
| BANK OF NOVA SCOTIA          | 101,000 | 73.57  | 7,430,570.00  |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  | 36,300  | 110.24 | 4,001,712.00  |
| NATIONAL BANK OF CANADA      | 27,800  | 60.86  | 1,691,908.00  |
| ROYAL BANK OF CANADA         | 118,100 | 99.06  | 11,698,986.00 |
| TORONTO-DOMINION BANK        | 149,700 | 72.83  | 10,902,651.00 |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 69,500  | 55.63  | 3,866,285.00  |
| CI FINANCIAL CORP            | 24,700  | 18.00  | 444,600.00    |
| IGM FINANCIAL INC            | 7,800   | 33.21  | 259,038.00    |
| ONEX CORPORATION             | 7,700   | 75.01  | 577,577.00    |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD  | 2,300   | 621.97 | 1,430,531.00  |
| GREAT-WEST LIFECO INC        | 24,300  | 28.00  | 680,400.00    |
| IA FINANCIAL CORP INC        | 10,100  | 48.53  | 490,153.00    |

|               |                              |           |        |                |                  |
|---------------|------------------------------|-----------|--------|----------------|------------------|
|               | INTACT FINANCIAL CORP        | 11,900    | 102.69 | 1,222,011.00   |                  |
|               | MANULIFE FINANCIAL CORP      | 163,500   | 20.86  | 3,410,610.00   |                  |
|               | POWER CORP OF CANADA         | 28,300    | 25.54  | 722,782.00     |                  |
|               | POWER FINANCIAL CORP         | 19,900    | 26.66  | 530,534.00     |                  |
|               | SUN LIFE FINANCIAL INC       | 49,900    | 47.53  | 2,371,747.00   |                  |
|               | FIRST CAPITAL REALTY INC     | 13,800    | 20.45  | 282,210.00     |                  |
|               | BLACKBERRY LTD               | 40,000    | 10.69  | 427,600.00     |                  |
|               | CGI GROUP INC - CLASS A      | 21,000    | 86.60  | 1,818,600.00   |                  |
|               | CONSTELLATION SOFTWARE INC   | 1,600     | 964.63 | 1,543,408.00   |                  |
|               | OPEN TEXT CORP               | 21,900    | 47.39  | 1,037,841.00   |                  |
|               | SHOPIFY INC - CLASS A        | 7,100     | 215.46 | 1,529,766.00   |                  |
|               | BCE INC                      | 11,700    | 56.03  | 655,551.00     |                  |
|               | ROGERS COMMUNICATIONS INC-B  | 29,900    | 69.69  | 2,083,731.00   |                  |
|               | TELUS CORP                   | 11,600    | 46.17  | 535,572.00     |                  |
|               | ALTAGAS LTD                  | 22,300    | 13.65  | 304,395.00     |                  |
|               | ATCO LTD -CLASS I            | 7,600     | 41.63  | 316,388.00     |                  |
|               | CANADIAN UTILITIES LTD-A     | 12,100    | 34.08  | 412,368.00     |                  |
|               | EMERA INC                    | 5,400     | 45.60  | 246,240.00     |                  |
|               | FORTIS INC                   | 35,600    | 46.32  | 1,648,992.00   |                  |
|               | HYDRO ONE LTD                | 28,500    | 20.50  | 584,250.00     |                  |
|               | カナダドル 小計                     | 3,462,010 |        | 143,256,073.36 | (11,851,574,949) |
| オーストラリア<br>ドル | CALTEX AUSTRALIA LTD         | 20,470    | 26.71  | 546,753.70     |                  |
|               | OIL SEARCH LTD               | 110,952   | 7.76   | 860,987.52     |                  |
|               | ORIGIN ENERGY LTD            | 140,525   | 7.24   | 1,017,401.00   |                  |
|               | SANTOS LTD                   | 151,359   | 6.29   | 952,048.11     |                  |
|               | WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 9,200     | 26.63  | 244,996.00     |                  |
|               | WOODSIDE PETROLEUM LTD       | 77,443    | 34.28  | 2,654,746.04   |                  |
|               | WORLEYPARSONS LTD            | 25,816    | 14.07  | 363,231.12     |                  |
|               | ALUMINA LTD                  | 225,269   | 2.37   | 533,887.53     |                  |
|               | AMCOR LIMITED                | 94,566    | 13.68  | 1,293,662.88   |                  |
|               | BHP GROUP LTD                | 241,502   | 33.05  | 7,981,641.10   |                  |
|               | BLUESCOPE STEEL LTD          | 42,276    | 12.42  | 525,067.92     |                  |
|               | BORAL LTD                    | 94,778    | 4.88   | 462,516.64     |                  |
|               | FORTESCUE METALS GROUP LTD   | 140,288   | 4.80   | 673,382.40     |                  |
|               | INCITEC PIVOT LTD            | 126,246   | 3.56   | 449,435.76     |                  |
|               | JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI  | 36,179    | 15.04  | 544,132.16     |                  |
|               | NEWCREST MINING LTD          | 62,139    | 23.18  | 1,440,382.02   |                  |
|               | ORICA LTD                    | 34,209    | 17.44  | 596,604.96     |                  |
|               | RIO TINTO LTD                | 30,268    | 80.47  | 2,435,665.96   |                  |
|               | SOUTH32 LTD                  | 428,480   | 3.29   | 1,409,699.20   |                  |
|               | CIMIC GROUP LTD              | 9,442     | 45.58  | 430,366.36     |                  |

|                              |           |        |               |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| BRAMBLES LTD                 | 133,242   | 10.74  | 1,431,019.08  |
| SEEK LTD                     | 31,170    | 17.81  | 555,137.70    |
| AURIZON HOLDINGS LTD         | 159,904   | 4.45   | 711,572.80    |
| SYDNEY AIRPORT               | 84,244    | 6.66   | 561,065.04    |
| TRANSURBAN GROUP             | 215,942   | 12.10  | 2,612,898.20  |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD       | 49,392    | 24.60  | 1,215,043.20  |
| CROWN RESORTS LTD            | 26,782    | 12.17  | 325,936.94    |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L | 3,782     | 45.41  | 171,740.62    |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L | 5,195     | 44.80  | 232,736.00    |
| TABCORP HOLDINGS LTD         | 147,399   | 4.69   | 691,301.31    |
| REA GROUP LTD                | 5,094     | 76.00  | 387,144.00    |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD   | 55,261    | 3.63   | 200,597.43    |
| WESFARMERS LTD               | 91,392    | 32.85  | 3,002,227.20  |
| COLES GROUP LTD              | 97,597    | 12.75  | 1,244,361.75  |
| WOOLWORTHS GROUP LTD         | 107,631   | 30.52  | 3,284,898.12  |
| COCA-COLA AMATIL LTD         | 40,556    | 8.54   | 346,348.24    |
| TREASURY WINE ESTATES LTD    | 60,920    | 15.50  | 944,260.00    |
| COCHLEAR LTD                 | 4,813     | 195.92 | 942,962.96    |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD       | 11,638    | 58.02  | 675,236.76    |
| SONIC HEALTHCARE LTD         | 37,382    | 23.11  | 863,898.02    |
| CSL LTD                      | 37,184    | 199.16 | 7,405,565.44  |
| AUST AND NZ BANKING GROUP    | 236,158   | 26.19  | 6,184,978.02  |
| BANK OF QUEENSLAND LTD       | 37,621    | 10.28  | 386,743.88    |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK    | 43,844    | 11.22  | 491,929.68    |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 144,582   | 72.54  | 10,487,978.28 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD  | 224,772   | 24.74  | 5,560,859.28  |
| WESTPAC BANKING CORP         | 282,210   | 25.88  | 7,303,594.80  |
| AMP LTD                      | 245,353   | 2.34   | 574,126.02    |
| ASX LTD                      | 16,172    | 65.03  | 1,051,665.16  |
| CHALLENGER LTD               | 43,119    | 7.49   | 322,961.31    |
| MACQUARIE GROUP LTD          | 26,690    | 117.81 | 3,144,348.90  |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP    | 185,526   | 7.16   | 1,328,366.16  |
| MEDIBANK PRIVATE LTD         | 212,573   | 2.61   | 554,815.53    |
| QBE INSURANCE GROUP LTD      | 116,277   | 10.94  | 1,272,070.38  |
| SUNCORP GROUP LTD            | 111,040   | 13.05  | 1,449,072.00  |
| LENDLEASE GROUP              | 52,674    | 12.01  | 632,614.74    |
| COMPUTERSHARE LTD            | 37,675    | 18.01  | 678,526.75    |
| TELSTRA CORP LTD             | 348,216   | 2.96   | 1,030,719.36  |
| TPG TELECOM LTD              | 34,153    | 6.96   | 237,704.88    |
| AGL ENERGY LTD               | 54,455    | 21.66  | 1,179,495.30  |
| AUSNET SERVICES              | 186,905   | 1.67   | 312,131.35    |
|                              | 6,147,942 |        | 97,407,260.97 |

| オーストラリアドル 小計                 |                             |           |              | (7,652,314,421) |
|------------------------------|-----------------------------|-----------|--------------|-----------------|
| イギリスポンド                      | BP PLC                      | 1,640,371 | 5.06         | 8,315,040.59    |
|                              | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 377,114   | 22.51        | 8,490,721.71    |
|                              | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 307,548   | 22.68        | 6,976,726.38    |
|                              | WOOD GROUP (JOHN) PLC       | 54,127    | 5.34         | 289,146.43      |
|                              | ANGLO AMERICAN PLC          | 86,156    | 18.65        | 1,606,809.40    |
|                              | ANTOFAGASTA PLC             | 35,213    | 8.27         | 291,281.93      |
|                              | BHP GROUP PLC               | 172,901   | 16.09        | 2,782,668.69    |
|                              | CRODA INTERNATIONAL PLC     | 10,801    | 47.97        | 518,123.97      |
|                              | FRESNILLO PLC               | 21,178    | 9.46         | 200,513.30      |
|                              | GLENCORE PLC                | 935,069   | 2.97         | 2,781,830.27    |
|                              | JOHNSON MATTHEY PLC         | 15,647    | 30.11        | 471,131.17      |
|                              | MONDI PLC                   | 30,592    | 18.41        | 563,351.68      |
|                              | RIO TINTO PLC               | 96,033    | 38.78        | 3,724,159.74    |
|                              | ASHTREAD GROUP PLC          | 40,579    | 19.22        | 779,928.38      |
|                              | BAE SYSTEMS PLC             | 261,742   | 5.11         | 1,337,501.62    |
|                              | BUNZL PLC                   | 28,973    | 23.43        | 678,837.39      |
|                              | DCC PLC                     | 8,391     | 64.10        | 537,863.10      |
|                              | FERGUSON PLC                | 19,052    | 50.74        | 966,698.48      |
|                              | MEGGITT PLC                 | 57,440    | 5.10         | 292,944.00      |
|                              | MELROSE INDUSTRIES PLC      | 400,391   | 1.63         | 656,040.65      |
|                              | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC    | 138,186   | 8.68         | 1,200,559.96    |
|                              | SMITHS GROUP PLC            | 32,667    | 14.23        | 464,851.41      |
|                              | WEIR GROUP PLC/THE          | 19,960    | 14.74        | 294,210.40      |
|                              | BABCOCK INTL GROUP PLC      | 22,771    | 5.49         | 125,149.41      |
|                              | EXPERIAN PLC                | 75,169    | 19.05        | 1,431,969.45    |
|                              | G4S PLC                     | 144,441   | 1.97         | 285,559.85      |
|                              | INTERTEK GROUP PLC          | 13,170    | 48.57        | 639,666.90      |
|                              | RELX PLC                    | 162,251   | 16.20        | 2,628,466.20    |
|                              | EASYJET PLC                 | 11,359    | 12.92        | 146,815.07      |
|                              | ROYAL MAIL PLC              | 65,843    | 3.04         | 200,360.24      |
|                              | BARRATT DEVELOPMENTS PLC    | 80,934    | 5.36         | 434,129.97      |
|                              | BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE | 10,105    | 37.79        | 381,867.95      |
| BURBERRY GROUP PLC           | 35,286                      | 17.85     | 630,031.53   |                 |
| PERSIMMON PLC                | 25,307                      | 23.92     | 605,343.44   |                 |
| TAYLOR WIMPEY PLC            | 264,986                     | 1.65      | 439,346.78   |                 |
| CARNIVAL PLC                 | 13,542                      | 41.01     | 555,357.42   |                 |
| COMPASS GROUP PLC            | 130,317                     | 15.86     | 2,067,479.20 |                 |
| GVC HOLDINGS PLC             | 41,247                      | 6.52      | 269,136.67   |                 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 14,214                      | 42.57     | 605,161.05   |                 |
| MERLIN ENTERTAINMENT         | 68,173                      | 3.32      | 226,334.36   |                 |
| TUI AG-DI                    | 35,838                      | 12.13     | 434,894.13   |                 |

|                              |           |       |               |
|------------------------------|-----------|-------|---------------|
| WHITBREAD PLC                | 15,404    | 48.80 | 751,715.20    |
| AUTO TRADER GROUP PLC        | 85,259    | 4.55  | 388,695.78    |
| INFORMA PLC                  | 104,851   | 6.75  | 707,953.95    |
| ITV PLC                      | 281,618   | 1.32  | 371,735.76    |
| PEARSON PLC                  | 65,170    | 9.01  | 587,442.38    |
| WPP PLC                      | 102,424   | 8.73  | 894,161.52    |
| KINGFISHER PLC               | 189,573   | 2.22  | 422,368.64    |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC    | 123,243   | 2.90  | 357,404.70    |
| NEXT PLC                     | 10,916    | 47.77 | 521,457.32    |
| SAINSBURY (J) PLC            | 143,744   | 2.82  | 406,364.28    |
| TESCO PLC                    | 802,693   | 2.24  | 1,805,256.55  |
| WM MORRISON SUPERMARKETS     | 171,923   | 2.35  | 404,620.78    |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 28,890    | 23.79 | 687,293.10    |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 188,233   | 23.92 | 4,502,533.36  |
| COCA-COLA HBC AG-DI          | 17,740    | 24.89 | 441,548.60    |
| DIAGEO PLC                   | 201,937   | 27.16 | 5,484,608.92  |
| IMPERIAL BRANDS PLC          | 78,243    | 24.20 | 1,893,480.60  |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 55,104    | 56.98 | 3,139,825.92  |
| UNILEVER PLC                 | 92,821    | 39.75 | 3,690,098.85  |
| CONVATEC GROUP PLC           | 123,670   | 1.39  | 172,705.15    |
| NMC HEALTH PLC               | 8,269     | 26.66 | 220,451.54    |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 70,668    | 14.19 | 1,002,778.92  |
| ASTRAZENECA PLC              | 104,005   | 53.71 | 5,586,108.55  |
| GLAXOSMITHKLINE PLC          | 407,300   | 14.40 | 5,866,749.20  |
| BARCLAYS PLC                 | 1,403,348 | 1.64  | 2,302,894.06  |
| HSBC HOLDINGS PLC            | 1,633,039 | 6.38  | 10,418,788.82 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 5,834,077 | 0.58  | 3,417,018.89  |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 392,072   | 2.43  | 953,911.17    |
| STANDARD CHARTERED PLC       | 230,801   | 6.25  | 1,443,429.45  |
| 3I GROUP PLC                 | 79,948    | 8.19  | 655,413.70    |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC      | 23,257    | 18.15 | 422,230.83    |
| INVESTEC PLC                 | 62,469    | 4.92  | 307,534.88    |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  | 25,803    | 44.20 | 1,140,492.60  |
| SCHRODERS PLC                | 9,329     | 25.87 | 241,341.23    |
| ST JAMES'S PLACE PLC         | 42,849    | 9.51  | 407,493.99    |
| STANDARD LIFE ABERDEEN PLC   | 187,877   | 2.61  | 490,358.97    |
| ADMIRAL GROUP PLC            | 15,121    | 20.90 | 316,028.90    |
| AVIVA PLC                    | 325,409   | 4.09  | 1,333,200.67  |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP  | 109,265   | 3.32  | 363,196.86    |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC    | 489,146   | 2.57  | 1,257,594.36  |
| PRUDENTIAL PLC               | 213,016   | 15.05 | 3,205,890.80  |
| RSA INSURANCE GROUP PLC      | 83,796    | 5.18  | 434,398.46    |

|        |                              |            |           |                                    |
|--------|------------------------------|------------|-----------|------------------------------------|
|        | MICRO FOCUS INTERNATIONAL    | 33,595     | 14.93     | 501,573.35                         |
|        | SAGE GROUP PLC/THE           | 90,812     | 6.30      | 572,297.22                         |
|        | BT GROUP PLC                 | 692,099    | 2.36      | 1,636,122.03                       |
|        | VODAFONE GROUP PLC           | 2,192,819  | 1.37      | 3,004,162.03                       |
|        | CENTRICA PLC                 | 456,129    | 1.35      | 616,002.21                         |
|        | NATIONAL GRID PLC            | 280,731    | 7.96      | 2,235,741.68                       |
|        | SEVERN TRENT PLC             | 19,421     | 19.25     | 373,854.25                         |
|        | SSE PLC                      | 82,903     | 11.29     | 936,389.38                         |
|        | UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 60,628     | 8.00      | 485,509.02                         |
|        | イギリスポンド 小計                   | 24,548,541 |           | 136,108,239.65<br>(19,647,224,393) |
| スイスフラン | CLARIANT AG-REG              | 15,377     | 19.75     | 303,772.63                         |
|        | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    | 585        | 500.50    | 292,792.50                         |
|        | GIVAUDAN-REG                 | 757        | 2,361.00  | 1,787,277.00                       |
|        | LAFARGEHOLCIM LTD-REG        | 39,798     | 46.25     | 1,840,657.50                       |
|        | SIKA AG-REG                  | 10,656     | 133.80    | 1,425,772.80                       |
|        | ABB LTD-REG                  | 151,090    | 19.35     | 2,924,346.95                       |
|        | GEBERIT AG-REG               | 3,016      | 388.30    | 1,171,112.80                       |
|        | SCHINDLER HOLDING AG-REG     | 1,880      | 204.80    | 385,024.00                         |
|        | SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 3,145      | 208.80    | 656,676.00                         |
|        | ADECCO GROUP AG-REG          | 13,331     | 50.52     | 673,482.12                         |
|        | SGS SA-REG                   | 449        | 2,375.00  | 1,066,375.00                       |
|        | KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG   | 4,400      | 133.25    | 586,300.00                         |
|        | CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 42,948     | 69.76     | 2,996,052.48                       |
|        | SWATCH GROUP AG/THE-BR       | 2,565      | 308.00    | 790,020.00                         |
|        | SWATCH GROUP AG/THE-REG      | 4,905      | 60.00     | 294,300.00                         |
|        | DUFREY AG-REG                | 2,549      | 99.76     | 254,288.24                         |
|        | BARRY CALLEBAUT AG-REG       | 162        | 1,654.00  | 267,948.00                         |
|        | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   | 88         | 6,205.00  | 546,040.00                         |
|        | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG  | 8          | 71,900.00 | 575,200.00                         |
|        | NESTLE SA-REG                | 251,254    | 84.28     | 21,175,687.12                      |
|        | SONOVA HOLDING AG-REG        | 4,617      | 180.85    | 834,984.45                         |
|        | STRAUMANN HOLDING AG-REG     | 888        | 714.50    | 634,476.00                         |
|        | LONZA GROUP AG-REG           | 6,137      | 282.70    | 1,734,929.90                       |
|        | NOVARTIS AG-REG              | 177,938    | 85.62     | 15,235,051.56                      |
|        | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 57,661     | 255.45    | 14,729,502.45                      |
|        | VIFOR PHARMA AG              | 3,784      | 125.75    | 475,838.00                         |
|        | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   | 211,382    | 12.42     | 2,625,364.44                       |
|        | JULIUS BAER GROUP LTD        | 17,388     | 40.66     | 706,996.08                         |
|        | PARGESA HOLDING SA-BR        | 3,664      | 77.55     | 284,143.20                         |
|        | PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 1,431      | 678.00    | 970,218.00                         |
|        | UBS GROUP AG-REG             | 316,831    | 12.99     | 4,115,634.69                       |



|      |                              |           |        |                                   |  |
|------|------------------------------|-----------|--------|-----------------------------------|--|
|      | BALOISE HOLDING AG - REG     | 3,975     | 155.50 | 618,112.50                        |  |
|      | SWISS LIFE HOLDING AG-REG    | 2,863     | 412.30 | 1,180,414.90                      |  |
|      | SWISS RE AG                  | 25,176    | 95.52  | 2,404,811.52                      |  |
|      | ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 12,404    | 313.10 | 3,883,692.40                      |  |
|      | SWISS PRIME SITE-REG         | 6,098     | 83.35  | 508,268.30                        |  |
|      | TEMENOS AG - REG             | 4,684     | 137.10 | 642,176.40                        |  |
|      | SWISSCOM AG-REG              | 2,126     | 482.30 | 1,025,369.80                      |  |
|      | スイスフラン 小計                    | 1,408,010 |        | 92,623,109.73<br>(10,202,435,536) |  |
| 香港ドル | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    | 225,368   | 81.00  | 18,254,808.00                     |  |
|      | NWS HOLDINGS LTD             | 142,500   | 18.00  | 2,565,000.00                      |  |
|      | MTR CORP                     | 118,000   | 42.90  | 5,062,200.00                      |  |
|      | MINTH GROUP LTD              | 52,000    | 27.40  | 1,424,800.00                      |  |
|      | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 111,500   | 44.55  | 4,967,325.00                      |  |
|      | YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG     | 48,500    | 26.10  | 1,265,850.00                      |  |
|      | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 196,000   | 51.25  | 10,045,000.00                     |  |
|      | MGM CHINA HOLDINGS LTD       | 88,400    | 13.96  | 1,234,064.00                      |  |
|      | SANDS CHINA LTD              | 194,400   | 36.50  | 7,095,600.00                      |  |
|      | SHANGRI-LA ASIA LTD          | 122,000   | 10.24  | 1,249,280.00                      |  |
|      | SJM HOLDINGS LTD             | 175,000   | 8.13   | 1,422,750.00                      |  |
|      | WYNN MACAU LTD               | 116,800   | 17.84  | 2,083,712.00                      |  |
|      | WH GROUP LTD                 | 723,000   | 6.86   | 4,959,780.00                      |  |
|      | BANK OF EAST ASIA LTD        | 113,620   | 26.15  | 2,971,163.00                      |  |
|      | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD   | 308,000   | 30.50  | 9,394,000.00                      |  |
|      | HANG SENG BANK LTD           | 63,000    | 179.60 | 11,314,800.00                     |  |
|      | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR  | 97,600    | 242.80 | 23,697,280.00                     |  |
|      | AIA GROUP LTD                | 992,600   | 69.50  | 68,985,700.00                     |  |
|      | CK ASSET HOLDINGS LTD        | 213,868   | 65.00  | 13,901,420.00                     |  |
|      | HANG LUNG GROUP LTD          | 88,000    | 21.70  | 1,909,600.00                      |  |
|      | HANG LUNG PROPERTIES LTD     | 186,000   | 16.28  | 3,028,080.00                      |  |
|      | HENDERSON LAND DEVELOPMENT   | 103,947   | 44.40  | 4,615,246.80                      |  |
|      | HYSAN DEVELOPMENT CO         | 57,000    | 40.70  | 2,319,900.00                      |  |
|      | KERRY PROPERTIES LTD         | 60,500    | 31.90  | 1,929,950.00                      |  |
|      | NEW WORLD DEVELOPMENT        | 502,000   | 11.86  | 5,953,720.00                      |  |
|      | SINO LAND CO                 | 281,400   | 14.10  | 3,967,740.00                      |  |
|      | SUN HUNG KAI PROPERTIES      | 131,500   | 129.00 | 16,963,500.00                     |  |
|      | SWIRE PACIFIC LTD - CL A     | 37,500    | 91.75  | 3,440,625.00                      |  |
|      | SWIRE PROPERTIES LTD         | 105,000   | 28.55  | 2,997,750.00                      |  |
|      | WHARF HOLDINGS LTD           | 90,000    | 23.05  | 2,074,500.00                      |  |
|      | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 102,000   | 52.95  | 5,400,900.00                      |  |
|      | WHEELLOCK & CO LTD           | 61,000    | 48.95  | 2,985,950.00                      |  |
|      | HKT TRUST AND HKT LTD-SS     | 287,000   | 11.60  | 3,329,200.00                      |  |

|                              |                              |           |              |                                   |  |
|------------------------------|------------------------------|-----------|--------------|-----------------------------------|--|
|                              | PCCW LTD                     | 406,000   | 4.73         | 1,920,380.00                      |  |
|                              | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 51,000    | 63.80        | 3,253,800.00                      |  |
|                              | CLP HOLDINGS LTD             | 136,500   | 91.05        | 12,428,325.00                     |  |
|                              | HONG KONG & CHINA GAS        | 768,484   | 17.12        | 13,156,446.08                     |  |
|                              | POWER ASSETS HOLDINGS LTD    | 117,000   | 53.65        | 6,277,050.00                      |  |
|                              | ASM PACIFIC TECHNOLOGY       | 24,400    | 82.00        | 2,000,800.00                      |  |
|                              | 香港ドル 小計                      | 7,698,387 |              | 291,847,994.88<br>(4,068,361,048) |  |
| シンガポールドル                     | KEPPEL CORP LTD              | 125,600   | 6.20         | 778,720.00                        |  |
|                              | SEMBCORP INDUSTRIES LTD      | 92,600    | 2.64         | 244,464.00                        |  |
|                              | SINGAPORE TECH ENGINEERING   | 113,700   | 3.68         | 418,416.00                        |  |
|                              | YANGZIJANG SHIPBUILDING      | 208,500   | 1.35         | 281,475.00                        |  |
|                              | COMFORTDELGRO CORP LTD       | 198,300   | 2.33         | 462,039.00                        |  |
|                              | SATS LTD                     | 65,000    | 4.85         | 315,250.00                        |  |
|                              | SINGAPORE AIRLINES LTD       | 43,940    | 9.72         | 427,096.80                        |  |
|                              | GENTING SINGAPORE LTD        | 543,000   | 1.06         | 575,580.00                        |  |
|                              | SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 152,850   | 2.52         | 385,182.00                        |  |
|                              | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 6,600     | 37.26        | 245,916.00                        |  |
|                              | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD    | 639,560   | 0.27         | 172,681.20                        |  |
|                              | WILMAR INTERNATIONAL LTD     | 149,400   | 3.28         | 490,032.00                        |  |
|                              | DBS GROUP HOLDINGS LTD       | 145,600   | 24.22        | 3,526,432.00                      |  |
|                              | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 261,700   | 11.47        | 3,001,699.00                      |  |
|                              | UNITED OVERSEAS BANK LTD     | 111,800   | 25.88        | 2,893,384.00                      |  |
|                              | SINGAPORE EXCHANGE LTD       | 62,100    | 7.57         | 470,097.00                        |  |
|                              | CAPITALAND LTD               | 204,700   | 3.30         | 675,510.00                        |  |
|                              | CITY DEVELOPMENTS LTD        | 37,800    | 9.06         | 342,468.00                        |  |
|                              | UOL GROUP LTD                | 44,300    | 6.66         | 295,038.00                        |  |
|                              | VENTURE CORP LTD             | 22,000    | 15.81        | 347,820.00                        |  |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 662,660                      | 3.05      | 2,021,113.00 |                                   |  |
|                              | シンガポールドル 小計                  | 3,891,710 |              | 18,370,413.00<br>(1,485,247,891)  |  |
| ニュージーランドドル                   | FLETCHER BUILDING LTD        | 63,834    | 5.04         | 321,723.36                        |  |
|                              | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    | 85,484    | 7.62         | 651,388.08                        |  |
|                              | A2 MILK CO LTD               | 57,068    | 12.30        | 701,936.40                        |  |
|                              | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 45,792    | 13.48        | 617,276.16                        |  |
|                              | RYMAN HEALTHCARE LTD         | 36,094    | 11.00        | 397,034.00                        |  |
|                              | SPARK NEW ZEALAND LTD        | 161,393   | 4.12         | 664,939.16                        |  |
|                              | MERIDIAN ENERGY LTD          | 87,727    | 3.52         | 309,237.67                        |  |
|                              | ニュージーランドドル 小計                | 537,392   |              | 3,663,534.83<br>(274,142,311)     |  |
| スウェーデンクローネ                   | LUNDIN PETROLEUM AB          | 16,985    | 266.10       | 4,519,708.50                      |  |
|                              | BOLIDEN AB                   | 22,350    | 219.50       | 4,905,825.00                      |  |

|               |                              |           |        |                                   |  |
|---------------|------------------------------|-----------|--------|-----------------------------------|--|
|               | ALFA LAVAL AB                | 22,676    | 200.20 | 4,539,735.20                      |  |
|               | ASSA ABLOY AB-B              | 81,357    | 167.80 | 13,651,704.60                     |  |
|               | ATLAS COPCO AB-A SHS         | 55,679    | 229.30 | 12,767,194.70                     |  |
|               | ATLAS COPCO AB-B SHS         | 31,381    | 210.55 | 6,607,269.55                      |  |
|               | EPIROC AB-A                  | 57,066    | 87.73  | 5,006,400.18                      |  |
|               | EPIROC AB-B                  | 31,407    | 82.20  | 2,581,655.40                      |  |
|               | SANDVIK AB                   | 93,149    | 143.50 | 13,366,881.50                     |  |
|               | SKANSKA AB-B SHS             | 25,398    | 161.30 | 4,096,697.40                      |  |
|               | SKF AB-B SHARES              | 30,150    | 150.10 | 4,525,515.00                      |  |
|               | VOLVO AB-B SHS               | 128,163   | 125.20 | 16,046,007.60                     |  |
|               | SECURITAS AB-B SHS           | 23,142    | 145.65 | 3,370,632.30                      |  |
|               | ELECTROLUX AB-SER B          | 18,811    | 209.90 | 3,948,428.90                      |  |
|               | HUSQVARNA AB-B SHS           | 38,224    | 69.80  | 2,668,035.20                      |  |
|               | HENNES & MAURITZ AB-B SHS    | 73,092    | 134.24 | 9,811,870.08                      |  |
|               | ICA GRUPPEN AB               | 7,273     | 316.90 | 2,304,813.70                      |  |
|               | SWEDISH MATCH AB             | 15,331    | 398.90 | 6,115,535.90                      |  |
|               | ESSITY AKTIEBOLAG-B          | 50,234    | 224.40 | 11,272,509.60                     |  |
|               | NORDEA BANK ABP              | 243,819   | 83.01  | 20,239,415.19                     |  |
|               | SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 134,763   | 92.60  | 12,479,053.80                     |  |
|               | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 123,940   | 100.45 | 12,449,773.00                     |  |
|               | SWEDBANK AB - A SHARES       | 74,352    | 211.00 | 15,688,272.00                     |  |
|               | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS      | 15,069    | 186.10 | 2,804,340.90                      |  |
|               | INVESTOR AB-B SHS            | 37,282    | 398.50 | 14,856,877.00                     |  |
|               | KINNEVIK AB - B              | 18,566    | 226.30 | 4,201,485.80                      |  |
|               | LUNDBERGS AB-B SHS           | 6,638     | 280.60 | 1,862,622.80                      |  |
|               | ERICSSON LM-B SHS            | 252,249   | 81.08  | 20,452,348.92                     |  |
|               | HEXAGON AB-B SHS             | 21,104    | 448.50 | 9,465,144.00                      |  |
|               | MILLICOM INTL CELLULAR-SDR   | 6,008     | 575.50 | 3,457,604.00                      |  |
|               | TELE2 AB-B SHS               | 39,509    | 115.75 | 4,573,166.75                      |  |
|               | TELIA CO AB                  | 233,342   | 39.78  | 9,282,344.76                      |  |
|               | スウェーデンクローネ 小計                | 2,028,509 |        | 263,918,869.23<br>(3,190,779,128) |  |
| ノルウェーク<br>ローネ | AKER BP ASA                  | 8,795     | 278.60 | 2,450,287.00                      |  |
|               | EQUINOR ASA                  | 97,434    | 189.80 | 18,492,973.20                     |  |
|               | NORSK HYDRO ASA              | 104,142   | 39.65  | 4,129,230.30                      |  |
|               | YARA INTERNATIONAL ASA       | 14,527    | 347.40 | 5,046,679.80                      |  |
|               | SCHIBSTED ASA-B SHS          | 8,069     | 275.50 | 2,223,009.50                      |  |
|               | MOWI ASA                     | 34,554    | 187.90 | 6,492,696.60                      |  |
|               | ORKLA ASA                    | 66,800    | 68.12  | 4,550,416.00                      |  |
|               | DNB ASA                      | 80,165    | 151.90 | 12,177,063.50                     |  |
|               | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA    | 14,181    | 142.00 | 2,013,702.00                      |  |
|               | TELENOR ASA                  | 61,959    | 164.25 | 10,176,765.75                     |  |

|            |                              |         |              |                                   |
|------------|------------------------------|---------|--------------|-----------------------------------|
|            | ノルウェークローネ 小計                 | 490,626 |              | 67,752,823.65<br>(869,946,255)    |
| デンマーククローネ  | CHR HANSEN HOLDING A/S       | 8,285   | 613.20       | 5,080,362.00                      |
|            | NOVOZYMES A/S-B SHARES       | 18,811  | 268.20       | 5,045,110.20                      |
|            | VESTAS WIND SYSTEMS A/S      | 15,767  | 518.20       | 8,170,459.40                      |
|            | ISS A/S                      | 12,813  | 192.00       | 2,460,096.00                      |
|            | AP MOELLER-MAERSK A/S-A      | 296     | 8,210.00     | 2,430,160.00                      |
|            | AP MOLLER-MAERSK A/S-B       | 537     | 8,786.00     | 4,718,082.00                      |
|            | DSV A/S                      | 15,343  | 529.00       | 8,116,447.00                      |
|            | PANDORA A/S                  | 8,483   | 282.00       | 2,392,206.00                      |
|            | CARLSBERG AS-B               | 8,964   | 730.40       | 6,547,305.60                      |
|            | COLOPLAST-B                  | 9,884   | 598.20       | 5,912,608.80                      |
|            | WILLIAM DEMANT HOLDING       | 7,961   | 209.20       | 1,665,441.20                      |
|            | GENMAB A/S                   | 5,253   | 950.60       | 4,993,501.80                      |
|            | H LUNDBECK A/S               | 6,277   | 281.20       | 1,765,092.40                      |
|            | NOVO NORDISK A/S-B           | 149,073 | 303.05       | 45,176,572.65                     |
|            | DANSKE BANK A/S              | 59,575  | 125.20       | 7,458,790.00                      |
| TRYG A/S   | 8,821                        | 169.10  | 1,491,631.10 |                                   |
| ORSTED A/S | 15,956                       | 453.20  | 7,231,259.20 |                                   |
|            | デンマーククローネ 小計                 | 352,099 |              | 120,655,125.35<br>(2,016,147,144) |
| イスラエルシェケル  | ISRAEL CHEMICALS LTD         | 53,782  | 21.40        | 1,150,934.80                      |
|            | ELBIT SYSTEMS LTD            | 2,216   | 450.20       | 997,643.20                        |
|            | BANK HAPOLIM BM              | 85,294  | 24.35        | 2,076,908.90                      |
|            | BANK LEUMI LE-ISRAEL         | 127,843 | 23.78        | 3,040,106.54                      |
|            | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD     | 12,539  | 66.14        | 829,329.46                        |
|            | AZRIELI GROUP LTD            | 3,746   | 188.30       | 705,371.80                        |
|            | NICE LTD                     | 4,696   | 393.30       | 1,846,936.80                      |
|            | BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO | 186,511 | 3.16         | 589,561.27                        |
|            | イスラエルシェケル 小計                 | 476,627 |              | 11,236,792.77<br>(335,193,528)    |
| ユーロ        | ENAGAS SA                    | 20,240  | 25.04        | 506,809.60                        |
|            | ENI SPA                      | 208,376 | 14.57        | 3,036,455.07                      |
|            | GALP ENERGIA SGPS SA         | 41,429  | 13.95        | 577,934.55                        |
|            | NESTE OYJ                    | 10,676  | 80.64        | 860,912.64                        |
|            | OMV AG                       | 12,373  | 42.38        | 524,367.74                        |
|            | REPSOL SA                    | 114,200 | 15.04        | 1,718,139.00                      |
|            | SNAM SPA                     | 188,064 | 4.09         | 769,181.76                        |
|            | TENARIS SA                   | 38,516  | 11.03        | 425,024.06                        |
|            | TOTAL SA                     | 196,985 | 47.45        | 9,346,938.25                      |
|            | VOPAK                        | 6,680   | 44.33        | 296,124.40                        |
|            | AIR LIQUIDE SA               | 35,190  | 105.20       | 3,701,988.00                      |

|                             |        |          |              |
|-----------------------------|--------|----------|--------------|
| AKZO NOBEL N.V.             | 18,412 | 74.90    | 1,379,058.80 |
| ARCELORMITTAL               | 55,152 | 20.04    | 1,105,246.08 |
| ARKEMA                      | 5,588  | 83.70    | 467,715.60   |
| BASF SE                     | 75,314 | 65.09    | 4,902,188.26 |
| COVESTRO AG                 | 16,419 | 47.59    | 781,380.21   |
| CRH PLC                     | 68,457 | 25.62    | 1,753,868.34 |
| EVONIK INDUSTRIES AG        | 12,233 | 23.84    | 291,634.72   |
| FUCHS PETROLUB SE -PREF     | 6,711  | 41.48    | 278,372.28   |
| HEIDELBERGCEMENT AG         | 11,863 | 61.52    | 729,811.76   |
| IMERYS SA                   | 3,250  | 46.14    | 149,955.00   |
| KONINKLIJKE DSM NV          | 14,998 | 80.98    | 1,214,538.04 |
| LANXESS AG                  | 7,123  | 48.91    | 348,385.93   |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC     | 17,698 | 25.14    | 444,927.72   |
| SOLVAY SA                   | 5,804  | 95.54    | 554,514.16   |
| STORA ENSO OYJ-R SHS        | 47,201 | 11.96    | 564,523.96   |
| SYMRISE AG                  | 10,398 | 71.90    | 747,616.20   |
| THYSSENKRUPP AG             | 35,418 | 15.43    | 546,499.74   |
| UMICORE                     | 17,505 | 36.75    | 643,308.75   |
| UPM-KYMMENE OYJ             | 43,884 | 25.98    | 1,140,106.32 |
| VOESTALPINE AG              | 9,030  | 28.09    | 253,652.70   |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 21,609 | 36.20    | 782,245.80   |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y-RTS  | 21,609 | 0.47     | 10,201.60    |
| AIRBUS SE                   | 47,790 | 96.51    | 4,612,212.90 |
| ALSTOM                      | 13,755 | 36.37    | 500,269.35   |
| ANDRITZ AG                  | 5,325  | 42.74    | 227,590.50   |
| BOUYGUES SA                 | 17,851 | 30.93    | 552,131.43   |
| BRENTAG AG                  | 13,323 | 41.60    | 554,236.80   |
| CNH INDUSTRIAL NV           | 86,254 | 9.01     | 777,838.57   |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN   | 40,832 | 30.96    | 1,264,158.72 |
| DASSAULT AVIATION SA        | 176    | 1,305.00 | 229,680.00   |
| EIFFAGE                     | 6,092  | 80.20    | 488,578.40   |
| FERROVIAL SA                | 39,884 | 19.68    | 784,917.12   |
| GEA GROUP AG                | 14,475 | 24.80    | 358,980.00   |
| HOCHTIEF AG                 | 1,825  | 130.00   | 237,250.00   |
| KINGSPAN GROUP PLC          | 12,275 | 38.10    | 467,677.50   |
| KION GROUP AG               | 5,354  | 51.12    | 273,696.48   |
| KONE OYJ-B                  | 28,037 | 43.02    | 1,206,151.74 |
| LEGRAND SA                  | 22,202 | 52.26    | 1,160,276.52 |
| LEONARDO SPA                | 33,278 | 8.25     | 274,676.61   |
| METSO OYJ                   | 7,877  | 26.13    | 205,826.01   |
| MTU AERO ENGINES AG         | 4,451  | 188.70   | 839,903.70   |
| OSRAM LICHT AG              | 8,336  | 38.87    | 324,020.32   |

|                              |        |        |              |
|------------------------------|--------|--------|--------------|
| PRYSMIAN SPA                 | 19,187 | 18.73  | 359,372.51   |
| REXEL SA                     | 22,189 | 10.20  | 226,327.80   |
| SAFRAN SA                    | 27,375 | 110.50 | 3,024,937.50 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE        | 45,148 | 61.18  | 2,762,154.64 |
| SIEMENS AG-REG               | 62,722 | 100.32 | 6,292,271.04 |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE | 22,258 | 11.52  | 256,523.45   |
| THALES SA                    | 8,500  | 96.08  | 816,680.00   |
| VINCI SA                     | 41,635 | 76.84  | 3,199,233.40 |
| WARTSILA OYJ ABP             | 36,487 | 14.52  | 529,791.24   |
| BUREAU VERITAS SA            | 21,145 | 19.46  | 411,481.70   |
| EDENRED                      | 20,509 | 35.90  | 736,273.10   |
| RANDSTAD NV                  | 9,698  | 42.78  | 414,880.44   |
| SOCIETE BIC SA               | 1,760  | 85.25  | 150,040.00   |
| TELEPERFORMANCE              | 4,498  | 151.40 | 680,997.20   |
| WOLTERS KLUWER               | 23,240 | 53.78  | 1,249,847.20 |
| ADP                          | 2,367  | 164.90 | 390,318.30   |
| AENA SME SA                  | 5,435  | 150.30 | 816,880.50   |
| ATLANTIA SPA                 | 41,994 | 20.90  | 877,674.60   |
| BOLLORE                      | 62,397 | 3.55   | 221,758.93   |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       | 18,785 | 22.13  | 415,712.05   |
| DEUTSCHE POST AG-REG         | 81,674 | 26.31  | 2,148,842.94 |
| FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT | 2,876  | 68.86  | 198,041.36   |
| GETLINK SE                   | 37,574 | 12.69  | 477,001.93   |
| INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI | 48,045 | 7.29   | 350,248.05   |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG  | 27,630 | 74.35  | 2,054,290.50 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 4,113  | 65.40  | 268,990.20   |
| CONTINENTAL AG               | 9,059  | 140.00 | 1,268,260.00 |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 74,747 | 52.57  | 3,929,449.79 |
| FAURECIA                     | 6,208  | 39.78  | 246,954.24   |
| FERRARI NV                   | 10,284 | 97.98  | 1,007,626.32 |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 87,254 | 14.65  | 1,278,620.11 |
| MICHELIN (CGDE)              | 14,060 | 95.30  | 1,339,918.00 |
| NOKIAN RENKAAT OYJ           | 8,634  | 29.51  | 254,789.34   |
| PEUGEOT SA                   | 46,895 | 21.93  | 1,028,407.35 |
| PIRELLI & C SPA              | 32,400 | 6.04   | 195,825.60   |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF   | 12,355 | 57.84  | 714,613.20   |
| RENAULT SA                   | 16,060 | 61.16  | 982,229.60   |
| VALEO SA                     | 18,455 | 27.87  | 514,340.85   |
| VOLKSWAGEN AG                | 2,738  | 154.20 | 422,199.60   |
| VOLKSWAGEN AG-PREF           | 15,192 | 151.64 | 2,303,714.88 |
| ADIDAS AG                    | 15,439 | 204.00 | 3,149,556.00 |
| ESSILORLUXOTTICA             | 23,665 | 111.15 | 2,630,364.75 |

|                              |         |        |              |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| HERMES INTERNATIONAL         | 2,601   | 504.40 | 1,311,944.40 |
| HUGO BOSS AG -ORD            | 5,635   | 64.20  | 361,767.00   |
| KERING                       | 6,238   | 421.20 | 2,627,445.60 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 22,802  | 261.10 | 5,953,602.20 |
| MONCLER SPA                  | 14,273  | 30.65  | 437,467.45   |
| PUMA SE                      | 692     | 480.00 | 332,160.00   |
| SEB SA                       | 1,630   | 133.50 | 217,605.00   |
| ACCOR SA                     | 15,620  | 38.52  | 601,682.40   |
| PADDY POWER BETFAIR PLC      | 6,731   | 69.60  | 468,477.60   |
| SODEXO SA                    | 7,529   | 93.88  | 706,822.52   |
| AXEL SPRINGER SE             | 3,334   | 53.95  | 179,869.30   |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS      | 12,553  | 18.46  | 231,791.14   |
| JCDECAUX SA                  | 6,778   | 26.54  | 179,888.12   |
| PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE      | 18,729  | 16.49  | 308,934.85   |
| PUBLICIS GROUPE              | 17,599  | 54.36  | 956,681.64   |
| RTL GROUP                    | 2,582   | 49.18  | 126,982.76   |
| SES                          | 28,205  | 17.58  | 495,843.90   |
| TELENET GROUP HOLDING NV     | 3,831   | 39.68  | 152,014.08   |
| UBISOFT ENTERTAINMENT        | 6,965   | 76.86  | 535,329.90   |
| VIVENDI                      | 87,330  | 21.64  | 1,889,821.20 |
| DELIVERY HERO SE             | 7,441   | 34.00  | 252,994.00   |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL   | 90,317  | 24.15  | 2,181,155.55 |
| ZALANDO SE                   | 8,059   | 29.93  | 241,205.87   |
| CARREFOUR SA                 | 47,805  | 17.45  | 834,436.27   |
| CASINO GUICHARD PERRACHON    | 5,205   | 39.87  | 207,523.35   |
| COLRUYT SA                   | 5,320   | 61.90  | 329,308.00   |
| JERONIMO MARTINS             | 18,092  | 12.72  | 230,130.24   |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 102,936 | 23.38  | 2,407,158.36 |
| METRO AG                     | 12,526  | 15.16  | 189,894.16   |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV   | 62,569  | 65.54  | 4,100,772.26 |
| DANONE                       | 50,662  | 62.45  | 3,163,841.90 |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA    | 51,941  | 7.79   | 404,620.39   |
| HEINEKEN HOLDING NV          | 9,551   | 73.55  | 702,476.05   |
| HEINEKEN NV                  | 21,224  | 75.74  | 1,607,505.76 |
| KERRY GROUP PLC-A            | 13,085  | 89.20  | 1,167,182.00 |
| PERNOD RICARD SA             | 17,469  | 141.50 | 2,471,863.50 |
| REMY COINTREAU               | 2,083   | 101.00 | 210,383.00   |
| BEIERSDORF AG                | 8,290   | 85.20  | 706,308.00   |
| HENKEL AG & CO KGAA          | 8,369   | 78.90  | 660,314.10   |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG   | 14,686  | 84.36  | 1,238,910.96 |
| L'OREAL                      | 20,691  | 200.60 | 4,150,614.60 |
| UNILEVER NV-CVA              | 126,597 | 46.80  | 5,924,739.60 |

|                              |           |        |              |
|------------------------------|-----------|--------|--------------|
| BIOMERIEUX                   | 2,878     | 63.30  | 182,177.40   |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG &  | 17,887    | 63.50  | 1,135,824.50 |
| FRESENIUS SE & CO KGAA       | 33,493    | 45.11  | 1,510,869.23 |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       | 78,123    | 32.62  | 2,548,372.26 |
| SARTORIUS AG-VORZUG          | 2,824     | 115.10 | 325,042.40   |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG      | 12,704    | 36.22  | 460,138.88   |
| BAYER AG-REG                 | 76,567    | 67.81  | 5,192,008.27 |
| EUROFINS SCIENTIFIC          | 1,052     | 379.20 | 398,918.40   |
| GRIFOLS SA                   | 24,058    | 23.79  | 572,339.82   |
| IPSEN                        | 2,809     | 116.05 | 325,984.45   |
| MERCK KGAA                   | 10,773    | 92.06  | 991,762.38   |
| ORION OYJ-CLASS B            | 7,506     | 31.47  | 236,213.82   |
| QIAGEN N.V.                  | 19,313    | 32.68  | 631,148.84   |
| RECORDATI SPA                | 9,589     | 29.94  | 287,094.66   |
| SANOFI                       | 92,507    | 73.28  | 6,778,912.96 |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH     | 2,226     | 90.15  | 200,673.90   |
| UCB SA                       | 10,664    | 74.86  | 798,307.04   |
| ABN AMRO GROUP NV-CVA        | 35,126    | 22.30  | 783,309.80   |
| AIB GROUP PLC                | 66,715    | 4.03   | 268,861.45   |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 545,537   | 5.30   | 2,893,528.24 |
| BANCO DE SABADELL SA         | 435,169   | 1.08   | 469,982.52   |
| BANCO SANTANDER SA           | 1,332,868 | 4.41   | 5,888,610.82 |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC    | 76,621    | 5.60   | 429,077.60   |
| BANKIA SA                    | 91,569    | 2.58   | 237,072.14   |
| BANKINTER SA                 | 53,132    | 7.30   | 387,863.60   |
| BNP PARIBAS                  | 92,306    | 42.99  | 3,968,234.94 |
| CAIXABANK SA                 | 299,707   | 3.40   | 1,019,003.80 |
| COMMERZBANK AG               | 77,319    | 6.94   | 537,135.09   |
| CREDIT AGRICOLE SA           | 92,741    | 10.37  | 962,466.09   |
| ERSTE GROUP BANK AG          | 25,348    | 31.22  | 791,364.56   |
| ING GROEP NV                 | 319,430   | 10.64  | 3,400,012.92 |
| INTESA SANPAOLO              | 1,219,969 | 2.06   | 2,518,626.00 |
| IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD | 47,248    |        |              |
| KBC GROUP NV                 | 20,445    | 60.50  | 1,236,922.50 |
| MEDIOBANCA SPA               | 52,475    | 7.97   | 418,540.60   |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA | 10,971    | 24.31  | 266,705.01   |
| SOCIETE GENERALE SA          | 63,870    | 28.62  | 1,827,959.40 |
| UNICREDIT SPA                | 164,386   | 11.00  | 1,808,574.77 |
| AMUNDI SA                    | 4,665     | 50.40  | 235,116.00   |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED  | 161,806   | 8.13   | 1,315,644.58 |
| DEUTSCHE BOERSE AG           | 15,809    | 114.95 | 1,817,244.55 |
| EURAZEO SE                   | 3,350     | 64.95  | 217,582.50   |



|                              |         |        |              |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| EXOR NV                      | 8,678   | 54.74  | 475,033.72   |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA  | 6,699   | 81.80  | 547,978.20   |
| NATIXIS                      | 74,547  | 4.62   | 344,481.68   |
| WENDEL                       | 2,050   | 106.10 | 217,505.00   |
| AEGON NV                     | 151,884 | 4.55   | 691,224.08   |
| AGEAS                        | 13,960  | 41.37  | 577,525.20   |
| ALLIANZ SE-REG               | 35,257  | 185.92 | 6,554,981.44 |
| ASSICURAZIONI GENERALI       | 95,590  | 15.45  | 1,477,343.45 |
| AXA SA                       | 159,049 | 20.41  | 3,246,190.09 |
| CNP ASSURANCES               | 13,151  | 20.02  | 263,283.02   |
| HANNOVER RUECK SE            | 4,927   | 127.80 | 629,670.60   |
| MAPFRE SA                    | 98,407  | 2.48   | 244,935.02   |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG   | 12,294  | 196.00 | 2,409,624.00 |
| NN GROUP NV                  | 25,277  | 37.39  | 945,107.03   |
| POSTE ITALIANE SPA           | 46,417  | 7.69   | 357,039.56   |
| SAMPO OYJ-A SHS              | 36,374  | 40.53  | 1,474,238.22 |
| SCOR SE                      | 13,432  | 41.33  | 555,144.56   |
| AROUNDTOWN SA                | 61,530  | 7.53   | 463,320.90   |
| DEUTSCHE WOHNEN SE           | 29,272  | 43.30  | 1,267,477.60 |
| VONOVIA SE                   | 40,988  | 43.41  | 1,779,289.08 |
| AMADEUS IT GROUP SA          | 35,996  | 65.70  | 2,364,937.20 |
| ATOS SE                      | 7,644   | 77.20  | 590,116.80   |
| CAPGEMINI SE                 | 13,231  | 97.36  | 1,288,170.16 |
| DASSAULT SYSTEMES SA         | 10,780  | 111.55 | 1,202,509.00 |
| SAP SE                       | 80,541  | 92.66  | 7,462,929.06 |
| WIRECARD AG                  | 9,630   | 167.40 | 1,612,062.00 |
| INGENICO GROUP               | 4,284   | 47.29  | 202,590.36   |
| NOKIA OYJ                    | 465,078 | 5.74   | 2,670,477.87 |
| 1&1 DRILLISCH AG             | 3,933   | 37.56  | 147,723.48   |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG      | 273,327 | 14.09  | 3,852,544.06 |
| ELISA OYJ                    | 11,171  | 39.01  | 435,780.71   |
| ILIAD SA                     | 2,411   | 101.55 | 244,837.05   |
| KONINKLIJKE KPN NV           | 278,292 | 2.52   | 701,574.13   |
| ORANGE                       | 164,454 | 13.48  | 2,216,839.92 |
| PROXIMUS                     | 13,891  | 23.05  | 320,187.55   |
| TELECOM ITALIA SPA           | 925,874 | 0.46   | 425,994.62   |
| TELECOM ITALIA-RSP           | 441,476 | 0.40   | 176,590.40   |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 67,973  | 3.03   | 206,230.08   |
| TELEFONICA SA                | 382,798 | 7.71   | 2,952,903.77 |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 9,786   | 35.97  | 352,002.42   |
| E.ON SE                      | 181,439 | 9.47   | 1,718,590.20 |
| EDF                          | 51,714  | 14.07  | 727,615.98   |

|                              |            |        |                                      |  |
|------------------------------|------------|--------|--------------------------------------|--|
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA  | 210,641    | 3.09   | 651,933.89                           |  |
| ENDESA SA                    | 27,806     | 21.33  | 593,101.98                           |  |
| ENEL SPA                     | 668,118    | 5.19   | 3,468,868.65                         |  |
| ENGIE                        | 152,983    | 13.92  | 2,130,288.27                         |  |
| FORTUM OYJ                   | 37,029     | 19.75  | 731,507.89                           |  |
| IBERDROLA SA                 | 499,167    | 7.07   | 3,530,109.02                         |  |
| INNOGY SE                    | 11,254     | 40.47  | 455,449.38                           |  |
| NATURGY ENERGY GROUP SA      | 27,494     | 23.51  | 646,383.94                           |  |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 36,318     | 19.75  | 717,280.50                           |  |
| RWE AG                       | 43,893     | 21.36  | 937,554.48                           |  |
| SUEZ                         | 28,710     | 11.36  | 326,289.15                           |  |
| TERNA SPA                    | 116,135    | 5.31   | 617,605.93                           |  |
| UNIPER SE                    | 16,310     | 24.82  | 404,814.20                           |  |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT         | 44,344     | 18.06  | 801,074.36                           |  |
| VERBUND AG                   | 5,672      | 42.70  | 242,194.40                           |  |
| ASML HOLDING NV              | 33,655     | 154.44 | 5,197,678.20                         |  |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG     | 93,467     | 19.71  | 1,842,234.57                         |  |
| STMICROELECTRONICS NV        | 58,532     | 14.37  | 841,104.84                           |  |
| ユーロ 小計                       | 16,067,647 |        | 295,055,910.51<br>(36,811,175,395)   |  |
| 合計                           | 92,036,887 |        | 304,150,572,543<br>(304,150,572,543) |  |

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

## (2)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 通貨         | 種類   | 銘柄                           | 口数      | 評価額          | 備考 |
|------------|------|------------------------------|---------|--------------|----|
| アメリカ<br>ドル | 投資証券 | AGNC INVESTMENT CORP         | 41,328  | 748,863.36   |    |
|            |      | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 8,577   | 1,075,641.57 |    |
|            |      | AMERICAN TOWER CORP          | 36,164  | 6,054,215.24 |    |
|            |      | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 106,538 | 1,098,406.78 |    |
|            |      | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 11,087  | 2,069,388.55 |    |
|            |      | BOSTON PROPERTIES INC        | 12,480  | 1,541,030.40 |    |
|            |      | BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A | 12,602  | 224,441.62   |    |
|            |      | CAMDEN PROPERTY TRUST        | 7,555   | 706,543.60   |    |
|            |      | CROWN CASTLE INTL CORP       | 34,020  | 3,868,074.00 |    |
|            |      | DIGITAL REALTY TRUST INC     | 16,923  | 1,762,868.91 |    |
|            |      | DUKE REALTY CORP             | 29,582  | 856,694.72   |    |
|            |      | EQUINIX INC                  | 6,573   | 2,428,329.12 |    |
|            |      | EQUITY RESIDENTIAL           | 30,146  | 2,130,417.82 |    |

|             |      |                              |           |                                  |  |
|-------------|------|------------------------------|-----------|----------------------------------|--|
|             |      | ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 5,295     | 1,391,631.90                     |  |
|             |      | EXTRA SPACE STORAGE INC      | 10,235    | 953,390.25                       |  |
|             |      | FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 6,024     | 773,843.04                       |  |
|             |      | HCP INC                      | 37,884    | 1,150,537.08                     |  |
|             |      | HOST HOTELS & RESORTS INC    | 62,059    | 1,085,411.91                     |  |
|             |      | INVITATION HOMES INC         | 25,975    | 561,319.75                       |  |
|             |      | IRON MOUNTAIN INC            | 22,541    | 812,603.05                       |  |
|             |      | KIMCO REALTY CORP            | 33,904    | 566,196.80                       |  |
|             |      | LIBERTY PROPERTY TRUST       | 12,966    | 591,508.92                       |  |
|             |      | MACERICH CO/THE              | 7,827     | 361,137.78                       |  |
|             |      | MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 9,077     | 917,412.39                       |  |
|             |      | NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | 13,112    | 666,614.08                       |  |
|             |      | PROLOGIS INC                 | 51,552    | 3,402,947.52                     |  |
|             |      | PUBLIC STORAGE               | 12,896    | 2,651,933.44                     |  |
|             |      | REALTY INCOME CORP           | 24,140    | 1,574,410.80                     |  |
|             |      | REGENCY CENTERS CORP         | 12,267    | 769,754.25                       |  |
|             |      | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 25,356    | 4,490,801.16                     |  |
|             |      | SL GREEN REALTY CORP         | 7,274     | 649,059.02                       |  |
|             |      | UDR INC                      | 21,222    | 900,237.24                       |  |
|             |      | VENTAS INC                   | 29,180    | 1,821,707.40                     |  |
|             |      | VEREIT INC                   | 83,590    | 640,299.40                       |  |
|             |      | VORNADO REALTY TRUST         | 14,355    | 950,301.00                       |  |
|             |      | WELLTOWER INC                | 31,060    | 2,327,636.40                     |  |
|             |      | WEYERHAEUSER CO              | 62,240    | 1,599,568.00                     |  |
|             |      | WP CAREY INC                 | 12,750    | 915,195.00                       |  |
| アメリカドル合計    |      |                              | 988,356   | 57,090,373.27<br>(6,242,832,317) |  |
| カナダドル       | 投資証券 | H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 12,200    | 270,230.00                       |  |
|             |      | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 13,900    | 345,971.00                       |  |
|             |      | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 5,700     | 189,183.00                       |  |
| カナダドル合計     |      |                              | 31,800    | 805,384.00<br>(66,629,418)       |  |
| オーストラリアドル   | 投資証券 | DEXUS                        | 81,515    | 951,280.05                       |  |
|             |      | GOODMAN GROUP                | 136,825   | 1,625,481.00                     |  |
|             |      | GPT GROUP                    | 158,264   | 906,852.72                       |  |
|             |      | MIRVAC GROUP                 | 333,821   | 794,493.98                       |  |
|             |      | SCENTRE GROUP                | 441,357   | 1,761,014.43                     |  |
|             |      | STOCKLAND                    | 199,333   | 763,445.39                       |  |
|             |      | VICINITY CENTRES             | 265,261   | 694,983.82                       |  |
| オーストラリアドル合計 |      |                              | 1,616,376 | 7,497,551.39<br>(589,007,637)    |  |
|             | 投資証券 | BRITISH LAND CO PLC          | 80,363    | 459,837.08                       |  |

|                  |      |                              |         |                                  |
|------------------|------|------------------------------|---------|----------------------------------|
| イギリス<br>ポンド      |      | HAMMERSON PLC                | 56,883  | 203,129.19                       |
|                  |      | LAND SECURITIES GROUP PLC    | 60,292  | 514,652.51                       |
|                  |      | SEGRO PLC                    | 79,689  | 511,603.38                       |
| イギリスポンド合計        |      |                              | 277,227 | 1,689,222.16<br>(243,839,218)    |
| 香港ドル             | 投資証券 | LINK REIT                    | 174,500 | 14,500,950.00                    |
| 香港ドル合計           |      |                              | 174,500 | 14,500,950.00<br>(202,143,243)   |
| シンガ<br>ポール<br>ドル | 投資証券 | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 227,200 | 615,712.00                       |
|                  |      | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST  | 207,200 | 393,680.00                       |
|                  |      | CAPITALAND MALL TRUST        | 189,400 | 446,984.00                       |
|                  |      | SUNTEC REIT                  | 173,200 | 334,276.00                       |
| シンガポールドル合計       |      |                              | 797,000 | 1,790,652.00<br>(144,774,214)    |
| ユーロ              | 投資証券 | COVIVIO                      | 3,966   | 348,016.50                       |
|                  |      | GECINA SA                    | 3,712   | 453,235.20                       |
|                  |      | ICADE                        | 3,212   | 232,227.60                       |
|                  |      | KLEPIERRE                    | 15,586  | 446,383.04                       |
|                  |      | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    | 11,383  | 1,737,728.78                     |
| ユーロ合計            |      |                              | 37,859  | 3,217,591.12<br>(401,426,668)    |
| 合計               |      |                              |         | 7,890,652,715<br>(7,890,652,715) |

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

| 種類        | 銘柄数  | 組入株式<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|-----------|------|--------------|----------------|-------------------------|
| アメリカドル    | 株式   | 594銘柄        | 97.06%         | 65.94%                  |
|           | 投資証券 | 38銘柄         |                | 2.00%                   |
| カナダドル     | 株式   | 88銘柄         | 99.44%         | 3.80%                   |
|           | 投資証券 | 3銘柄          |                | 0.02%                   |
| オーストラリアドル | 株式   | 61銘柄         | 92.85%         | 2.45%                   |
|           | 投資証券 | 7銘柄          |                | 0.19%                   |
| イギリスポンド   | 株式   | 92銘柄         | 98.77%         | 6.30%                   |
|           | 投資証券 | 4銘柄          |                | 0.08%                   |
| スイスフラン    | 株式   | 38銘柄         | 100.00%        | 3.27%                   |
| 香港ドル      | 株式   | 39銘柄         | 95.27%         | 1.30%                   |
|           | 投資証券 | 1銘柄          |                | 0.06%                   |
| シンガポールドル  | 株式   | 21銘柄         | 91.12%         | 0.48%                   |

|            |      |       |         |       |        |
|------------|------|-------|---------|-------|--------|
|            | 投資証券 | 4銘柄   |         | 8.88% | 0.05%  |
| ニュージーランドドル | 株式   | 7銘柄   | 100.00% |       | 0.09%  |
| スウェーデンクローネ | 株式   | 32銘柄  | 100.00% |       | 1.02%  |
| ノルウェークローネ  | 株式   | 10銘柄  | 100.00% |       | 0.28%  |
| デンマーククローネ  | 株式   | 17銘柄  | 100.00% |       | 0.65%  |
| イスラエルシェケル  | 株式   | 8銘柄   | 100.00% |       | 0.11%  |
| ユーロ        | 株式   | 239銘柄 | 98.92%  |       | 11.80% |
|            | 投資証券 | 5銘柄   |         | 1.08% | 0.13%  |

## 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）

[平成31年 1月28日現在]

|             |                |
|-------------|----------------|
| 資産の部        |                |
| 流動資産        |                |
| 預金          | 2,509,474,422  |
| コール・ローン     | 258,636,656    |
| 株式          | 75,090,138,407 |
| 投資証券        | 267,405,005    |
| 派生商品評価勘定    | 212,424,220    |
| 未収入金        | 267,580        |
| 未収配当金       | 77,508,507     |
| 差入委託証拠金     | 662,993,158    |
| 流動資産合計      | 79,078,847,955 |
| 資産合計        | 79,078,847,955 |
| 負債の部        |                |
| 流動負債        |                |
| 派生商品評価勘定    | 283,585        |
| 未払金         | 7,452          |
| 未払解約金       | 136,499,706    |
| 未払利息        | 493            |
| その他未払費用     | 264            |
| 流動負債合計      | 136,791,500    |
| 負債合計        | 136,791,500    |
| 純資産の部       |                |
| 元本等         |                |
| 元本          | 33,164,110,297 |
| 剰余金         |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 45,777,946,158 |
| 元本等合計       | 78,942,056,455 |
| 純資産合計       | 78,942,056,455 |

[平成31年 1月28日現在]

負債純資産合計

79,078,847,955

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

|                              | [平成31年 1月28日現在] |
|------------------------------|-----------------|
| 1. 期首                        | 平成30年 1月27日     |
| 期首元本額                        | 25,769,515,964円 |
| 期中追加設定元本額                    | 12,651,640,432円 |
| 期中一部解約元本額                    | 5,257,046,099円  |
| 元本の内訳                        |                 |
| eMAXIS 新興国株式インデックス           | 13,250,756,688円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型)          | 1,499,116,501円  |
| eMAXIS バランス(波乗り型)            | 130,797,535円    |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)  | 262,623,212円    |
| コアバランス                       | 98,828円         |
| 海外株式セレクション(ラップ向け)            | 56,981,504円     |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)     | 1,084,648,393円  |
| eMAXIS Slim 新興国株式インデックス      | 5,244,431,485円  |
| つみたて新興国株式                    | 610,804,503円    |
| つみたて8資産均等バランス                | 297,529,556円    |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s        | 520,562円        |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s        | 736,350円        |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s        | 1,719,237円      |
| eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本)      | 205,630,056円    |
| eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)    | 108,033,195円    |
| eMAXIS Slim 全世界株式(オール・カントリー) | 57,635,261円     |

|                                 | [平成31年 1月28日現在] |
|---------------------------------|-----------------|
| 三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド         | 7,617,227,329円  |
| 新興国株式インデックスオープン                 | 339,540,731円    |
| eMAXIS 全世界株式インデックス              | 418,810,861円    |
| 新興国株式インデックスファンド（ラップ向け）          | 6,515,584円      |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）       | 13,904,243円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）      | 87,146,873円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）         | 74,440,123円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）        | 382,422,048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） | 1,395,662,260円  |
| アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）   | 1,397,806円      |
| アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）   | 6,537,849円      |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）      | 8,441,724円      |
| 合計                              | 33,164,110,297円 |
| 2. 受益権の総数                       | 33,164,110,297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 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日   |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。  |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、新株予約権証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用してしております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |

|                  |  |
|------------------|--|
| 区分               | 自 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日   |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

|                           |  |
|---------------------------|--|
| 区分                        | [平成31年 1月28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<br/>         売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引<br/>         デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品<br/>         上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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   | [平成31年 1月28日現在]    |
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式   | 5,291,010,121      |
| 投資証券 | 25,029,749         |
| 合計   | 5,316,039,870      |

(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

[平成31年 1月28日現在]



| 区分   | 種類             | 契約額等（円）       |       | 時価（円）         | 評価損益（円）     |
|------|----------------|---------------|-------|---------------|-------------|
|      |                |               | うち1年超 |               |             |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 3,471,824,379 |       | 3,684,233,290 | 212,408,911 |
|      | 合計             | 3,471,824,379 |       | 3,684,233,290 | 212,408,911 |

## （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

[平成31年 1月28日現在]

| 区分        | 種類                     | 契約額等（円）     |       | 時価（円）       | 評価損益（円） |
|-----------|------------------------|-------------|-------|-------------|---------|
|           |                        |             | うち1年超 |             |         |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引<br>買建<br>アメリカドル | 212,375,176 |       | 212,106,900 | 268,276 |
|           | 合計                     | 212,375,176 |       | 212,106,900 | 268,276 |

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

|           | [平成31年 1月28日現在] |
|-----------|-----------------|
| 1口当たり純資産額 | 2.3803円         |

|              |                 |
|--------------|-----------------|
|              | [平成31年 1月28日現在] |
| (1万口当たり純資産額) | (23,803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 PAO -SPON ADR        | 714,295   | 4.86         | 3,473,616.58 |    |
|                     | INNER MONGOLIA YITAI COAL-B  | 156,900   | 1.14         | 179,964.30   |    |
|                     | LUKOIL PJSC-SPON ADR         | 65,288    | 78.86        | 5,148,611.68 |    |
|                     | NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S | 12,297    | 180.30       | 2,217,149.10 |    |
|                     | ROSNEFT OIL CO PJSC          | 156,740   | 6.29         | 987,217.81   |    |
|                     | SURGUTNEFTEGAS PJSC          | 1,039,600 | 0.41         | 435,495.92   |    |
|                     | SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE    | 959,500   | 0.61         | 592,511.49   |    |
|                     | TATNEFT PJSC                 | 205,670   | 12.15        | 2,499,747.69 |    |
|                     | TRANSNEFT PJSC               | 62        | 2,563.49     | 158,936.77   |    |
|                     | ALROSA PJSC                  | 353,300   | 1.53         | 540,937.45   |    |
|                     | CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR | 24,738    | 15.49        | 383,191.62   |    |
|                     | MAGNITOGORS-SPON GDR REGS    | 20,302    | 8.85         | 179,672.70   |    |
|                     | MMC NORILSK NICKEL PJSC      | 8,676     | 202.52       | 1,757,096.68 |    |
|                     | NOVOLIPETSK STEEL PJSC       | 152,840   | 2.26         | 346,043.83   |    |
|                     | PHOSAGRO PJSC-GDR REG S      | 14,167    | 13.70        | 194,087.90   |    |
|                     | POLYUS PJSC-REG S-GDR        | 7,243     | 41.20        | 298,411.60   |    |
|                     | SEVERSTAL PJSC               | 26,850    | 14.46        | 388,470.11   |    |
|                     | SOUTHERN COPPER CORP         | 12,339    | 32.24        | 397,809.36   |    |
|                     | 51JOB INC-ADR                | 3,367     | 68.00        | 228,956.00   |    |
|                     | DP WORLD LTD                 | 20,405    | 16.40        | 334,642.00   |    |
|                     | HUAZHU GROUP LTD-ADR         | 17,907    | 31.65        | 566,756.55   |    |
|                     | NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR | 19,206    | 77.49        | 1,488,272.94 |    |
|                     | TAL EDUCATION GROUP- ADR     | 46,569    | 30.60        | 1,425,011.40 |    |
|                     | YUM CHINA HOLDINGS INC       | 48,123    | 35.41        | 1,704,035.43 |    |
|                     | 58.COM INC-ADR               | 13,061    | 61.80        | 807,169.80   |    |
|                     | AUTOHOME INC-ADR             | 7,908     | 76.02        | 601,166.16   |    |
|                     | BAIDU INC - SPON ADR         | 37,265    | 167.10       | 6,226,981.50 |    |
|                     | MOMO INC-SPON ADR            | 19,736    | 31.05        | 612,802.80   |    |
| NETEASE INC-ADR     | 10,513                       | 242.59    | 2,550,348.67 |              |    |
| SINA CORP           | 8,220                        | 58.93     | 484,404.60   |              |    |
| WEIBO CORP-SPON ADR | 7,757                        | 58.19     | 451,379.83   |              |    |

|         |                              |             |        |                                  |  |
|---------|------------------------------|-------------|--------|----------------------------------|--|
|         | YY INC-ADR                   | 6,146       | 73.87  | 454,005.02                       |  |
|         | ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR | 173,808     | 159.21 | 27,671,971.68                    |  |
|         | BAOZUN INC-SPN ADR           | 4,457       | 34.44  | 153,499.08                       |  |
|         | CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR  | 54,090      | 32.31  | 1,747,647.90                     |  |
|         | JD.COM INC-ADR               | 98,144      | 23.63  | 2,319,142.72                     |  |
|         | VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR   | 62,016      | 7.62   | 472,561.92                       |  |
|         | MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS    | 48,010      | 15.79  | 758,317.95                       |  |
|         | X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR | 17,859      | 27.50  | 491,122.50                       |  |
|         | HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR | 7,038       | 22.28  | 156,806.64                       |  |
|         | COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG | 170,593     | 4.84   | 825,670.12                       |  |
|         | CREDICORP LTD                | 9,167       | 236.23 | 2,165,520.41                     |  |
|         | SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR | 358,117     | 13.06  | 4,678,798.60                     |  |
|         | VTB BANK PJSC                | 397,100,000 | 0.00   | 223,249.62                       |  |
|         | MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ | 159,120     | 1.39   | 221,478.30                       |  |
|         | NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS   | 4,424       | 44.81  | 198,239.44                       |  |
|         | SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B | 105,800     | 1.35   | 142,830.00                       |  |
|         | GDS HOLDINGS LTD - ADR       | 8,317       | 26.49  | 220,317.33                       |  |
|         | MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR    | 70,176      | 8.31   | 583,162.56                       |  |
|         | INTER RAO UES PJSC           | 4,170,000   | 0.05   | 245,515.83                       |  |
|         | アメリカドル 小計                    | 406,818,126 |        | 81,390,757.89<br>(8,900,079,375) |  |
| イギリスポンド | POLYMETAL INTERNATIONAL PLC  | 22,720      | 8.40   | 190,848.00                       |  |
|         | イギリスポンド 小計                   | 22,720      |        | 190,848.00<br>(27,548,908)       |  |
| 香港ドル    | CHINA COAL ENERGY CO-H       | 317,000     | 3.30   | 1,046,100.00                     |  |
|         | CHINA OILFIELD SERVICES-H    | 218,000     | 7.94   | 1,730,920.00                     |  |
|         | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 3,420,000   | 6.30   | 21,546,000.00                    |  |
|         | CHINA SHENHUA ENERGY CO-H    | 452,500     | 19.68  | 8,905,200.00                     |  |
|         | CNOOC LTD                    | 2,402,000   | 13.06  | 31,370,120.00                    |  |
|         | KUNLUN ENERGY CO LTD         | 406,000     | 8.42   | 3,418,520.00                     |  |
|         | PETROCHINA CO LTD-H          | 2,857,000   | 5.04   | 14,399,280.00                    |  |
|         | YANZHOU COAL MINING CO-H     | 212,000     | 7.08   | 1,500,960.00                     |  |
|         | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 566,000     | 2.83   | 1,601,780.00                     |  |
|         | ANGANG STEEL CO LTD-H        | 108,000     | 5.63   | 608,040.00                       |  |
|         | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H  | 166,500     | 40.05  | 6,668,325.00                     |  |
|         | BBMG CORP-H                  | 223,000     | 2.61   | 582,030.00                       |  |
|         | CHINA HONGQIAO GROUP LTD     | 290,000     | 5.05   | 1,464,500.00                     |  |
|         | CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H    | 540,000     | 2.93   | 1,582,200.00                     |  |
|         | CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 520,000     | 5.93   | 3,083,600.00                     |  |
|         | CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD  | 148,000     | 5.09   | 753,320.00                       |  |
|         | CHINA RESOURCES CEMENT       | 296,000     | 7.57   | 2,240,720.00                     |  |
|         | CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD | 189,600     | 3.80   | 720,480.00                       |  |

|                              |         |       |              |
|------------------------------|---------|-------|--------------|
| JIANGXI COPPER CO LTD-H      | 149,000 | 9.40  | 1,400,600.00 |
| LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN | 243,000 | 7.05  | 1,713,150.00 |
| MAANSHAN IRON & STEEL-H      | 232,000 | 3.60  | 835,200.00   |
| MMG LTD                      | 412,000 | 2.71  | 1,116,520.00 |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS  | 248,000 | 7.83  | 1,941,840.00 |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H | 385,000 | 3.66  | 1,409,100.00 |
| ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H  | 155,500 | 7.52  | 1,169,360.00 |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H  | 666,000 | 2.75  | 1,831,500.00 |
| AVICHINA INDUSTRY & TECH-H   | 285,000 | 5.20  | 1,482,000.00 |
| BOC AVIATION LTD             | 31,000  | 63.25 | 1,960,750.00 |
| CHINA COMMUNICATIONS CONST-H | 562,000 | 7.80  | 4,383,600.00 |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS | 211,500 | 25.10 | 5,308,650.00 |
| CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H | 268,500 | 10.84 | 2,910,540.00 |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H    | 487,000 | 7.25  | 3,530,750.00 |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT | 306,000 | 7.24  | 2,215,440.00 |
| CITIC LTD                    | 802,000 | 11.96 | 9,591,920.00 |
| CRRG CORP LTD - H            | 554,550 | 7.85  | 4,353,217.50 |
| FOSUN INTERNATIONAL LTD      | 365,000 | 11.04 | 4,029,600.00 |
| FULLSHARE HOLDINGS LTD       | 875,000 | 1.88  | 1,645,000.00 |
| HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS  | 79,000  | 17.76 | 1,403,040.00 |
| METALLURGICAL CORP OF CHIN-H | 467,000 | 2.07  | 966,690.00   |
| SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H | 428,000 | 2.74  | 1,172,720.00 |
| SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD | 60,000  | 16.40 | 984,000.00   |
| SINOPEC ENGINEERING GROUP-H  | 191,500 | 7.68  | 1,470,720.00 |
| SINOTRUK HONG KONG LTD       | 95,500  | 12.66 | 1,209,030.00 |
| WEICHAI POWER CO LTD-H       | 285,800 | 10.20 | 2,915,160.00 |
| XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H  | 58,800  | 8.26  | 485,688.00   |
| ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRI-H | 70,800  | 43.65 | 3,090,420.00 |
| CHINA EVERBRIGHT INTL LTD    | 442,111 | 7.60  | 3,360,043.60 |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD | 123,000 | 11.90 | 1,463,700.00 |
| GREENTOWN SERVICE GROUP CO L | 122,000 | 6.81  | 830,820.00   |
| AIR CHINA LTD-H              | 214,000 | 7.56  | 1,617,840.00 |
| BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H | 208,000 | 7.47  | 1,553,760.00 |
| CAR INC                      | 76,000  | 6.40  | 486,400.00   |
| CHINA EASTERN AIRLINES CO-H  | 144,000 | 4.73  | 681,120.00   |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDING | 198,000 | 15.46 | 3,061,080.00 |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H | 220,000 | 5.43  | 1,194,600.00 |
| COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H | 112,000 | 4.32  | 483,840.00   |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H | 440,500 | 3.20  | 1,409,600.00 |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD     | 248,000 | 8.05  | 1,996,400.00 |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H     | 140,000 | 11.22 | 1,570,800.00 |
| SHENZHEN INTL HOLDINGS       | 130,500 | 15.24 | 1,988,820.00 |

|                              |           |        |                |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|
| SINOTRANS LIMITED-H          | 205,000   | 3.64   | 746,200.00     |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H     | 196,000   | 7.89   | 1,546,440.00   |
| BAIC MOTOR CORP LTD-H        | 262,000   | 5.02   | 1,315,240.00   |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE  | 374,000   | 7.26   | 2,715,240.00   |
| BYD CO LTD-H                 | 83,000    | 46.80  | 3,884,400.00   |
| CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT | 474,000   | 3.93   | 1,862,820.00   |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H  | 334,000   | 8.24   | 2,752,160.00   |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H | 59,600    | 26.80  | 1,597,280.00   |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 649,000   | 13.38  | 8,683,620.00   |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H   | 476,000   | 5.54   | 2,637,040.00   |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H | 392,945   | 8.74   | 3,434,339.30   |
| NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD | 99,000    | 11.90  | 1,178,100.00   |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD     | 147,000   | 37.50  | 5,512,500.00   |
| HAIER ELECTRONICS GROUP CO   | 183,000   | 21.65  | 3,961,950.00   |
| HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD  | 2,356,000 | 0.26   | 612,560.00     |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 102,000   | 91.30  | 9,312,600.00   |
| CHINA TRAVEL INTL INV HK     | 216,000   | 2.27   | 490,320.00     |
| ALIBABA PICTURES GROUP LTD   | 1,950,000 | 1.31   | 2,554,500.00   |
| CHINA LITERATURE LTD         | 24,600    | 39.90  | 981,540.00     |
| TENCENT HOLDINGS LTD         | 765,900   | 343.80 | 263,316,420.00 |
| GOME RETAIL HOLDINGS LTD     | 1,128,000 | 0.68   | 767,040.00     |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS    | 61,500    | 14.66  | 901,590.00     |
| SUN ART RETAIL GROUP LTD     | 315,000   | 7.82   | 2,463,300.00   |
| CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS  | 348,000   | 2.80   | 974,400.00     |
| CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS | 372,000   | 0.42   | 156,240.00     |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO       | 365,000   | 25.25  | 9,216,250.00   |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDING | 188,000   | 27.55  | 5,179,400.00   |
| DALI FOODS GROUP CO LTD      | 286,000   | 5.16   | 1,475,760.00   |
| TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO | 286,000   | 10.44  | 2,985,840.00   |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-H    | 42,000    | 34.60  | 1,453,200.00   |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS | 204,000   | 6.97   | 1,421,880.00   |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 651,000   | 6.20   | 4,036,200.00   |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING  | 61,000    | 23.05  | 1,406,050.00   |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD     | 99,500    | 57.85  | 5,756,075.00   |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION T | 490,000   | 6.97   | 3,415,300.00   |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H | 268,000   | 6.20   | 1,661,600.00   |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H   | 115,900   | 16.86  | 1,954,074.00   |
| SINOPHARM GROUP CO-H         | 159,200   | 35.15  | 5,595,880.00   |
| 3SBIO INC                    | 147,000   | 12.18  | 1,790,460.00   |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING | 166,000   | 7.78   | 1,291,480.00   |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC | 235,000   | 11.26  | 2,646,100.00   |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE ME | 302,000   | 5.11   | 1,543,220.00   |

|                              |            |       |               |
|------------------------------|------------|-------|---------------|
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT | 622,000    | 13.14 | 8,173,080.00  |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP       | 122,000    | 11.58 | 1,412,760.00  |
| LUYE PHARMA GROUP LTD        | 113,500    | 5.77  | 654,895.00    |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H | 68,000     | 23.40 | 1,591,200.00  |
| SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS  | 372,000    | 1.62  | 602,640.00    |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL       | 972,000    | 6.09  | 5,919,480.00  |
| SSY GROUP LTD                | 224,000    | 6.34  | 1,420,160.00  |
| TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H | 98,000     | 10.54 | 1,032,920.00  |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC    | 67,500     | 64.00 | 4,320,000.00  |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 3,869,000  | 3.70  | 14,315,300.00 |
| BANK OF CHINA LTD-H          | 10,649,000 | 3.59  | 38,229,910.00 |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H  | 1,126,900  | 6.48  | 7,302,312.00  |
| CHINA CITIC BANK CORP LTD-H  | 1,214,000  | 4.93  | 5,985,020.00  |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H    | 12,898,550 | 6.82  | 87,968,111.00 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 288,000    | 3.71  | 1,068,480.00  |
| CHINA MERCHANTS BANK-H       | 512,050    | 32.60 | 16,692,830.00 |
| CHINA MINSHENG BANKING COR-H | 810,320    | 5.85  | 4,740,372.00  |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H | 302,000    | 4.54  | 1,371,080.00  |
| IND & COMM BK OF CHINA-H     | 9,313,350  | 5.97  | 55,600,699.50 |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H | 389,000    | 4.53  | 1,762,170.00  |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H | 1,315,000  | 1.98  | 2,603,700.00  |
| CHINA DING YI FENG HOLDINGS  | 120,000    | 26.45 | 3,174,000.00  |
| CHINA EVERBRIGHT LTD         | 140,000    | 14.28 | 1,999,200.00  |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-H | 466,500    | 4.01  | 1,870,665.00  |
| CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H | 1,381,000  | 1.52  | 2,099,120.00  |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H | 143,600    | 15.08 | 2,165,488.00  |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H    | 320,500    | 15.70 | 5,031,850.00  |
| FAR EAST HORIZON LTD         | 287,000    | 7.93  | 2,275,910.00  |
| GF SECURITIES CO LTD-H       | 186,800    | 11.48 | 2,144,464.00  |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H | 87,400     | 17.10 | 1,494,540.00  |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H  | 452,400    | 8.87  | 4,012,788.00  |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H   | 241,000    | 14.28 | 3,441,480.00  |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H    | 984,000    | 19.68 | 19,365,120.00 |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 352,000    | 27.40 | 9,644,800.00  |
| CHINA REINSURANCE GROUP CO-H | 783,000    | 1.71  | 1,338,930.00  |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLD | 211,800    | 20.95 | 4,437,210.00  |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H | 115,000    | 30.35 | 3,490,250.00  |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H | 970,000    | 3.19  | 3,094,300.00  |
| PICC PROPERTY & CASUALTY-H   | 916,000    | 7.97  | 7,300,520.00  |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 691,500    | 73.40 | 50,756,100.00 |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H | 31,600     | 25.80 | 815,280.00    |
| AGILE GROUP HOLDINGS LTD     | 200,000    | 9.60  | 1,920,000.00  |

|                              |           |       |               |
|------------------------------|-----------|-------|---------------|
| CHINA EVERGRANDE GROUP       | 358,000   | 23.90 | 8,556,200.00  |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP  | 722,000   | 3.74  | 2,700,280.00  |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 524,000   | 28.20 | 14,776,800.00 |
| CHINA RESOURCES LAND LTD     | 368,000   | 29.30 | 10,782,400.00 |
| CHINA VANKE CO LTD-H         | 163,151   | 29.80 | 4,861,899.80  |
| CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD   | 462,000   | 4.59  | 2,120,580.00  |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO   | 1,015,232 | 10.28 | 10,436,584.96 |
| FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD | 290,000   | 6.46  | 1,873,400.00  |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS     | 90,500    | 6.35  | 574,675.00    |
| GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H | 110,800   | 14.30 | 1,584,440.00  |
| JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP  | 140,000   | 3.70  | 518,000.00    |
| KAISA GROUP HOLDINGS LTD     | 230,000   | 2.43  | 558,900.00    |
| KWG GROUP HOLDINGS LTD       | 209,000   | 7.62  | 1,592,580.00  |
| LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L | 200,000   | 10.12 | 2,024,000.00  |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD   | 190,000   | 22.80 | 4,332,000.00  |
| SHENZHEN INVESTMENT LTD      | 526,000   | 2.72  | 1,430,720.00  |
| SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD | 155,500   | 19.90 | 3,094,450.00  |
| SHUI ON LAND LTD             | 374,500   | 1.94  | 726,530.00    |
| SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD | 346,000   | 3.72  | 1,287,120.00  |
| SOHO CHINA LTD               | 317,500   | 3.09  | 981,075.00    |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD     | 322,000   | 27.80 | 8,951,600.00  |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD       | 1,056,000 | 1.56  | 1,647,360.00  |
| YUZHOU PROPERTIES CO         | 172,000   | 3.71  | 638,120.00    |
| KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR  | 334,000   | 7.59  | 2,535,060.00  |
| KINGSOFT CORP LTD            | 90,000    | 14.64 | 1,317,600.00  |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H   | 118,000   | 20.35 | 2,401,300.00  |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN | 99,000    | 48.40 | 4,791,600.00  |
| BYD ELECTRONIC INTL CO LTD   | 73,500    | 9.61  | 706,335.00    |
| CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H | 237,000   | 6.17  | 1,462,290.00  |
| KINGBOARD HOLDINGS LTD       | 84,000    | 27.25 | 2,289,000.00  |
| KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD | 112,500   | 8.14  | 915,750.00    |
| LEGEND HOLDINGS CORP-H       | 54,900    | 21.25 | 1,166,625.00  |
| LENOVO GROUP LTD             | 924,000   | 5.74  | 5,303,760.00  |
| MEITU INC                    | 209,000   | 2.52  | 526,680.00    |
| SUNNY OPTICAL TECH           | 98,900    | 76.55 | 7,570,795.00  |
| ZTE CORP-H                   | 111,931   | 15.82 | 1,770,748.42  |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H | 304,000   | 7.25  | 2,204,000.00  |
| CHINA MOBILE LTD             | 823,000   | 81.15 | 66,786,450.00 |
| CHINA TELECOM CORP LTD-H     | 1,842,000 | 4.34  | 7,994,280.00  |
| CHINA TOWER CORP LTD-H       | 5,136,000 | 1.73  | 8,885,280.00  |
| CHINA UNICOM HONG KONG LTD   | 838,000   | 9.07  | 7,600,660.00  |
| BEIJING ENTERPRISES HLDGS    | 65,500    | 44.50 | 2,914,750.00  |

|                |                              |             |        |                                      |  |
|----------------|------------------------------|-------------|--------|--------------------------------------|--|
|                | BEIJING ENTERPRISES WATER GR | 812,000     | 4.61   | 3,743,320.00                         |  |
|                | CGN POWER CO LTD-H           | 1,342,000   | 2.05   | 2,751,100.00                         |  |
|                | CHINA GAS HOLDINGS LTD       | 230,200     | 25.45  | 5,858,590.00                         |  |
|                | CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H | 424,000     | 6.00   | 2,544,000.00                         |  |
|                | CHINA POWER INTERNATIONAL    | 705,000     | 2.01   | 1,417,050.00                         |  |
|                | CHINA RESOURCES GAS GROUP LT | 124,000     | 32.20  | 3,992,800.00                         |  |
|                | CHINA RESOURCES POWER HOLDIN | 260,000     | 15.86  | 4,123,600.00                         |  |
|                | DATANG INTL POWER GEN CO-H   | 304,000     | 2.06   | 626,240.00                           |  |
|                | ENN ENERGY HOLDINGS LTD      | 106,600     | 74.65  | 7,957,690.00                         |  |
|                | GUANGDONG INVESTMENT LTD     | 404,000     | 15.24  | 6,156,960.00                         |  |
|                | HUADIAN POWER INTL CORP-H    | 286,000     | 3.73   | 1,066,780.00                         |  |
|                | HUANENG POWER INTL INC-H     | 532,000     | 5.12   | 2,723,840.00                         |  |
|                | HUANENG RENEWABLES CORP-H    | 722,000     | 2.34   | 1,689,480.00                         |  |
|                | TOWNGAS CHINA CO LTD         | 104,000     | 6.23   | 647,920.00                           |  |
|                | HANERGY THIN FILM POWER GROU | 960,000     | 3.91   | 3,753,600.00                         |  |
|                | HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD   | 51,000      | 16.98  | 865,980.00                           |  |
|                | SEMICONDUCTOR MANUFACTURING  | 370,400     | 7.39   | 2,737,256.00                         |  |
|                | XINYI SOLAR HOLDINGS LTD     | 464,000     | 3.39   | 1,572,960.00                         |  |
|                | 香港ドル 小計                      | 123,289,190 |        | 1,232,694,711.08<br>(17,183,764,272) |  |
| マレーシアリン<br>ギット | DIALOG GROUP BHD             | 464,580     | 3.07   | 1,426,260.60                         |  |
|                | PETRONAS DAGANGAN BHD        | 26,100      | 26.10  | 681,210.00                           |  |
|                | PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 303,300     | 8.69   | 2,635,677.00                         |  |
|                | PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN | 169,100     | 4.33   | 732,203.00                           |  |
|                | GAMUDA BHD                   | 286,200     | 2.74   | 784,188.00                           |  |
|                | HAP SENG CONSOLIDATED        | 97,000      | 9.88   | 958,360.00                           |  |
|                | IJM CORP BHD                 | 479,700     | 1.85   | 887,445.00                           |  |
|                | SIME DARBY BERHAD            | 350,900     | 2.30   | 807,070.00                           |  |
|                | AIRASIA GROUP BHD            | 215,200     | 3.09   | 664,968.00                           |  |
|                | MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD  | 120,400     | 8.20   | 987,280.00                           |  |
|                | MISC BHD                     | 159,000     | 6.68   | 1,062,120.00                         |  |
|                | WESTPORTS HOLDINGS BHD       | 148,400     | 3.90   | 578,760.00                           |  |
|                | GENTING BHD                  | 292,300     | 6.88   | 2,011,024.00                         |  |
|                | GENTING MALAYSIA BHD         | 373,800     | 3.18   | 1,188,684.00                         |  |
|                | BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD | 17,300      | 38.40  | 664,320.00                           |  |
|                | FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD  | 15,700      | 34.32  | 538,824.00                           |  |
|                | GENTING PLANTATIONS BHD      | 39,200      | 10.04  | 393,568.00                           |  |
|                | IOI CORP BHD                 | 241,900     | 4.67   | 1,129,673.00                         |  |
|                | KUALA LUMPUR KEPONG BHD      | 59,300      | 24.70  | 1,464,710.00                         |  |
|                | NESTLE (MALAYSIA) BERHAD     | 7,300       | 148.80 | 1,086,240.00                         |  |
|                | PPB GROUP BERHAD             | 81,940      | 18.08  | 1,481,475.20                         |  |
|                | QL RESOURCES BHD             | 80,800      | 6.85   | 553,480.00                           |  |



|       |                              |            |        |               |                 |
|-------|------------------------------|------------|--------|---------------|-----------------|
|       | SIME DARBY PLANTATION BHD    | 294,900    | 5.18   | 1,527,582.00  |                 |
|       | HARTALEGA HOLDINGS BHD       | 163,600    | 5.74   | 939,064.00    |                 |
|       | IHH HEALTHCARE BHD           | 349,200    | 5.57   | 1,945,044.00  |                 |
|       | TOP GLOVE CORP BHD           | 177,600    | 4.98   | 884,448.00    |                 |
|       | ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD   | 146,200    | 4.30   | 628,660.00    |                 |
|       | AMMB HOLDINGS BHD            | 231,900    | 4.49   | 1,041,231.00  |                 |
|       | CIMB GROUP HOLDINGS BHD      | 622,000    | 5.68   | 3,532,960.00  |                 |
|       | HONG LEONG BANK BERHAD       | 84,900     | 20.78  | 1,764,222.00  |                 |
|       | HONG LEONG FINANCIAL GROUP   | 33,300     | 19.80  | 659,340.00    |                 |
|       | MALAYAN BANKING BHD          | 523,600    | 9.66   | 5,057,976.00  |                 |
|       | PUBLIC BANK BERHAD           | 392,300    | 24.80  | 9,729,040.00  |                 |
|       | RHB BANK BHD                 | 137,949    | 5.49   | 757,340.01    |                 |
|       | IOI PROPERTIES GROUP BHD     | 172,800    | 1.57   | 271,296.00    |                 |
|       | SIME DARBY PROPERTY BHD      | 451,700    | 1.19   | 537,523.00    |                 |
|       | SP SETIA BHD                 | 266,900    | 2.56   | 683,264.00    |                 |
|       | AXIATA GROUP BERHAD          | 406,500    | 4.08   | 1,658,520.00  |                 |
|       | DIGI.COM BHD                 | 419,000    | 4.55   | 1,906,450.00  |                 |
|       | MAXIS BHD                    | 332,700    | 5.79   | 1,926,333.00  |                 |
|       | TELEKOM MALAYSIA BHD         | 135,500    | 2.84   | 384,820.00    |                 |
|       | PETRONAS GAS BHD             | 87,400     | 17.74  | 1,550,476.00  |                 |
|       | TENAGA NASIONAL BHD          | 420,700    | 13.64  | 5,738,348.00  |                 |
|       | YTL CORP BHD                 | 351,963    | 1.16   | 408,277.08    |                 |
|       | マレーシアリングット 小計                | 10,232,032 |        | 66,249,753.89 | (1,762,905,951) |
| タイバーツ | BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR     | 270,600    | 16.90  | 4,573,140.00  |                 |
|       | ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR     | 177,500    | 47.50  | 8,431,250.00  |                 |
|       | IRPC PCL - NVDR              | 1,525,500  | 5.90   | 9,000,450.00  |                 |
|       | PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR   | 189,600    | 124.50 | 23,605,200.00 |                 |
|       | PTT PCL-NVDR                 | 1,383,900  | 48.75  | 67,465,125.00 |                 |
|       | THAI OIL PCL-NVDR            | 162,300    | 71.00  | 11,523,300.00 |                 |
|       | INDORAMA VENTURES PCL-NVDR   | 230,900    | 46.25  | 10,679,125.00 |                 |
|       | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 335,561    | 67.00  | 22,482,587.00 |                 |
|       | SIAM CEMENT PCL-NVDR         | 52,050     | 452.00 | 23,526,600.00 |                 |
|       | AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR | 571,700    | 68.50  | 39,161,450.00 |                 |
|       | BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO | 1,078,000  | 10.40  | 11,211,200.00 |                 |
|       | BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR  | 781,800    | 9.90   | 7,739,820.00  |                 |
|       | MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | 290,400    | 38.00  | 11,035,200.00 |                 |
|       | HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR | 500,701    | 15.10  | 7,560,585.10  |                 |
|       | ROBINSON PCL-NVDR            | 75,800     | 68.50  | 5,192,300.00  |                 |
|       | BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR  | 171,500    | 48.75  | 8,360,625.00  |                 |
|       | CP ALL PCL-NVDR              | 665,000    | 77.25  | 51,371,250.00 |                 |
|       | CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR  | 466,500    | 27.25  | 12,712,125.00 |                 |

|         |                              |            |          |                                   |  |
|---------|------------------------------|------------|----------|-----------------------------------|--|
|         | THAI UNION GROUP PCL-NVDR    | 262,200    | 18.20    | 4,772,040.00                      |  |
|         | BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR | 501,900    | 24.10    | 12,095,790.00                     |  |
|         | BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR | 53,400     | 184.00   | 9,825,600.00                      |  |
|         | BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR  | 48,000     | 209.00   | 10,032,000.00                     |  |
|         | KASIKORNBANK PCL-NVDR        | 229,400    | 193.50   | 44,388,900.00                     |  |
|         | KRUNG THAI BANK - NVDR       | 408,600    | 20.10    | 8,212,860.00                      |  |
|         | SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR  | 240,200    | 130.50   | 31,346,100.00                     |  |
|         | TMB BANK PCL-NVDR            | 1,542,100  | 2.20     | 3,392,620.00                      |  |
|         | MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR   | 82,400     | 47.75    | 3,934,600.00                      |  |
|         | CENTRAL PATTANA PCL-NVDR     | 167,900    | 79.25    | 13,306,075.00                     |  |
|         | LAND & HOUSES PUB - NVDR     | 375,900    | 10.70    | 4,022,130.00                      |  |
|         | DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR  | 60,600     | 69.75    | 4,226,850.00                      |  |
|         | ADVANCED INFO SERVICE-NVDR   | 142,100    | 177.00   | 25,151,700.00                     |  |
|         | TRUE CORP PCL-NVDR           | 1,227,076  | 4.90     | 6,012,672.40                      |  |
|         | ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR  | 21,100     | 257.00   | 5,422,700.00                      |  |
|         | GLOW ENERGY PCL - NVDR       | 66,900     | 92.00    | 6,154,800.00                      |  |
|         | GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR | 54,200     | 85.25    | 4,620,550.00                      |  |
|         | タイパーツ 小計                     | 14,413,288 |          | 532,549,319.50<br>(1,847,946,138) |  |
| フィリピンペソ | ABOITIZ EQUITY VENTURES INC  | 263,980    | 62.30    | 16,445,954.00                     |  |
|         | ALLIANCE GLOBAL GROUP INC    | 559,300    | 14.38    | 8,042,734.00                      |  |
|         | DMCI HOLDINGS INC            | 571,900    | 12.00    | 6,862,800.00                      |  |
|         | JG SUMMIT HOLDINGS INC       | 382,290    | 64.65    | 24,715,048.50                     |  |
|         | SM INVESTMENTS CORP          | 33,035     | 989.00   | 32,671,615.00                     |  |
|         | INTL CONTAINER TERM SVCS INC | 48,840     | 107.50   | 5,250,300.00                      |  |
|         | JOLLIBEE FOODS CORP          | 52,150     | 323.60   | 16,875,740.00                     |  |
|         | UNIVERSAL ROBINA CORP        | 116,410    | 149.30   | 17,380,013.00                     |  |
|         | BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN | 135,691    | 91.15    | 12,368,234.65                     |  |
|         | BDO UNIBANK INC              | 268,580    | 136.50   | 36,661,170.00                     |  |
|         | METROPOLITAN BANK & TRUST    | 200,115    | 83.35    | 16,679,585.25                     |  |
|         | SECURITY BANK CORP           | 21,400     | 174.20   | 3,727,880.00                      |  |
|         | AYALA CORPORATION            | 34,425     | 921.50   | 31,722,637.50                     |  |
|         | GT CAPITAL HOLDINGS INC      | 13,939     | 1,020.00 | 14,217,780.00                     |  |
|         | METRO PACIFIC INVESTMENTS CO | 2,266,500  | 4.95     | 11,219,175.00                     |  |
|         | AYALA LAND INC               | 956,700    | 44.60    | 42,668,820.00                     |  |
|         | MEGAWORLD CORP               | 1,793,000  | 5.26     | 9,431,180.00                      |  |
|         | ROBINSONS LAND CO            | 304,700    | 23.00    | 7,008,100.00                      |  |
|         | SM PRIME HOLDINGS INC        | 1,388,300  | 39.90    | 55,393,170.00                     |  |
|         | GLOBE TELECOM INC            | 4,210      | 2,120.00 | 8,925,200.00                      |  |
|         | PLDT INC                     | 11,215     | 1,328.00 | 14,893,520.00                     |  |
|         | ABOITIZ POWER CORP           | 195,300    | 38.00    | 7,421,400.00                      |  |
|         | MANILA ELECTRIC COMPANY      | 34,020     | 372.00   | 12,655,440.00                     |  |

|                              |                               |            |                  |                                       |  |
|------------------------------|-------------------------------|------------|------------------|---------------------------------------|--|
|                              | フィリピンペソ 小計                    | 9,656,000  |                  | 413,237,496.90<br>(859,533,993)       |  |
| インドネシアルピア                    | ADARO ENERGY TBK PT           | 2,113,600  | 1,395.00         | 2,948,472,000.00                      |  |
|                              | BUKIT ASAM TBK PT             | 387,300    | 4,370.00         | 1,692,501,000.00                      |  |
|                              | UNITED TRACTORS TBK PT        | 224,000    | 26,425.00        | 5,919,200,000.00                      |  |
|                              | INDAH KIAT PULP & PAPER TBK   | 344,900    | 13,100.00        | 4,518,190,000.00                      |  |
|                              | INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA   | 258,200    | 20,100.00        | 5,189,820,000.00                      |  |
|                              | PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT  | 183,700    | 13,150.00        | 2,415,655,000.00                      |  |
|                              | SEMEN INDONESIA PERSERO TBK   | 441,500    | 13,200.00        | 5,827,800,000.00                      |  |
|                              | JASA MARGA (PERSERO) TBK PT   | 281,200    | 4,890.00         | 1,375,068,000.00                      |  |
|                              | ASTRA INTERNATIONAL TBK PT    | 2,672,900  | 8,425.00         | 22,519,182,500.00                     |  |
|                              | SURYA CITRA MEDIA PT TBK      | 866,400    | 1,960.00         | 1,698,144,000.00                      |  |
|                              | CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT | 1,007,200  | 8,150.00         | 8,208,680,000.00                      |  |
|                              | GUDANG GARAM TBK PT           | 61,900     | 84,650.00        | 5,239,835,000.00                      |  |
|                              | HM SAMPOERNA TBK PT           | 1,244,900  | 3,700.00         | 4,606,130,000.00                      |  |
|                              | INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T  | 283,800    | 10,750.00        | 3,050,850,000.00                      |  |
|                              | INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P  | 586,300    | 7,850.00         | 4,602,455,000.00                      |  |
|                              | UNILEVER INDONESIA TBK PT     | 202,000    | 49,050.00        | 9,908,100,000.00                      |  |
|                              | KALBE FARMA TBK PT            | 2,804,100  | 1,615.00         | 4,528,621,500.00                      |  |
|                              | BANK CENTRAL ASIA TBK PT      | 1,336,500  | 27,500.00        | 36,753,750,000.00                     |  |
|                              | BANK DANAMON INDONESIA TBK    | 401,400    | 9,050.00         | 3,632,670,000.00                      |  |
|                              | BANK MANDIRI PERSERO TBK PT   | 2,446,100  | 7,375.00         | 18,039,987,500.00                     |  |
|                              | BANK NEGARA INDONESIA PERSER  | 955,000    | 9,100.00         | 8,690,500,000.00                      |  |
|                              | BANK RAKYAT INDONESIA PERSER  | 7,561,000  | 3,780.00         | 28,580,580,000.00                     |  |
|                              | BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO  | 580,600    | 2,700.00         | 1,567,620,000.00                      |  |
|                              | BUMI SERPONG DAMAI PT         | 975,000    | 1,450.00         | 1,413,750,000.00                      |  |
|                              | PAKUWON JATI TBK PT           | 1,900,000  | 720.00           | 1,368,000,000.00                      |  |
|                              | TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER  | 6,815,800  | 3,880.00         | 26,445,304,000.00                     |  |
| TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE | 212,600                       | 4,930.00   | 1,048,118,000.00 |                                       |  |
| PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER | 1,314,400                     | 2,420.00   | 3,180,848,000.00 |                                       |  |
|                              | インドネシアルピア 小計                  | 38,462,300 |                  | 224,969,831,500.00<br>(1,754,764,685) |  |
| メキシコペソ                       | CEMEX SAB-CPO                 | 1,984,868  | 10.10            | 20,047,166.80                         |  |
|                              | GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B  | 481,670    | 45.22            | 21,781,117.40                         |  |
|                              | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV  | 18,960     | 257.05           | 4,873,668.00                          |  |
|                              | MEXICHEM SAB DE CV-*          | 150,098    | 49.10            | 7,369,811.80                          |  |
|                              | ALFA S.A.B.-A                 | 402,800    | 23.70            | 9,546,360.00                          |  |
|                              | GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1  | 54,300     | 73.65            | 3,999,195.00                          |  |
|                              | GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B  | 51,200     | 170.02           | 8,705,024.00                          |  |
|                              | GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B  | 27,295     | 342.23           | 9,341,167.85                          |  |
|                              | PROMOTORA Y OPERADORA DE INF  | 30,020     | 191.88           | 5,760,237.60                          |  |
|                              | ALSEA SAB DE CV               | 61,400     | 51.36            | 3,153,504.00                          |  |

|         |                              |            |        |                                   |  |
|---------|------------------------------|------------|--------|-----------------------------------|--|
|         | GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO  | 334,900    | 47.18  | 15,800,582.00                     |  |
|         | MEGACABLE HOLDINGS-CPO       | 34,500     | 88.47  | 3,052,215.00                      |  |
|         | EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1    | 26,000     | 123.95 | 3,222,700.00                      |  |
|         | WALMART DE MEXICO SAB DE CV  | 702,200    | 47.76  | 33,537,072.00                     |  |
|         | ARCA CONTINENTAL SAB DE CV   | 54,766     | 105.80 | 5,794,242.80                      |  |
|         | COCA-COLA FEMSA SAB-SER L    | 73,300     | 121.51 | 8,906,683.00                      |  |
|         | FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | 260,400    | 174.27 | 45,379,908.00                     |  |
|         | GRUMA S.A.B. -B              | 27,775     | 227.95 | 6,331,311.25                      |  |
|         | GRUPO BIMBO SAB- SERIES A    | 223,900    | 37.90  | 8,485,810.00                      |  |
|         | KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A   | 214,700    | 30.71  | 6,593,437.00                      |  |
|         | BANCO SANTANDER MEXICO-B     | 221,245    | 27.95  | 6,183,797.75                      |  |
|         | GRUPO FINANCIERO BANORTE-0   | 350,000    | 108.20 | 37,870,000.00                     |  |
|         | GRUPO FINANCIERO INBURSA-0   | 290,200    | 29.51  | 8,563,802.00                      |  |
|         | AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L | 4,513,100  | 15.06  | 67,967,286.00                     |  |
|         | INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N | 77,600     | 78.00  | 6,052,800.00                      |  |
|         | メキシコペソ 小計                    | 10,667,197 |        | 358,318,899.25<br>(2,063,916,859) |  |
| ブラジルリアル | COSAN SA                     | 19,200     | 43.44  | 834,048.00                        |  |
|         | PETROBRAS - PETROLEO BRAS    | 403,900    | 29.46  | 11,898,894.00                     |  |
|         | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | 521,000    | 25.54  | 13,306,340.00                     |  |
|         | ULTRAPAR PARTICIPACOES SA    | 48,900     | 57.71  | 2,822,019.00                      |  |
|         | BRASKEM SA-PREF A            | 23,500     | 49.45  | 1,162,075.00                      |  |
|         | CIA SIDERURGICA NACIONAL SA  | 73,800     | 10.37  | 765,306.00                        |  |
|         | GERDAU SA-PREF               | 146,600    | 15.99  | 2,344,134.00                      |  |
|         | KLABIN SA - UNIT             | 98,600     | 18.84  | 1,857,624.00                      |  |
|         | SUZANO PAPEL E CELULOSE SA   | 74,022     | 47.95  | 3,549,354.90                      |  |
|         | VALE SA                      | 426,130    | 56.15  | 23,927,199.50                     |  |
|         | EMBRAER SA                   | 88,900     | 19.67  | 1,748,663.00                      |  |
|         | WEG SA                       | 112,744    | 18.82  | 2,121,842.08                      |  |
|         | CCR SA                       | 174,600    | 14.28  | 2,493,288.00                      |  |
|         | LOCALIZA RENT A CAR          | 64,075     | 32.22  | 2,064,496.50                      |  |
|         | RUMO SA                      | 143,100    | 19.31  | 2,763,261.00                      |  |
|         | KROTON EDUCACIONAL SA        | 176,292    | 11.44  | 2,016,780.48                      |  |
|         | B2W CIA DIGITAL              | 24,000     | 45.61  | 1,094,640.00                      |  |
|         | LOJAS AMERICANAS SA-PREF     | 104,261    | 20.46  | 2,133,180.06                      |  |
|         | LOJAS RENNER S.A.            | 95,100     | 44.44  | 4,226,244.00                      |  |
|         | MAGAZINE LUIZA SA            | 10,000     | 167.48 | 1,674,800.00                      |  |
|         | PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA   | 46,700     | 26.66  | 1,245,022.00                      |  |
|         | ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC | 57,800     | 20.01  | 1,156,578.00                      |  |
|         | CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF   | 21,800     | 94.78  | 2,066,204.00                      |  |
|         | RAIA DROGASIL SA             | 32,500     | 62.29  | 2,024,425.00                      |  |
|         | AMBEV SA                     | 637,400    | 17.16  | 10,937,784.00                     |  |

|      |                              |            |           |                                   |  |
|------|------------------------------|------------|-----------|-----------------------------------|--|
|      | BRF SA                       | 72,200     | 24.19     | 1,746,518.00                      |  |
|      | JBS SA                       | 118,100    | 14.47     | 1,708,907.00                      |  |
|      | M DIAS BRANCO SA             | 12,800     | 47.06     | 602,368.00                        |  |
|      | NATURA COSMETICOS SA         | 27,600     | 46.45     | 1,282,020.00                      |  |
|      | HYPERA SA                    | 44,700     | 32.47     | 1,451,409.00                      |  |
|      | BANCO BRADESCO S.A.          | 140,477    | 38.68     | 5,433,650.36                      |  |
|      | BANCO BRADESCO SA-PREF       | 446,328    | 43.15     | 19,259,053.20                     |  |
|      | BANCO DO BRASIL S.A.         | 113,000    | 48.95     | 5,531,350.00                      |  |
|      | BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT  | 55,700     | 49.57     | 2,761,049.00                      |  |
|      | ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | 649,230    | 37.49     | 24,339,632.70                     |  |
|      | ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR | 591,207    | 13.20     | 7,803,932.40                      |  |
|      | B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO    | 277,475    | 31.65     | 8,782,083.75                      |  |
|      | BB SEGURIDADE PARTICIPACOES  | 98,100     | 29.99     | 2,942,019.00                      |  |
|      | IRB BRASIL RESSEGUROS SA     | 15,000     | 87.93     | 1,318,950.00                      |  |
|      | PORTO SEGURO SA              | 15,400     | 54.64     | 841,456.00                        |  |
|      | SUL AMERICA SA - UNITS       | 27,358     | 31.01     | 848,371.58                        |  |
|      | BR MALLS PARTICIPACOES SA    | 107,154    | 14.26     | 1,528,016.04                      |  |
|      | MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS    | 40,300     | 25.10     | 1,011,530.00                      |  |
|      | CIELO SA                     | 165,521    | 10.68     | 1,767,764.28                      |  |
|      | TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF  | 61,375     | 47.77     | 2,931,883.75                      |  |
|      | TIM PARTICIPACOES SA         | 107,577    | 12.55     | 1,350,091.35                      |  |
|      | CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B | 29,300     | 36.95     | 1,082,635.00                      |  |
|      | CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER | 29,400     | 33.98     | 999,012.00                        |  |
|      | CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF | 120,973    | 14.49     | 1,752,898.77                      |  |
|      | CIA SANEAMENTO BASICO DE SP  | 44,400     | 43.18     | 1,917,192.00                      |  |
|      | ENGIE BRASIL ENERGIA SA      | 24,750     | 42.00     | 1,039,500.00                      |  |
|      | EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD  | 20,600     | 83.99     | 1,730,194.00                      |  |
|      | ブラジルリアル 小計                   | 7,080,949  |           | 205,997,689.70<br>(5,971,873,024) |  |
| チリペソ | EMPRESAS COPEC SA            | 54,632     | 9,090.00  | 496,604,880.00                    |  |
|      | EMPRESAS CMPC SA             | 164,304    | 2,424.80  | 398,404,339.00                    |  |
|      | SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B | 16,633     | 28,384.00 | 472,111,072.00                    |  |
|      | LATAM AIRLINES GROUP SA      | 42,230     | 7,865.00  | 332,138,950.00                    |  |
|      | S.A.C.I. FALABELLA           | 101,072    | 5,270.00  | 532,649,440.00                    |  |
|      | CENCOSUD SA                  | 182,595    | 1,330.00  | 242,851,350.00                    |  |
|      | CIA CERVECERIAS UNIDAS SA    | 17,584     | 9,179.00  | 161,403,536.00                    |  |
|      | EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B  | 37,840     | 2,689.00  | 101,751,760.00                    |  |
|      | BANCO DE CHILE               | 3,289,136  | 103.00    | 338,781,008.00                    |  |
|      | BANCO DE CREDITO E INVERSION | 6,137      | 46,600.00 | 285,984,200.00                    |  |
|      | BANCO SANTANDER CHILE        | 9,045,763  | 53.49     | 483,857,862.00                    |  |
|      | ITAU CORPBANCA               | 19,865,237 | 6.55      | 130,117,302.00                    |  |
|      | EMPRESA NACIONAL DE TELECOM  | 17,574     | 6,385.90  | 112,225,806.00                    |  |

|                       |                              |            |                  |                                   |  |
|-----------------------|------------------------------|------------|------------------|-----------------------------------|--|
|                       | AGUAS ANDINAS SA-A           | 336,630    | 392.85           | 132,245,095.00                    |  |
|                       | COLBUN SA                    | 958,889    | 153.26           | 146,959,328.00                    |  |
|                       | ENEL AMERICAS SA             | 3,866,589  | 135.60           | 524,309,468.00                    |  |
|                       | ENEL CHILE SA                | 3,759,875  | 70.15            | 263,755,231.00                    |  |
|                       | チリペソ 小計                      | 41,762,720 |                  | 5,156,150,627.00<br>(844,577,472) |  |
| 韓国ウォン                 | GS HOLDINGS                  | 6,300      | 52,600.00        | 331,380,000.00                    |  |
|                       | S-OIL CORP                   | 6,420      | 99,400.00        | 638,148,000.00                    |  |
|                       | SK INNOVATION CO LTD         | 8,811      | 185,500.00       | 1,634,440,500.00                  |  |
|                       | HANWHA CHEMICAL CORP         | 12,898     | 21,450.00        | 276,662,100.00                    |  |
|                       | HYUNDAI STEEL CO             | 10,258     | 50,900.00        | 522,132,200.00                    |  |
|                       | KOREA ZINC CO LTD            | 1,151      | 427,500.00       | 492,052,500.00                    |  |
|                       | KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD   | 2,157      | 90,300.00        | 194,777,100.00                    |  |
|                       | LG CHEM LTD                  | 6,216      | 373,500.00       | 2,321,676,000.00                  |  |
|                       | LG CHEM LTD-PREFERENCE       | 961        | 210,000.00       | 201,810,000.00                    |  |
|                       | LOTTE CHEMICAL CORP          | 2,227      | 298,500.00       | 664,759,500.00                    |  |
|                       | OCI CO LTD                   | 2,596      | 98,600.00        | 255,965,600.00                    |  |
|                       | POSCO                        | 10,625     | 268,000.00       | 2,847,500,000.00                  |  |
|                       | POSCO CHEMTECH CO LTD        | 3,026      | 60,700.00        | 183,678,200.00                    |  |
|                       | CJ CORP                      | 2,103      | 120,500.00       | 253,411,500.00                    |  |
|                       | DAELIM INDUSTRIAL CO LTD     | 3,997      | 104,000.00       | 415,688,000.00                    |  |
|                       | DAEWOO ENGINEERING & CONSTR  | 26,032     | 6,080.00         | 158,274,560.00                    |  |
|                       | DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE | 4,843      | 34,550.00        | 167,325,650.00                    |  |
|                       | DOOSAN BOBCAT INC            | 5,570      | 33,000.00        | 183,810,000.00                    |  |
|                       | GS ENGINEERING & CONSTRUCT   | 7,788      | 47,400.00        | 369,151,200.00                    |  |
|                       | HANWHA CORPORATION           | 5,451      | 33,850.00        | 184,516,350.00                    |  |
|                       | HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E | 4,074      | 44,850.00        | 182,718,900.00                    |  |
|                       | HYUNDAI ENGINEERING & CONST  | 10,157     | 62,400.00        | 633,796,800.00                    |  |
|                       | HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES     | 5,396      | 139,000.00       | 750,044,000.00                    |  |
|                       | HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL | 1,285      | 365,500.00       | 469,667,500.00                    |  |
|                       | KCC CORP                     | 886        | 320,500.00       | 283,963,000.00                    |  |
|                       | KOREA AEROSPACE INDUSTRIES   | 9,570      | 34,400.00        | 329,208,000.00                    |  |
|                       | LG CORP                      | 13,029     | 77,100.00        | 1,004,535,900.00                  |  |
|                       | LOTTE CORP                   | 3,952      | 51,600.00        | 203,923,200.00                    |  |
|                       | POSCO DAEWOO CORP            | 7,531      | 19,450.00        | 146,477,950.00                    |  |
|                       | SAMSUNG C&T CORP             | 10,041     | 117,500.00       | 1,179,817,500.00                  |  |
|                       | SAMSUNG ENGINEERING CO LTD   | 20,499     | 16,900.00        | 346,433,100.00                    |  |
|                       | SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES     | 64,319     | 7,990.00         | 513,908,810.00                    |  |
| SK HOLDINGS CO LTD    | 4,214                        | 267,000.00 | 1,125,138,000.00 |                                   |  |
| S-1 CORPORATION       | 2,357                        | 103,500.00 | 243,949,500.00   |                                   |  |
| CJ LOGISTICS          | 1,139                        | 167,000.00 | 190,213,000.00   |                                   |  |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD | 2,719                        | 138,500.00 | 376,581,500.00   |                                   |  |

|                                 |        |              |                  |
|---------------------------------|--------|--------------|------------------|
| KOREAN AIR LINES CO LTD         | 5,796  | 34,800.00    | 201,700,800.00   |
| PAN OCEAN CO LTD                | 33,171 | 4,710.00     | 156,235,410.00   |
| HANKOOK TIRE CO LTD             | 10,374 | 41,150.00    | 426,890,100.00   |
| HANON SYSTEMS                   | 23,021 | 12,300.00    | 283,158,300.00   |
| HYUNDAI MOBIS CO LTD            | 9,301  | 208,500.00   | 1,939,258,500.00 |
| HYUNDAI MOTOR CO                | 18,501 | 128,500.00   | 2,377,378,500.00 |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF    | 5,295  | 84,200.00    | 445,839,000.00   |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF        | 3,585  | 77,300.00    | 277,120,500.00   |
| KIA MOTORS CORP                 | 35,651 | 35,750.00    | 1,274,523,250.00 |
| COWAY CO LTD                    | 7,085  | 80,300.00    | 568,925,500.00   |
| FILA KOREA LTD                  | 6,300  | 46,500.00    | 292,950,000.00   |
| HLB INC                         | 4,105  | 71,600.00    | 293,918,000.00   |
| LG ELECTRONICS INC              | 14,597 | 69,500.00    | 1,014,491,500.00 |
| KANGWON LAND INC                | 16,289 | 32,900.00    | 535,908,100.00   |
| CHEIL WORLDWIDE INC             | 9,543  | 22,700.00    | 216,626,100.00   |
| KAKAO CORP                      | 6,459  | 102,500.00   | 662,047,500.00   |
| NAVER CORP                      | 18,846 | 130,000.00   | 2,449,980,000.00 |
| NCSOFT CORP                     | 2,338  | 467,000.00   | 1,091,846,000.00 |
| NETMARBLE CORP                  | 3,176  | 110,000.00   | 349,360,000.00   |
| PEARL ABYSS CORP                | 876    | 200,200.00   | 175,375,200.00   |
| CJ ENM CO LTD                   | 1,286  | 209,400.00   | 269,288,400.00   |
| HOTEL SHILLA CO LTD             | 4,617  | 81,100.00    | 374,438,700.00   |
| HYUNDAI DEPT STORE CO           | 2,000  | 93,600.00    | 187,200,000.00   |
| LOTTE SHOPPING CO               | 1,508  | 195,000.00   | 294,060,000.00   |
| SHINSEGAE INC                   | 882    | 273,500.00   | 241,227,000.00   |
| BGF RETAIL CO LTD               | 933    | 187,500.00   | 174,937,500.00   |
| E-MART INC                      | 2,988  | 193,000.00   | 576,684,000.00   |
| GS RETAIL CO LTD                | 4,031  | 36,750.00    | 148,139,250.00   |
| CJ CHEILJEDANG CORP             | 1,032  | 335,500.00   | 346,236,000.00   |
| KT&G CORP                       | 15,327 | 101,000.00   | 1,548,027,000.00 |
| ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA    | 2,661  | 114,000.00   | 303,354,000.00   |
| OTTOGI CORPORATION              | 187    | 773,000.00   | 144,551,000.00   |
| AMOREPACIFIC CORP               | 4,374  | 181,000.00   | 791,694,000.00   |
| AMOREPACIFIC CORP-PREF          | 1,222  | 103,000.00   | 125,866,000.00   |
| AMOREPACIFIC GROUP              | 3,527  | 66,500.00    | 234,545,500.00   |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE      | 1,237  | 1,203,000.00 | 1,488,111,000.00 |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF      | 283    | 750,000.00   | 212,250,000.00   |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD     | 6,375  | 71,300.00    | 454,537,500.00   |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD-NEW | 127    | 71,300.00    | 9,055,100.00     |
| CELLTRION INC                   | 10,932 | 208,500.00   | 2,279,322,000.00 |
| CELLTRION INC-NEW               | 210    | 208,500.00   | 43,785,000.00    |
| CELLTRION PHARM INC             | 1,602  | 61,200.00    | 98,042,400.00    |

|         |                              |           |            |  |  |
|---------|------------------------------|-----------|------------|--|--|
|         | HANMI PHARM CO LTD           | 843       | 432,000.00 | 364,176,000.00                         |  |
|         | HANMI SCIENCE CO LTD         | 1,738     | 74,300.00  | 129,133,400.00                         |  |
|         | MEDY-TOX INC                 | 630       | 527,000.00 | 332,010,000.00                         |  |
|         | MEDY-TOX INC-NEW             | 15        | 527,000.00 | 7,905,000.00                           |  |
|         | SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD     | 2,212     | 403,000.00 | 891,436,000.00                         |  |
|         | SILLAJEN INC                 | 8,098     | 71,300.00  | 577,387,400.00                         |  |
|         | VIROMED CO LTD               | 1,750     | 260,300.00 | 455,525,000.00                         |  |
|         | YUHAN CORP                   | 1,332     | 235,000.00 | 313,020,000.00                         |  |
|         | BNK FINANCIAL GROUP INC      | 36,422    | 7,160.00   | 260,781,520.00                         |  |
|         | DGB FINANCIAL GROUP INC      | 20,041    | 8,380.00   | 167,943,580.00                         |  |
|         | HANA FINANCIAL GROUP         | 39,635    | 38,350.00  | 1,520,002,250.00                       |  |
|         | INDUSTRIAL BANK OF KOREA     | 31,811    | 13,900.00  | 442,172,900.00                         |  |
|         | KB FINANCIAL GROUP INC       | 53,495    | 46,300.00  | 2,476,818,500.00                       |  |
|         | SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD  | 57,604    | 42,200.00  | 2,430,888,800.00                       |  |
|         | WOORI BANK                   | 63,331    | 14,800.00  | 937,298,800.00                         |  |
|         | KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO | 6,233     | 64,900.00  | 404,521,700.00                         |  |
|         | MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD    | 51,183    | 7,520.00   | 384,896,160.00                         |  |
|         | NH INVESTMENT & SECURITIES C | 20,867    | 13,800.00  | 287,964,600.00                         |  |
|         | SAMSUNG CARD CO              | 3,172     | 34,600.00  | 109,751,200.00                         |  |
|         | SAMSUNG SECURITIES CO LTD    | 7,484     | 34,100.00  | 255,204,400.00                         |  |
|         | DB INSURANCE CO LTD          | 6,222     | 67,700.00  | 421,229,400.00                         |  |
|         | HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD | 39,802    | 4,310.00   | 171,546,620.00                         |  |
|         | HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO | 8,692     | 37,500.00  | 325,950,000.00                         |  |
|         | ORANGE LIFE INSURANCE LTD    | 3,300     | 29,950.00  | 98,835,000.00                          |  |
|         | SAMSUNG FIRE & MARINE INS    | 4,181     | 274,500.00 | 1,147,684,500.00                       |  |
|         | SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT | 9,011     | 92,500.00  | 833,517,500.00                         |  |
|         | SAMSUNG SDS CO LTD           | 4,708     | 217,500.00 | 1,023,990,000.00                       |  |
|         | LG DISPLAY CO LTD            | 29,634    | 20,300.00  | 601,570,200.00                         |  |
|         | LG INNOTEK CO LTD            | 1,685     | 96,100.00  | 161,928,500.00                         |  |
|         | SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO | 7,683     | 109,500.00 | 841,288,500.00                         |  |
|         | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD   | 645,363   | 44,750.00  | 28,879,994,250.00                      |  |
|         | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF     | 115,327   | 37,200.00  | 4,290,164,400.00                       |  |
|         | SAMSUNG SDI CO LTD           | 7,375     | 232,500.00 | 1,714,687,500.00                       |  |
|         | KT CORP                      | 2,250     | 29,250.00  | 65,812,500.00                          |  |
|         | LG UPLUS CORP                | 13,838    | 16,700.00  | 231,094,600.00                         |  |
|         | SK TELECOM                   | 2,588     | 269,000.00 | 696,172,000.00                         |  |
|         | KOREA ELECTRIC POWER CORP    | 34,181    | 33,050.00  | 1,129,682,050.00                       |  |
|         | KOREA GAS CORPORATION        | 3,688     | 52,600.00  | 193,988,800.00                         |  |
|         | SK HYNIX INC                 | 77,763    | 74,600.00  | 5,801,119,800.00                       |  |
|         | 韓国ウォン 小計                     | 2,017,435 |            | 107,035,512,560.00<br>(10,478,776,679) |  |
| ニュー台湾ドル | FORMOSA PETROCHEMICAL CORP   | 161,150   | 108.50     | 17,484,775.00                          |  |



|                              |           |        |               |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| ASIA CEMENT CORP             | 317,281   | 36.20  | 11,485,572.20 |
| CHINA STEEL CORP             | 1,691,947 | 25.35  | 42,890,856.45 |
| FORMOSA CHEMICALS & FIBRE    | 476,430   | 107.50 | 51,216,225.00 |
| FORMOSA PLASTICS CORP        | 600,600   | 102.00 | 61,261,200.00 |
| NAN YA PLASTICS CORP         | 701,557   | 75.70  | 53,107,864.90 |
| TAIWAN CEMENT                | 602,276   | 36.60  | 22,043,301.60 |
| AIRTAC INTERNATIONAL GROUP   | 13,000    | 348.00 | 4,524,000.00  |
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORP | 455,138   | 29.55  | 13,449,327.90 |
| HIWIN TECHNOLOGIES CORP      | 26,345    | 243.50 | 6,415,007.50  |
| CHINA AIRLINES LTD           | 405,000   | 10.70  | 4,333,500.00  |
| EVA AIRWAYS CORP             | 325,649   | 14.75  | 4,803,322.75  |
| EVERGREEN MARINE CORP LTD    | 263,883   | 12.05  | 3,179,790.15  |
| TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP  | 293,000   | 30.85  | 9,039,050.00  |
| CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD | 263,413   | 42.80  | 11,274,076.40 |
| ECLAT TEXTILE COMPANY LTD    | 23,728    | 341.50 | 8,103,112.00  |
| FENG TAY ENTERPRISE CO LTD   | 43,926    | 188.00 | 8,258,088.00  |
| FORMOSA TAFFETA CO.          | 111,000   | 35.10  | 3,896,100.00  |
| GIANT MANUFACTURING          | 49,000    | 160.50 | 7,864,500.00  |
| NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD  | 19,000    | 262.50 | 4,987,500.00  |
| POU CHEN                     | 315,500   | 36.05  | 11,373,775.00 |
| RUENTEX INDUSTRIES LTD       | 45,600    | 82.50  | 3,762,000.00  |
| TATUNG CO LTD                | 244,000   | 27.10  | 6,612,400.00  |
| HOTAI MOTOR COMPANY LTD      | 41,000    | 290.00 | 11,890,000.00 |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP   | 80,000    | 323.00 | 25,840,000.00 |
| STANDARD FOODS CORP          | 61,023    | 50.20  | 3,063,354.60  |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 659,624   | 73.30  | 48,350,439.20 |
| TAIMED BIOLOGICS INC         | 21,000    | 172.00 | 3,612,000.00  |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK    | 677,552   | 18.00  | 12,195,936.00 |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL  | 1,898,255 | 9.97   | 18,925,602.35 |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT | 2,413,955 | 20.60  | 49,727,473.00 |
| E.SUN FINANCIAL HOLDING CO   | 1,309,332 | 21.20  | 27,757,838.40 |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO   | 1,344,224 | 20.25  | 27,220,536.00 |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C | 1,022,831 | 18.45  | 18,871,231.95 |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT | 1,432,754 | 26.50  | 37,967,981.00 |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS   | 1,460,018 | 10.40  | 15,184,187.20 |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDING    | 1,413,770 | 13.45  | 19,015,206.50 |
| TAIWAN BUSINESS BANK         | 477,961   | 10.95  | 5,233,672.95  |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL | 1,230,140 | 18.55  | 22,819,097.00 |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD     | 157,193   | 112.00 | 17,605,616.00 |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO  | 1,296,321 | 16.75  | 21,713,376.75 |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO  | 1,112,366 | 43.50  | 48,387,921.00 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD  | 354,056   | 27.15  | 9,612,620.40  |

|                              |           |          |                |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO   | 901,087   | 44.00    | 39,647,828.00  |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING  | 1,328,852 | 8.57     | 11,388,261.64  |
| HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP | 118,000   | 47.60    | 5,616,800.00   |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD   | 98,720    | 46.30    | 4,570,736.00   |
| ACER INC                     | 432,168   | 19.80    | 8,556,926.40   |
| ADVANTECH CO LTD             | 46,676    | 231.00   | 10,782,156.00  |
| ASUSTEK COMPUTER INC         | 97,774    | 229.50   | 22,439,133.00  |
| AU OPTRONICS CORP            | 1,162,000 | 12.65    | 14,699,300.00  |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD    | 89,000    | 228.00   | 20,292,000.00  |
| CHICONY ELECTRONICS CO LTD   | 69,766    | 68.50    | 4,778,971.00   |
| COMPAL ELECTRONICS           | 547,775   | 17.80    | 9,750,395.00   |
| DELTA ELECTRONICS INC        | 279,220   | 154.00   | 42,999,880.00  |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD    | 123,042   | 58.50    | 7,197,957.00   |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY   | 1,770,272 | 70.70    | 125,158,230.40 |
| INNOLUX CORP                 | 1,195,112 | 10.45    | 12,488,920.40  |
| INVENTEC CORP                | 292,429   | 23.25    | 6,798,974.25   |
| LARGAN PRECISION CO LTD      | 13,820    | 3,740.00 | 51,686,800.00  |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP      | 258,160   | 44.50    | 11,488,120.00  |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO  | 81,000    | 77.10    | 6,245,100.00   |
| PEGATRON CORP                | 249,976   | 51.00    | 12,748,776.00  |
| QUANTA COMPUTER INC          | 350,150   | 55.90    | 19,573,385.00  |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP  | 170,193   | 37.80    | 6,433,295.40   |
| WALSIN TECHNOLOGY CORP       | 38,000    | 175.00   | 6,650,000.00   |
| WISTRON CORP                 | 375,865   | 21.30    | 8,005,924.50   |
| WPG HOLDINGS LTD             | 198,168   | 38.75    | 7,679,010.00   |
| YAGEO CORPORATION            | 35,952    | 328.50   | 11,810,232.00  |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING | 67,000    | 79.20    | 5,306,400.00   |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD      | 511,000   | 107.00   | 54,677,000.00  |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD  | 210,000   | 72.20    | 15,162,000.00  |
| TAIWAN MOBILE CO LTD         | 212,400   | 109.50   | 23,257,800.00  |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT | 434,294   | 60.50    | 26,274,787.00  |
| GLOBALWAFERS CO LTD          | 31,000    | 290.00   | 8,990,000.00   |
| MEDIATEK INC                 | 196,236   | 248.00   | 48,666,528.00  |
| NANYA TECHNOLOGY CORP        | 152,000   | 60.00    | 9,120,000.00   |
| NOVATEK MICROELECTRONICS COR | 76,000    | 154.50   | 11,742,000.00  |
| PHISON ELECTRONICS CORP      | 21,000    | 249.00   | 5,229,000.00   |
| POWERTECH TECHNOLOGY INC     | 111,300   | 70.20    | 7,813,260.00   |
| REALTEK SEMICONDUCTOR CORP   | 57,703    | 156.50   | 9,030,519.50   |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 3,297,000 | 226.00   | 745,122,000.00 |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP | 1,516,000 | 11.95    | 18,116,200.00  |
| VANGUARD INTERNATIONAL SEMI  | 110,000   | 63.00    | 6,930,000.00   |
| WIN SEMICONDUCTORS CORP      | 42,000    | 152.00   | 6,384,000.00   |

|                              |                              |            |                |                                     |  |
|------------------------------|------------------------------|------------|----------------|-------------------------------------|--|
|                              | WINBOND ELECTRONICS CORP     | 403,000    | 14.70          | 5,924,100.00                        |  |
|                              | ニュー台湾ドル 小計                   | 43,682,908 |                | 2,313,592,141.64<br>(8,213,252,102) |  |
| インドルピー                       | BHARAT PETROLEUM CORP LTD    | 99,849     | 357.45         | 35,691,025.05                       |  |
|                              | COAL INDIA LTD               | 91,702     | 220.95         | 20,261,556.90                       |  |
|                              | HINDUSTAN PETROLEUM CORP     | 79,460     | 241.80         | 19,213,428.00                       |  |
|                              | INDIAN OIL CORP LTD          | 194,287    | 137.75         | 26,763,034.25                       |  |
|                              | OIL & NATURAL GAS CORP LTD   | 177,895    | 142.00         | 25,261,090.00                       |  |
|                              | PETRONET LNG LTD             | 79,824     | 227.05         | 18,124,039.20                       |  |
|                              | RELIANCE INDUSTRIES LTD      | 381,641    | 1,246.00       | 475,524,686.00                      |  |
|                              | AMBUJA CEMENTS LTD           | 82,123     | 202.35         | 16,617,589.05                       |  |
|                              | ASIAN PAINTS LTD             | 38,879     | 1,372.15       | 53,347,819.85                       |  |
|                              | GRASIM INDUSTRIES LTD        | 46,829     | 759.60         | 35,571,308.40                       |  |
|                              | HINDALCO INDUSTRIES LTD      | 147,848    | 204.45         | 30,227,523.60                       |  |
|                              | JSW STEEL LTD                | 116,817    | 274.65         | 32,083,789.05                       |  |
|                              | PIDILITE INDUSTRIES LTD      | 16,135     | 1,129.80       | 18,229,323.00                       |  |
|                              | SHREE CEMENT LTD             | 1,156      | 15,723.20      | 18,176,019.20                       |  |
|                              | TATA STEEL LTD               | 44,146     | 452.90         | 19,993,723.40                       |  |
|                              | ULTRATECH CEMENT LTD         | 12,455     | 3,510.80       | 43,727,014.00                       |  |
|                              | UPL LTD                      | 47,497     | 753.10         | 35,769,990.70                       |  |
|                              | VEDANTA LTD                  | 164,576    | 194.70         | 32,042,947.20                       |  |
|                              | ASHOK LEYLAND LTD            | 170,035    | 82.60          | 14,044,891.00                       |  |
|                              | HAVELLS INDIA LTD            | 35,706     | 708.15         | 25,285,203.90                       |  |
|                              | LARSEN & TOUBRO LTD          | 65,066     | 1,285.45       | 83,639,089.70                       |  |
|                              | ADANI PORTS AND SPECIAL ECON | 65,677     | 373.85         | 24,553,346.45                       |  |
|                              | CONTAINER CORP OF INDIA LTD  | 21,864     | 660.40         | 14,438,985.60                       |  |
|                              | INTERGLOBE AVIATION LTD      | 13,632     | 1,161.75       | 15,836,976.00                       |  |
|                              | BAJAJ AUTO LTD               | 11,284     | 2,626.35       | 29,635,733.40                       |  |
|                              | BHARAT FORGE LTD             | 31,725     | 479.60         | 15,215,310.00                       |  |
|                              | BOSCH LTD                    | 1,032      | 18,526.25      | 19,119,090.00                       |  |
|                              | EICHER MOTORS LTD            | 1,718      | 20,049.95      | 34,445,814.10                       |  |
|                              | HERO MOTOCORP LTD            | 6,812      | 2,670.15       | 18,189,061.80                       |  |
|                              | MAHINDRA & MAHINDRA LTD      | 99,581     | 683.50         | 68,063,613.50                       |  |
|                              | MARUTI SUZUKI INDIA LTD      | 14,102     | 6,513.40       | 91,851,966.80                       |  |
|                              | MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD   | 118,404    | 150.80         | 17,855,323.20                       |  |
| TATA MOTORS LTD              | 228,350                      | 173.25     | 39,561,637.50  |                                     |  |
| PAGE INDUSTRIES LTD          | 814                          | 22,758.20  | 18,525,174.80  |                                     |  |
| TITAN CO LTD                 | 42,616                       | 978.00     | 41,678,448.00  |                                     |  |
| ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE | 66,999                       | 318.40     | 21,332,481.60  |                                     |  |
| AVENUE SUPERMARTS LTD        | 16,186                       | 1,365.70   | 22,105,220.20  |                                     |  |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD     | 7,370                        | 3,206.65   | 23,633,010.50  |                                     |  |
| ITC LTD                      | 461,554                      | 279.20     | 128,865,876.80 |                                     |  |

|        |                              |           |           |                                     |  |
|--------|------------------------------|-----------|-----------|-------------------------------------|--|
|        | NESTLE INDIA LTD             | 2,928     | 11,365.60 | 33,278,476.80                       |  |
|        | UNITED SPIRITS LTD           | 40,968    | 554.85    | 22,731,094.80                       |  |
|        | DABUR INDIA LTD              | 66,365    | 430.00    | 28,536,950.00                       |  |
|        | GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 48,940    | 780.30    | 38,187,882.00                       |  |
|        | HINDUSTAN UNILEVER LTD       | 87,180    | 1,756.80  | 153,157,824.00                      |  |
|        | MARICO LTD                   | 64,939    | 369.90    | 24,020,936.10                       |  |
|        | AUROBINDO PHARMA LTD         | 34,053    | 786.15    | 26,770,765.95                       |  |
|        | CADILA HEALTHCARE LTD        | 27,181    | 343.70    | 9,342,109.70                        |  |
|        | CIPLA LTD                    | 42,598    | 507.65    | 21,624,874.70                       |  |
|        | DIVI'S LABORATORIES LTD      | 10,442    | 1,495.35  | 15,614,444.70                       |  |
|        | DR. REDDY'S LABORATORIES     | 14,595    | 2,672.40  | 39,003,678.00                       |  |
|        | GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD | 19,734    | 646.90    | 12,765,924.60                       |  |
|        | LUPIN LTD                    | 32,023    | 865.05    | 27,701,496.15                       |  |
|        | PIRAMAL ENTERPRISES LTD      | 11,979    | 2,299.20  | 27,542,116.80                       |  |
|        | SUN PHARMACEUTICAL INDUS     | 116,045   | 422.40    | 49,017,408.00                       |  |
|        | AXIS BANK LTD                | 241,210   | 669.75    | 161,550,397.50                      |  |
|        | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE  | 214,666   | 1,977.80  | 424,566,414.80                      |  |
|        | ICICI BANK LTD               | 325,227   | 357.20    | 116,171,084.40                      |  |
|        | INDIABULLS HOUSING FINANCE L | 38,539    | 744.50    | 28,692,285.50                       |  |
|        | LIC HOUSING FINANCE LTD      | 39,618    | 453.05    | 17,948,934.90                       |  |
|        | STATE BANK OF INDIA          | 236,673   | 285.40    | 67,546,474.20                       |  |
|        | YES BANK LTD                 | 237,412   | 219.60    | 52,135,675.20                       |  |
|        | BAJAJ FINANCE LTD            | 23,127    | 2,599.55  | 60,119,792.85                       |  |
|        | MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS | 45,001    | 416.90    | 18,760,916.90                       |  |
|        | REC LTD                      | 87,685    | 120.70    | 10,583,579.50                       |  |
|        | SHRIRAM TRANSPORT FINANCE    | 20,240    | 1,120.15  | 22,671,836.00                       |  |
|        | BAJAJ FINSERV LTD            | 4,820     | 6,321.55  | 30,469,871.00                       |  |
|        | HCL TECHNOLOGIES LTD         | 75,560    | 969.40    | 73,247,864.00                       |  |
|        | INFOSYS LTD                  | 466,395   | 730.35    | 340,631,588.25                      |  |
|        | TATA CONSULTANCY SVCS LTD    | 120,140   | 1,920.80  | 230,764,912.00                      |  |
|        | TECH MAHINDRA LTD            | 64,544    | 729.05    | 47,055,803.20                       |  |
|        | WIPRO LTD                    | 157,282   | 353.45    | 55,591,322.90                       |  |
|        | BHARTI AIRTEL LTD            | 192,951   | 307.50    | 59,332,432.50                       |  |
|        | BHARTI INFRATEL LTD          | 49,169    | 279.75    | 13,755,027.75                       |  |
|        | VODAFONE IDEA LTD            | 247,689   | 32.85     | 8,136,583.65                        |  |
|        | GAIL INDIA LTD               | 102,245   | 334.90    | 34,241,850.50                       |  |
|        | NTPC LTD                     | 253,745   | 138.30    | 35,092,933.50                       |  |
|        | POWER GRID CORP OF INDIA LTD | 214,962   | 185.85    | 39,950,687.70                       |  |
|        | TATA POWER CO LTD            | 168,974   | 73.95     | 12,495,627.30                       |  |
|        | インドルピー 小計                    | 7,551,490 |           | 4,215,312,040.00<br>(6,533,733,662) |  |
| チェココルナ | KOMERCNI BANKA AS            | 10,306    | 880.00    | 9,069,280.00                        |  |

|            |                              |           |           |                                   |  |
|------------|------------------------------|-----------|-----------|-----------------------------------|--|
|            | MONETA MONEY BANK AS         | 79,528    | 72.90     | 5,797,591.20                      |  |
|            | CEZ AS                       | 21,359    | 550.00    | 11,747,450.00                     |  |
|            | チェココルナ 小計                    | 111,193   |           | 26,614,321.20<br>(129,345,601)    |  |
| コロンビアペソ    | ECOPETROL SA                 | 649,059   | 2,860.00  | 1,856,308,740.00                  |  |
|            | CEMENTOS ARGOS SA            | 61,887    | 7,850.00  | 485,812,950.00                    |  |
|            | GRUPO ARGOS SA               | 41,950    | 18,340.00 | 769,363,000.00                    |  |
|            | BANCOLOMBIA SA               | 33,198    | 33,620.00 | 1,116,116,760.00                  |  |
|            | BANCOLOMBIA SA-PREF          | 56,303    | 34,300.00 | 1,931,192,900.00                  |  |
|            | GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF   | 557,671   | 1,080.00  | 602,284,680.00                    |  |
|            | GRUPO DE INV SURAMERICANA    | 30,409    | 33,900.00 | 1,030,865,100.00                  |  |
|            | GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF | 12,909    | 32,040.00 | 413,604,360.00                    |  |
|            | INTERCONEXION ELECTRICA SA   | 58,349    | 14,040.00 | 819,219,960.00                    |  |
|            | コロンビアペソ 小計                   | 1,501,735 |           | 9,024,768,450.00<br>(313,159,465) |  |
| ハンガリーフォリント | MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL | 48,338    | 3,262.00  | 157,678,556.00                    |  |
|            | RICHTER GEDEON NYRT          | 18,319    | 5,760.00  | 105,517,440.00                    |  |
|            | OTP BANK PLC                 | 28,958    | 11,650.00 | 337,360,700.00                    |  |
|            | ハンガリーフォリント 小計                | 95,615    |           | 600,556,696.00<br>(235,838,614)   |  |
| アラブディルハム   | ABU DHABI COMMERCIAL BANK    | 256,505   | 8.94      | 2,293,154.70                      |  |
|            | DUBAI ISLAMIC BANK           | 227,829   | 5.16      | 1,175,597.64                      |  |
|            | FIRST ABU DHABI BANK PJSC    | 353,150   | 14.72     | 5,198,368.00                      |  |
|            | ALDAR PROPERTIES PJSC        | 473,009   | 1.57      | 742,624.13                        |  |
|            | DAMAC PROPERTIES DUBAI CO    | 275,358   | 1.21      | 333,183.18                        |  |
|            | EMAAR DEVELOPMENT PJSC       | 113,854   | 3.75      | 426,952.50                        |  |
|            | EMAAR MALLS PJSC             | 256,775   | 1.60      | 410,840.00                        |  |
|            | EMAAR PROPERTIES PJSC        | 470,851   | 4.17      | 1,963,448.67                      |  |
|            | EMIRATES TELECOM GROUP CO    | 226,537   | 16.84     | 3,814,883.08                      |  |
|            | アラブディルハム 小計                  | 2,653,868 |           | 16,359,051.90<br>(487,826,927)    |  |
| ポーランドズロチ   | GRUPA LOTOS SA               | 12,497    | 96.00     | 1,199,712.00                      |  |
|            | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN | 40,684    | 107.65    | 4,379,632.60                      |  |
|            | POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I  | 224,914   | 7.50      | 1,686,855.00                      |  |
|            | JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S | 6,875     | 67.80     | 466,125.00                        |  |
|            | KGHM POLSKA MIEDZ SA         | 18,434    | 92.00     | 1,695,928.00                      |  |
|            | CCC SA                       | 4,541     | 186.00    | 844,626.00                        |  |
|            | LPP SA                       | 164       | 8,655.00  | 1,419,420.00                      |  |
|            | CD PROJEKT SA                | 8,334     | 189.80    | 1,581,793.20                      |  |
|            | CYFROWY POLSAT SA            | 37,162    | 23.38     | 868,847.56                        |  |
|            | DINO POLSKA SA               | 6,814     | 103.50    | 705,249.00                        |  |
|            | ALIOR BANK SA                | 10,598    | 57.50     | 609,385.00                        |  |

|                         |                              |         |               |                                |
|-------------------------|------------------------------|---------|---------------|--------------------------------|
|                         | BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA | 5,658   | 71.20         | 402,849.60                     |
|                         | BANK MILLENNIUM SA           | 76,012  | 9.00          | 684,108.00                     |
|                         | BANK PEKAO SA                | 23,548  | 113.00        | 2,660,924.00                   |
|                         | MBANK SA                     | 2,305   | 450.60        | 1,038,633.00                   |
|                         | PKO BANK POLSKI SA           | 120,177 | 40.43         | 4,858,756.11                   |
|                         | SANTANDER BANK POLSKA SA     | 4,664   | 374.40        | 1,746,201.60                   |
|                         | POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE | 79,511  | 45.39         | 3,609,004.29                   |
|                         | ORANGE POLSKA SA             | 110,607 | 5.70          | 630,459.90                     |
|                         | PGE SA                       | 111,804 | 10.88         | 1,216,427.52                   |
|                         | ポーランドズロチ 小計                  | 905,303 |               | 32,304,937.38<br>(939,427,579) |
| 南アフリカランド                | EXXARO RESOURCES LTD         | 31,709  | 146.89        | 4,657,735.01                   |
|                         | ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD  | 7,059   | 601.97        | 4,249,306.23                   |
|                         | ANGLOGOLD ASHANTI LTD        | 56,274  | 179.55        | 10,103,996.70                  |
|                         | GOLD FIELDS LTD              | 102,815 | 52.02         | 5,348,436.30                   |
|                         | KUMBA IRON ORE LTD           | 10,198  | 291.30        | 2,970,677.40                   |
|                         | MONDI LTD                    | 14,521  | 336.99        | 4,893,431.79                   |
|                         | SAPPI LIMITED                | 65,528  | 77.19         | 5,058,106.32                   |
|                         | SASOL LTD                    | 75,649  | 421.07        | 31,853,524.43                  |
|                         | BIDVEST GROUP LTD            | 46,724  | 201.90        | 9,433,575.60                   |
|                         | NASPERS LTD-N SHS            | 58,826  | 3,040.00      | 178,831,040.00                 |
|                         | MR PRICE GROUP LTD           | 33,426  | 215.00        | 7,186,590.00                   |
|                         | THE FOSCHINI GROUP LTD       | 31,707  | 169.63        | 5,378,458.41                   |
|                         | TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD  | 55,343  | 83.00         | 4,593,469.00                   |
|                         | WOOLWORTHS HOLDINGS LTD      | 126,372 | 49.80         | 6,293,325.60                   |
|                         | BID CORP LTD                 | 44,590  | 281.05        | 12,532,019.50                  |
|                         | CLICKS GROUP LTD             | 34,893  | 194.51        | 6,787,037.43                   |
|                         | PICK N PAY STORES LTD        | 55,770  | 71.43         | 3,983,651.10                   |
|                         | SHOPRITE HOLDINGS LTD        | 59,556  | 186.00        | 11,077,416.00                  |
|                         | SPAR GROUP LIMITED/THE       | 26,049  | 200.25        | 5,216,312.25                   |
|                         | TIGER BRANDS LTD             | 20,208  | 277.00        | 5,597,616.00                   |
|                         | LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN | 178,845 | 26.90         | 4,810,930.50                   |
|                         | NETCARE LTD                  | 149,837 | 25.50         | 3,820,843.50                   |
|                         | ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 54,876  | 151.99        | 8,340,603.24                   |
|                         | ABSA GROUP LTD               | 97,189  | 180.00        | 17,494,020.00                  |
|                         | CAPITEC BANK HOLDINGS LTD    | 5,289   | 1,172.99      | 6,203,944.11                   |
|                         | NEDBANK GROUP LTD            | 53,958  | 288.27        | 15,554,472.66                  |
| STANDARD BANK GROUP LTD | 175,317                      | 194.94  | 34,176,295.98 |                                |
| FIRSTRAND LTD           | 452,698                      | 70.61   | 31,965,005.78 |                                |
| INVESTEC LTD            | 39,072                       | 88.80   | 3,469,593.60  |                                |
| PSG GROUP LTD           | 21,071                       | 253.27  | 5,336,652.17  |                                |
| REINET INVESTMENTS SCA  | 17,818                       | 198.46  | 3,536,160.28  |                                |

|        |                              |           |        |                                   |
|--------|------------------------------|-----------|--------|-----------------------------------|
|        | REMGRO LTD                   | 69,006    | 209.00 | 14,422,254.00                     |
|        | RMB HOLDINGS LTD             | 93,700    | 83.50  | 7,823,950.00                      |
|        | DISCOVERY LTD                | 51,282    | 162.10 | 8,312,812.20                      |
|        | LIBERTY HOLDINGS LTD         | 17,401    | 111.45 | 1,939,341.45                      |
|        | MMI HOLDINGS LTD             | 144,183   | 17.20  | 2,479,947.60                      |
|        | OLD MUTUAL LTD               | 670,225   | 23.27  | 15,596,135.75                     |
|        | RAND MERCHANT INVESTMENT HOL | 102,608   | 36.72  | 3,767,765.76                      |
|        | SANLAM LTD                   | 236,549   | 83.81  | 19,825,171.69                     |
|        | NEPI ROCKCASTLE PLC          | 53,721    | 119.50 | 6,419,659.50                      |
|        | MTN GROUP LTD                | 224,050   | 83.20  | 18,640,960.00                     |
|        | TELKOM SA SOC LTD            | 41,282    | 64.97  | 2,682,091.54                      |
|        | VODACOM GROUP LTD            | 85,459    | 119.65 | 10,225,169.35                     |
|        | 南アフリカランド 小計                  | 3,992,653 |        | 572,889,505.73<br>(4,606,031,626) |
| オフショア元 | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A | 47,000    | 5.47   | 257,090.00                        |
|        | CHINA SHENHUA ENERGY CO-A    | 8,100     | 19.47  | 157,707.00                        |
|        | OFFSHORE OIL ENGINEERING-A   | 8,200     | 5.37   | 44,034.00                         |
|        | PETROCHINA CO LTD-A          | 29,900    | 7.28   | 217,672.00                        |
|        | SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A | 12,300    | 7.99   | 98,277.00                         |
|        | SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A | 5,500     | 7.02   | 38,610.00                         |
|        | SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A  | 5,800     | 5.40   | 31,320.00                         |
|        | ANGANG STEEL CO LTD-A        | 7,600     | 5.18   | 39,368.00                         |
|        | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A  | 7,400     | 31.32  | 231,768.00                        |
|        | BAOSHAN IRON & STEEL CO-A    | 34,200    | 6.95   | 237,690.00                        |
|        | BBMG CORPORATION-A           | 15,400    | 3.46   | 53,284.00                         |
|        | CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A    | 13,000    | 3.85   | 50,050.00                         |
|        | CHINA NORTHERN RARE EARTH -A | 6,700     | 8.86   | 59,362.00                         |
|        | HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A  | 4,000     | 13.15  | 52,600.00                         |
|        | HESTEEL CO LTD-A             | 19,600    | 3.08   | 60,368.00                         |
|        | INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A  | 70,100    | 1.51   | 105,851.00                        |
|        | JIANGXI COPPER CO LTD-A      | 3,800     | 13.09  | 49,742.00                         |
|        | JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A | 2,008     | 22.79  | 45,762.32                         |
|        | JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A | 5,000     | 6.36   | 31,800.00                         |
|        | MAANSHAN IRON & STEEL-A      | 11,000    | 3.58   | 39,380.00                         |
|        | RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A   | 5,400     | 10.57  | 57,078.00                         |
|        | SHANDONG GOLD MINING CO LT-A | 3,400     | 29.76  | 101,184.00                        |
|        | SHENZHEN ZHONGJIN LINGNAN-A  | 6,600     | 4.08   | 26,928.00                         |
|        | SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A  | 9,000     | 5.13   | 46,170.00                         |
|        | TIANQI LITHIUM CORP-A        | 2,100     | 29.42  | 61,782.00                         |
|        | TONGLING NONFERROUS METALS-A | 19,400    | 2.01   | 38,994.00                         |
|        | ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A | 1,500     | 29.24  | 43,860.00                         |
|        | ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A | 6,000     | 9.51   | 57,060.00                         |

|                              |        |       |            |
|------------------------------|--------|-------|------------|
| ZHONGJIN GOLD CORP-A         | 6,400  | 8.18  | 52,352.00  |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A  | 31,900 | 2.98  | 95,062.00  |
| AECC AVIATION POWER CO-A     | 4,200  | 22.60 | 94,920.00  |
| AVIC AIRCRAFT CO LTD-A       | 5,100  | 14.08 | 71,808.00  |
| AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A | 1,700  | 30.87 | 52,479.00  |
| CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A | 2,700  | 13.87 | 37,449.00  |
| CHINA COMMUNICATIONS CONST-A | 5,100  | 10.65 | 54,315.00  |
| CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A | 8,500  | 6.17  | 52,445.00  |
| CHINA INTL MARINE CONTAIN-A  | 2,300  | 11.43 | 26,289.00  |
| CHINA NATIONAL CHEMICAL-A    | 9,100  | 5.56  | 50,596.00  |
| CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A | 21,200 | 10.14 | 214,968.00 |
| CHINA SHIPBUILDINGIndustr-A  | 40,700 | 4.41  | 179,487.00 |
| CHINA SPACESAT CO LTD -A     | 2,200  | 18.17 | 39,974.00  |
| CHINA STATE CONSTRUCTION -A  | 77,500 | 6.05  | 468,875.00 |
| CRRC CORP LTD-A              | 37,400 | 8.61  | 322,014.00 |
| DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A | 5,400  | 9.06  | 48,924.00  |
| FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A | 3,300  | 19.36 | 63,888.00  |
| HAN'S LASER TECHNOLOGY IN-A  | 2,000  | 31.30 | 62,600.00  |
| LUXSHARE PRECISIONIndustr-A  | 7,600  | 15.58 | 118,408.00 |
| METALLURGICAL CORP OF CHIN-A | 32,900 | 2.99  | 98,371.00  |
| NARI TECHNOLOGY CO LTD-A     | 8,500  | 19.50 | 165,750.00 |
| POWER CONSTRUCTION CORP OF-A | 18,800 | 5.06  | 95,128.00  |
| SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A | 14,200 | 9.07  | 128,794.00 |
| SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A | 14,500 | 4.98  | 72,210.00  |
| SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A | 5,774  | 6.59  | 38,050.66  |
| SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A | 4,900  | 8.15  | 39,935.00  |
| TBEA CO LTD-A                | 6,900  | 7.25  | 50,025.00  |
| WEICHAI POWER CO LTD-A       | 11,200 | 8.60  | 96,320.00  |
| XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A   | 14,500 | 3.24  | 46,980.00  |
| XIAMEN C & D INC-A           | 5,200  | 7.35  | 38,220.00  |
| XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A | 5,400  | 11.88 | 64,152.00  |
| ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A   | 4,000  | 26.02 | 104,080.00 |
| ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A   | 4,100  | 11.87 | 48,667.00  |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A  | 11,800 | 3.74  | 44,132.00  |
| TUS-SOUND ENVIRONMEN-RES A   | 2,600  | 10.10 | 26,260.00  |
| AIR CHINA LTD-A              | 8,600  | 8.08  | 69,488.00  |
| CHINA EASTERN AIRLINES CO-A  | 15,100 | 5.02  | 75,802.00  |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A | 13,000 | 7.05  | 91,650.00  |
| COSCO SHIPPING DEVELOPME-A   | 14,600 | 2.40  | 35,040.00  |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A | 14,100 | 4.40  | 62,040.00  |
| DAQIN RAILWAY CO LTD -A      | 27,400 | 8.48  | 232,352.00 |
| GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A   | 10,400 | 3.45  | 35,880.00  |



|                              |        |        |              |
|------------------------------|--------|--------|--------------|
| S F HOLDING CO LTD-A         | 2,400  | 31.03  | 74,472.00    |
| SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A | 1,800  | 48.14  | 86,652.00    |
| SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A | 12,800 | 5.35   | 68,480.00    |
| SPRING AIRLINES CO LTD-A     | 1,400  | 32.58  | 45,612.00    |
| BYD CO LTD -A                | 3,300  | 49.18  | 162,294.00   |
| CHINA SHIPBUILDINGIndustr-A  | 3,200  | 22.78  | 72,896.00    |
| CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A  | 7,200  | 7.58   | 54,576.00    |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A | 3,700  | 23.00  | 85,100.00    |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A | 3,900  | 10.38  | 40,482.00    |
| HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A  | 5,800  | 20.45  | 118,610.00   |
| SAIC MOTOR CORP LTD-A        | 14,400 | 26.23  | 377,712.00   |
| SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A | 1,800  | 14.34  | 25,812.00    |
| WANXIANG QIANCHAO CO LTD-A   | 5,100  | 5.53   | 28,203.00    |
| WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A  | 1,500  | 18.58  | 27,870.00    |
| GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A | 5,600  | 39.90  | 223,440.00   |
| HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A  | 1,800  | 25.50  | 45,900.00    |
| HLA CORP LTD -A              | 4,100  | 8.94   | 36,654.00    |
| MIDEA GROUP CO LTD-A         | 12,200 | 41.90  | 511,180.00   |
| OPPEIN HOME GROUP INC-A      | 455    | 90.95  | 41,382.25    |
| QINGDAO HAIER CO LTD-A       | 11,300 | 15.46  | 174,698.00   |
| TCL CORP-A                   | 25,000 | 2.72   | 68,000.00    |
| ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A  | 4,900  | 8.92   | 43,708.00    |
| CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A | 3,600  | 56.43  | 203,148.00   |
| SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A  | 15,100 | 6.30   | 95,130.00    |
| CHINA FILM CO LTD-A          | 3,400  | 15.33  | 52,122.00    |
| CHINA SOUTH PUBLISHING -A    | 3,300  | 13.20  | 43,560.00    |
| CHINESE UNIVERSE PUBLISHIN-A | 2,500  | 13.36  | 33,400.00    |
| CITIC GUOAN INFORMATION-A    | 7,200  | 3.54   | 25,488.00    |
| GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A | 2,500  | 19.72  | 49,300.00    |
| PERFECT WORLD CO LTD-A       | 1,600  | 26.60  | 42,560.00    |
| SHANGHAI ORIENTAL PEARL GR-A | 6,300  | 9.98   | 62,874.00    |
| WUHU SHUNRONG SANQI INTERA-A | 3,300  | 10.60  | 34,980.00    |
| CHINA GRAND AUTOMOTIVE SER-A | 10,000 | 4.44   | 44,400.00    |
| LIAONING CHENG DA CO LTD-A   | 2,800  | 10.54  | 29,512.00    |
| SUNING.COM CO LTD-A          | 17,200 | 10.77  | 185,244.00   |
| YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A | 17,700 | 8.22   | 145,494.00   |
| BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A | 7,800  | 3.29   | 25,662.00    |
| FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A | 4,200  | 72.98  | 306,516.00   |
| HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A | 5,100  | 24.50  | 124,950.00   |
| INNER MONGOLIA YILI INDUS-A  | 11,200 | 24.43  | 273,616.00   |
| JIANGSU YANGHE BREWERY -A    | 2,800  | 98.66  | 276,248.00   |
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A     | 2,300  | 679.70 | 1,563,310.00 |

|                              |         |       |              |
|------------------------------|---------|-------|--------------|
| LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A      | 2,700   | 42.72 | 115,344.00   |
| MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A    | 3,200   | 32.19 | 103,008.00   |
| NEW HOPE LIUHE CO LTD-A      | 7,800   | 7.93  | 61,854.00    |
| SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A | 1,600   | 38.14 | 61,024.00    |
| TONGWEI CO LTD-A             | 7,200   | 10.12 | 72,864.00    |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-A    | 1,300   | 36.83 | 47,879.00    |
| WULIANGYE YIBIN CO LTD-A     | 7,200   | 55.25 | 397,800.00   |
| HUADONG MEDICINE CO LTD-A    | 2,700   | 26.79 | 72,333.00    |
| JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A    | 3,500   | 14.46 | 50,610.00    |
| MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A | 5,800   | 15.78 | 91,524.00    |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A   | 3,500   | 16.71 | 58,485.00    |
| BEIJING TONGRENTANG CO-A     | 2,500   | 26.75 | 66,875.00    |
| CHINA RESOURCES SANJIU MED-A | 1,800   | 22.36 | 40,248.00    |
| DONG-E-E-JIAOCO LTD-A        | 1,200   | 40.19 | 48,228.00    |
| GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A  | 2,600   | 36.18 | 94,068.00    |
| JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A | 6,800   | 58.99 | 401,132.00   |
| KANGMEI PHARMACEUTICAL CO-A  | 9,200   | 6.59  | 60,628.00    |
| SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A | 1,600   | 24.62 | 39,392.00    |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A | 3,700   | 23.36 | 86,432.00    |
| SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A    | 1,600   | 20.52 | 32,832.00    |
| SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A | 2,700   | 21.30 | 57,510.00    |
| TASLY PHARMACEUTICAL GROUP-A | 2,800   | 18.38 | 51,464.00    |
| TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A | 3,800   | 12.30 | 46,740.00    |
| YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A | 1,900   | 78.23 | 148,637.00   |
| ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A | 1,100   | 87.97 | 96,767.00    |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A | 137,500 | 3.67  | 504,625.00   |
| BANK OF BEIJING CO LTD -A    | 39,000  | 5.87  | 228,930.00   |
| BANK OF CHINA LTD-A          | 90,700  | 3.62  | 328,334.00   |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-A  | 72,400  | 6.02  | 435,848.00   |
| BANK OF GUIYANG CO LTD-A     | 4,200   | 10.98 | 46,116.00    |
| BANK OF HANGZHOU CO LTD-A    | 9,500   | 7.63  | 72,485.00    |
| BANK OF JIANGSU CO LTD-A     | 21,300  | 6.15  | 130,995.00   |
| BANK OF NANJING CO LTD -A    | 15,700  | 6.96  | 109,272.00   |
| BANK OF NINGBO CO LTD -A     | 9,400   | 17.37 | 163,278.00   |
| BANK OF SHANGHAI CO LTD-A    | 20,200  | 11.18 | 225,836.00   |
| CHINA CITIC BANK CORP LTD-A  | 10,500  | 5.55  | 58,275.00    |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-A    | 17,700  | 6.81  | 120,537.00   |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A   | 73,500  | 3.98  | 292,530.00   |
| CHINA MERCHANTS BANK-A       | 38,100  | 28.52 | 1,086,612.00 |
| CHINA MINSHENG BANKING-A     | 65,400  | 5.90  | 385,860.00   |
| HUAXIA BANK CO LTD-A         | 23,700  | 7.52  | 178,224.00   |
| IND & COMM BK OF CHINA-A     | 99,500  | 5.52  | 549,240.00   |

|                              |        |       |              |
|------------------------------|--------|-------|--------------|
| INDUSTRIAL BANK CO LTD -A    | 38,300 | 15.99 | 612,417.00   |
| PING AN BANK CO LTD-A        | 31,700 | 11.00 | 348,700.00   |
| SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A | 54,200 | 10.50 | 569,100.00   |
| ANXIN TRUST CO LTD-A         | 10,100 | 4.44  | 44,844.00    |
| AVIC CAPITAL CO LTD -A       | 16,600 | 4.50  | 74,700.00    |
| CHANGJIANG SECURITIES CO L-A | 10,200 | 5.50  | 56,100.00    |
| CHINA MERCHANTS SECURITIES-A | 10,600 | 14.36 | 152,216.00   |
| CITIC SECURITIES CO-A        | 18,200 | 18.04 | 328,328.00   |
| DONGXING SECURITIES CO LT-A  | 4,200  | 9.74  | 40,908.00    |
| EVERBRIGHT SECURITIE CO -A   | 7,200  | 9.53  | 68,616.00    |
| FIRST CAPITAL SECURITIES C-A | 6,500  | 6.02  | 39,130.00    |
| FOUNDER SECURITIES CO LTD-A  | 15,200 | 6.09  | 92,568.00    |
| GF SECURITIES CO LTD-A       | 10,900 | 13.29 | 144,861.00   |
| GUOSEN SECURITIES CO LTD-A   | 7,600  | 8.47  | 64,372.00    |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A | 13,900 | 16.32 | 226,848.00   |
| GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A  | 6,200  | 7.71  | 47,802.00    |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-A  | 14,900 | 10.06 | 149,894.00   |
| HUAAN SECURITIES CO LTD-A    | 6,700  | 5.05  | 33,835.00    |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-A   | 12,100 | 18.80 | 227,480.00   |
| INDUSTRIAL SECURITIES CO-A   | 12,400 | 5.05  | 62,620.00    |
| ORIENT SECURITIES CO LTD-A   | 11,000 | 8.30  | 91,300.00    |
| SHANXI SECURITIES CO LTD-A   | 5,200  | 6.27  | 32,604.00    |
| SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A  | 34,600 | 4.38  | 151,548.00   |
| SINOLINK SECURITIES CO LTD-A | 5,600  | 7.81  | 43,736.00    |
| SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A  | 5,500  | 7.25  | 39,875.00    |
| WESTERN SECURITIES CO LTD-A  | 6,500  | 8.10  | 52,650.00    |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-A    | 5,100  | 22.30 | 113,730.00   |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A | 11,600 | 30.19 | 350,204.00   |
| HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A | 7,600  | 5.64  | 42,864.00    |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A | 3,800  | 40.93 | 155,534.00   |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-A | 20,000 | 61.29 | 1,225,800.00 |
| CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A | 5,500  | 26.48 | 145,640.00   |
| CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A | 12,200 | 18.68 | 227,896.00   |
| CHINA VANKE CO LTD -A        | 17,900 | 26.10 | 467,190.00   |
| FINANCIAL STREET HOLDINGS-A  | 5,500  | 6.85  | 37,675.00    |
| GEMDALE CORP-A               | 8,300  | 10.10 | 83,830.00    |
| GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A | 15,000 | 6.40  | 96,000.00    |
| JINKE PROPERTIES GROUP CO -A | 9,900  | 5.57  | 55,143.00    |
| POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A | 21,900 | 12.30 | 269,370.00   |
| RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A  | 8,000  | 8.48  | 67,840.00    |
| SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A     | 4,200  | 27.13 | 113,946.00   |
| XINHU ZHONGBAO CO LTD-A      | 15,900 | 2.87  | 45,633.00    |

|       |                              |           |        |                                |
|-------|------------------------------|-----------|--------|--------------------------------|
|       | YOUNGOR GROUP CO-A           | 6,600     | 7.39   | 48,774.00                      |
|       | ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A | 10,100    | 3.74   | 37,774.00                      |
|       | 360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A | 1,900     | 20.30  | 38,570.00                      |
|       | AISINO CORP-A                | 3,400     | 24.84  | 84,456.00                      |
|       | BEIJING SHIJI INFORMATION -A | 1,600     | 27.37  | 43,792.00                      |
|       | DHC SOFTWARE CO LTD -A       | 5,800     | 6.75   | 39,150.00                      |
|       | HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A   | 1,100     | 59.18  | 65,098.00                      |
|       | IFLYTEK CO LTD - A           | 3,800     | 28.20  | 107,160.00                     |
|       | SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A | 8,200     | 3.80   | 31,160.00                      |
|       | YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A  | 3,500     | 25.29  | 88,515.00                      |
|       | BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A | 62,500    | 2.64   | 165,000.00                     |
|       | DONGXU OPTOELECTRONIC TECH-A | 10,100    | 4.46   | 45,046.00                      |
|       | FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A | 22,600    | 5.78   | 130,628.00                     |
|       | GOERTEK INC -A               | 6,000     | 6.95   | 41,700.00                      |
|       | GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A | 4,300     | 8.06   | 34,658.00                      |
|       | HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A | 17,000    | 29.30  | 498,100.00                     |
|       | HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A | 3,500     | 18.17  | 63,595.00                      |
|       | NINESTAR CORP-A              | 1,300     | 24.51  | 31,863.00                      |
|       | O-FILM TECH CO LTD-A         | 5,000     | 9.88   | 49,400.00                      |
|       | TIANMA MICROELECTRONICS-A    | 3,800     | 10.22  | 38,836.00                      |
|       | UNISPLENDOR CORP LTD-A       | 1,300     | 32.52  | 42,276.00                      |
|       | ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A  | 5,300     | 12.40  | 65,720.00                      |
|       | ZTE CORP-A                   | 6,300     | 20.32  | 128,016.00                     |
|       | CHINA UNITED NETWORK-A       | 57,300    | 5.38   | 308,274.00                     |
|       | BEIJING CAPITAL CO LTD-A     | 8,900     | 3.44   | 30,616.00                      |
|       | CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A | 23,900    | 5.30   | 126,670.00                     |
|       | CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A | 27,100    | 15.91  | 431,161.00                     |
|       | GD POWER DEVELOPMENT CO -A   | 36,200    | 2.58   | 93,396.00                      |
|       | HUADIAN POWER INTL CORP-A    | 15,000    | 4.33   | 64,950.00                      |
|       | HUANENG POWER INTL INC-A     | 9,000     | 6.68   | 60,120.00                      |
|       | HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A  | 8,000     | 3.74   | 29,920.00                      |
|       | SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A | 12,500    | 8.24   | 103,000.00                     |
|       | SHENERGY COMPANY LIMITED-A   | 8,400     | 5.07   | 42,588.00                      |
|       | SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A | 6,100     | 5.17   | 31,537.00                      |
|       | SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A | 8,100     | 8.87   | 71,847.00                      |
|       | ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A  | 16,700    | 4.43   | 73,981.00                      |
|       | LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A | 5,200     | 22.53  | 117,156.00                     |
|       | SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A | 7,500     | 10.27  | 77,025.00                      |
|       | オフショア元 小計                    | 3,007,837 |        | 30,429,768.23<br>(492,962,245) |
| トルコリラ | TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE | 15,657    | 135.30 | 2,118,392.10                   |
|       | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | 170,548   | 8.47   | 1,444,541.56                   |

|         |                              |             |        |                                    |
|---------|------------------------------|-------------|--------|------------------------------------|
|         | PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS | 131,726     | 5.88   | 774,548.88                         |
|         | ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI    | 38,674      | 25.12  | 971,490.88                         |
|         | KOC HOLDING AS               | 104,594     | 16.99  | 1,777,052.06                       |
|         | TURK SISE VE CAM FABRIKALARI | 112,856     | 5.89   | 664,721.84                         |
|         | TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS | 26,912      | 26.84  | 722,318.08                         |
|         | TURK HAVA YOLLARI AO         | 61,133      | 14.67  | 896,821.11                         |
|         | FORD OTOMOTIV SANAYI AS      | 6,718       | 59.20  | 397,705.60                         |
|         | ARCELIK AS                   | 29,629      | 17.95  | 531,840.55                         |
|         | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS    | 29,048      | 92.85  | 2,697,106.80                       |
|         | ANADOLU EFES BIRACILIK VE    | 27,231      | 21.20  | 577,297.20                         |
|         | AKBANK T.A.S.                | 374,280     | 6.50   | 2,432,820.00                       |
|         | TURKIYE GARANTI BANKASI      | 288,810     | 9.14   | 2,639,723.40                       |
|         | TURKIYE HALK BANKASI         | 56,840      | 7.84   | 445,625.60                         |
|         | TURKIYE IS BANKASI-C         | 264,371     | 5.44   | 1,438,178.24                       |
|         | HACI OMER SABANCI HOLDING    | 136,771     | 8.79   | 1,202,217.09                       |
|         | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS  | 155,869     | 14.49  | 2,258,541.81                       |
|         | トルコリラ 小計                     | 2,031,667   |        | 23,990,942.80<br>(498,051,972)     |
| ユーロ     | MOTOR OIL (HELLAS) SA        | 9,079       | 21.60  | 196,106.40                         |
|         | TITAN CEMENT CO. S.A.        | 7,404       | 20.65  | 152,892.60                         |
|         | FF GROUP                     | 5,889       | 4.80   | 28,267.20                          |
|         | OPAP SA                      | 29,012      | 8.55   | 248,052.60                         |
|         | JUMBO SA                     | 12,381      | 14.00  | 173,334.00                         |
|         | ALPHA BANK AE                | 200,953     | 0.97   | 195,728.22                         |
|         | HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA | 30,664      | 11.04  | 338,530.56                         |
|         | ユーロ 小計                       | 295,382     |        | 1,332,911.58<br>(166,294,048)      |
| カタールリアル | INDUSTRIES QATAR             | 22,839      | 145.03 | 3,312,340.17                       |
|         | COMMERCIAL BANK PQSC         | 27,144      | 42.00  | 1,140,048.00                       |
|         | MASRAF AL RAYAN              | 45,487      | 40.50  | 1,842,223.50                       |
|         | QATAR ISLAMIC BANK           | 14,967      | 156.99 | 2,349,669.33                       |
|         | QATAR NATIONAL BANK          | 58,892      | 198.50 | 11,690,062.00                      |
|         | QATAR INSURANCE CO           | 22,556      | 39.89  | 899,758.84                         |
|         | BARWA REAL ESTATE CO         | 24,999      | 39.99  | 999,710.01                         |
|         | EZDAN HOLDING GROUP          | 112,708     | 14.80  | 1,668,078.40                       |
|         | OOREDOO QPSC                 | 8,931       | 75.80  | 676,969.80                         |
|         | QATAR ELECTRICITY & WATER CO | 6,941       | 186.49 | 1,294,427.09                       |
|         | カタールリアル 小計                   | 345,464     |        | 25,873,287.14<br>(778,527,210)     |
|         | 合計                           | 730,597,072 |        | 75,090,138,407<br>(75,090,138,407) |

(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 | FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | 429,300   | 10,758,258.00                  |    |
| メキシコペソ合計   |      |                             | 429,300   | 10,758,258.00<br>(61,967,566)  |    |
| 南アフリカランド   | 投資証券 | FORTRESS REIT LTD-A         | 126,873   | 2,416,930.65                   |    |
|            |      | FORTRESS REIT LTD-B         | 89,509    | 1,338,159.55                   |    |
|            |      | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD  | 399,492   | 10,043,228.88                  |    |
|            |      | HYPROP INVESTMENTS LTD      | 28,577    | 2,503,345.20                   |    |
|            |      | REDEFINE PROPERTIES LTD     | 733,720   | 7,410,572.00                   |    |
|            |      | RESILIENT REIT LTD          | 30,408    | 1,839,684.00                   |    |
| 南アフリカランド合計 |      |                             | 1,408,579 | 25,551,920.28<br>(205,437,439) |    |
| 合計         |      |                             |           | 267,405,005<br>(267,405,005)   |    |

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

## 外貨建有価証券の内訳

| 種類         | 銘柄数      | 組入株式<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|------------|----------|--------------|----------------|-------------------------|
| アメリカドル     | 株式 50銘柄  | 100.00%      |                | 11.81%                  |
| イギリスポンド    | 株式 1銘柄   | 100.00%      |                | 0.04%                   |
| 香港ドル       | 株式 204銘柄 | 100.00%      |                | 22.80%                  |
| マレーシアリングット | 株式 44銘柄  | 100.00%      |                | 2.34%                   |
| タイバーツ      | 株式 35銘柄  | 100.00%      |                | 2.45%                   |
| フィリピンペソ    | 株式 23銘柄  | 100.00%      |                | 1.14%                   |
| インドネシアルピア  | 株式 28銘柄  | 100.00%      |                | 2.33%                   |
| メキシコペソ     | 株式 25銘柄  | 97.09%       |                | 2.74%                   |
|            | 投資証券 1銘柄 |              | 2.91%          | 0.08%                   |
| ブラジルリアル    | 株式 52銘柄  | 100.00%      |                | 7.92%                   |
| チリペソ       | 株式 17銘柄  | 100.00%      |                | 1.12%                   |
| 韓国ウォン      | 株式 117銘柄 | 100.00%      |                | 13.91%                  |
| ニュー台湾ドル    | 株式 86銘柄  | 100.00%      |                | 10.90%                  |
| インドルピー     | 株式 78銘柄  | 100.00%      |                | 8.67%                   |
| チェココルナ     | 株式 3銘柄   | 100.00%      |                | 0.17%                   |

|            |      |       |         |       |       |
|------------|------|-------|---------|-------|-------|
| コロンビアペソ    | 株式   | 9銘柄   | 100.00% |       | 0.42% |
| ハンガリーフォリント | 株式   | 3銘柄   | 100.00% |       | 0.31% |
| アラブディルハム   | 株式   | 9銘柄   | 100.00% |       | 0.65% |
| ポーランドズロチ   | 株式   | 20銘柄  | 100.00% |       | 1.25% |
| 南アフリカランド   | 株式   | 43銘柄  | 95.73%  |       | 6.11% |
|            | 投資証券 | 6銘柄   |         | 4.27% | 0.27% |
| オフショア元     | 株式   | 234銘柄 | 100.00% |       | 0.65% |
| トルコリラ      | 株式   | 18銘柄  | 100.00% |       | 0.66% |
| ユーロ        | 株式   | 7銘柄   | 100.00% |       | 0.22% |
| カタールリアル    | 株式   | 10銘柄  | 100.00% |       | 1.03% |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

## 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）

[平成31年 1月28日現在]

|          |                 |
|----------|-----------------|
| 資産の部     |                 |
| 流動資産     |                 |
| コール・ローン  | 2,233,777,115   |
| 国債証券     | 484,502,656,770 |
| 地方債証券    | 31,281,305,364  |
| 特殊債証券    | 38,861,920,421  |
| 社債証券     | 29,472,971,150  |
| 派生商品評価勘定 | 828,920         |
| 未収入金     | 1,655,680       |
| 未収利息     | 1,185,140,822   |
| 前払費用     | 36,571,933      |
| 差入委託証拠金  | 1,680,000       |
| 流動資産合計   | 587,578,508,175 |
| 資産合計     | 587,578,508,175 |
| 負債の部     |                 |
| 流動負債     |                 |
| 派生商品評価勘定 | 53,240          |
| 前受金      | 2,420,000       |
| 未払金      | 744,684,000     |
| 未払解約金    | 140,933,026     |
| 未払利息     | 4,264           |
| その他未払費用  | 12,342          |
| 流動負債合計   | 888,106,872     |
| 負債合計     | 888,106,872     |
| 純資産の部    |                 |
| 元本等      |                 |

[平成31年 1月28日現在]

|             |                 |
|-------------|-----------------|
| 元本          | 437,454,298,881 |
| 剰余金         |                 |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 149,236,102,422 |
| 元本等合計       | 586,690,401,303 |
| 純資産合計       | 586,690,401,303 |
| 負債純資産合計     | 587,578,508,175 |

## 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)

|                                  | [平成31年 1月28日現在]  |
|----------------------------------|------------------|
| 1. 期首                            | 平成30年 1月27日      |
| 期首元本額                            | 341,421,490,015円 |
| 期中追加設定元本額                        | 257,424,533,223円 |
| 期中一部解約元本額                        | 161,391,724,357円 |
| 元本の内訳                            |                  |
| ファンド・マネジャー（国内債券）                 | 100,231,119,307円 |
| eMAXIS 国内債券インデックス                | 10,265,035,614円  |
| eMAXIS バランス（8資産均等型）              | 2,335,318,060円   |
| eMAXIS バランス（波乗り型）                | 835,832,929円     |
| コアバランス                           | 2,223,468円       |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金） | 131,427,516円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金） | 81,779,670円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金） | 38,068,263円      |
| eMAXIS Slim 国内債券インデックス           | 2,025,880,507円   |
| 国内債券セレクション（ラップ向け）                | 3,726,196,761円   |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）         | 1,737,681,048円   |
| つみたて8資産均等バランス                    | 479,693,633円     |
| つみたて4資産均等バランス                    | 120,370,097円     |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s            | 2,539,278円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s            | 592,730円         |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s            | 50,232円          |



[平成31年 1月28日現在]

|  |                  |
|--|------------------|
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)         | 12,141,092円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)         | 5,929,732円       |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)         | 3,520,617円       |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)         | 1,920,313円       |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)                | 11,632,913,646円  |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)                | 11,949,375,362円  |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)               | 2,264,800,003円   |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)           | 2,235,188,689円   |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)                | 7,894,763,114円   |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)                   | 253,372,348円     |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)                 | 287,208,924円     |
| eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)                    | 95,606,312円      |
| eMAXIS バランス(4資産均等型)                      | 248,637,427円     |
| eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)                | 326,153,971円     |
| eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)                | 217,982,772円     |
| eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)               | 455,972,006円     |
| eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)                  | 54,020,204円      |
| eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)                 | 11,106,288円      |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)            | 100,454,102円     |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)            | 12,167,615,227円  |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)          | 1,226,625,786円   |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)          | 5,271,654,620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)           | 187,100,786,947円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)          | 560,609,900円     |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投資家限定)          | 12,733,917円      |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)            | 25,003,480円      |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定)          | 144,507,694円     |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)          | 32,799,040円      |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)            | 4,884,699,000円   |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)            | 3,432,113,551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)  | 15,532,437,833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) | 5,698,651,537円   |

|   | [平成31年 1月28日現在]  |
|---|------------------|
| 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）   | 2,850,998,382円   |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）              | 147,715,824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）       | 19,696,289,215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） | 258,932,217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）        | 5,294,121,900円   |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA              | 18,129,093円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA            | 33,029,511円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA              | 24,260,749円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA              | 15,326,183円      |
| 三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）              | 144,468,100円     |
| 三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）              | 282,669,996円     |
| 三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）              | 104,987,757円     |
| 三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）              | 207,153,129円     |
| 三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド                | 3,676,867,258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）     | 1,867,952,451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）   | 3,527,176,851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）     | 1,971,123,471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）     | 1,177,982,227円   |
| 合計                                      | 437,454,298,881円 |
| 2. 受益権の総数                               | 437,454,298,881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 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日  |
|----------------|---|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 |

|                          |   |
|--------------------------|---|
| 区分                       | 自 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日  |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。<br>当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。<br>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。<br>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。   |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

|                            |   |
|----------------------------|---|
| 区分                         | [平成31年 1月28日現在]   |
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。  |
| 2. 時価の算定方法                 | (1) 有価証券<br>売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。<br>(2) デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。<br>(3) 上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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    | [平成31年 1月28日現在]    |
|       | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券  | 2,893,824,930      |
| 地方債証券 | 8,288,410          |
| 特殊債券  | 45,724,376         |
| 社債券   | 43,727,010         |

|    |               |
|----|---------------|
| 合計 | 2,887,533,886 |
|----|---------------|

(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

[平成31年 1月28日現在]

| 区分   | 種類           | 契約額等(円)     |       | 時価(円)       | 評価損益(円) |
|------|--------------|-------------|-------|-------------|---------|
|      |              |             | うち1年超 |             |         |
| 市場取引 | 債券先物取引<br>買建 | 609,900,000 |       | 610,680,000 | 780,000 |
|      | 合計           | 609,900,000 |       | 610,680,000 | 780,000 |

(注)時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

|              | [平成31年 1月28日現在] |
|--------------|-----------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.3411円         |
| (1万口当たり純資産額) | (13,411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385回利付国債(2年)  | 2,500,000,000 | 2,507,450,000 |    |
|      | 第386回利付国債(2年)  | 1,700,000,000 | 1,705,440,000 |    |
|      | 第387回利付国債(2年)  | 1,200,000,000 | 1,204,140,000 |    |
|      | 第388回利付国債(2年)  | 850,000,000   | 853,128,000   |    |
|      | 第389回利付国債(2年)  | 850,000,000   | 853,238,500   |    |
|      | 第390回利付国債(2年)  | 4,150,000,000 | 4,166,517,000 |    |
|      | 第391回利付国債(2年)  | 4,700,000,000 | 4,719,834,000 |    |
|      | 第392回利付国債(2年)  | 3,300,000,000 | 3,314,718,000 |    |
|      | 第393回利付国債(2年)  | 900,000,000   | 904,140,000   |    |
|      | 第394回利付国債(2年)  | 2,350,000,000 | 2,361,162,500 |    |
|      | 第395回利付国債(2年)  | 1,300,000,000 | 1,306,344,000 |    |
|      | 第123回利付国債(5年)  | 1,560,000,000 | 1,564,882,800 |    |
|      | 第124回利付国債(5年)  | 2,430,000,000 | 2,439,112,500 |    |
|      | 第125回利付国債(5年)  | 4,400,000,000 | 4,419,536,000 |    |
|      | 第126回利付国債(5年)  | 2,960,000,000 | 2,975,155,200 |    |
|      | 第127回利付国債(5年)  | 3,870,000,000 | 3,892,407,300 |    |
|      | 第128回利付国債(5年)  | 3,850,000,000 | 3,874,909,500 |    |
|      | 第129回利付国債(5年)  | 3,100,000,000 | 3,122,196,000 |    |
|      | 第130回利付国債(5年)  | 4,950,000,000 | 4,988,808,000 |    |
|      | 第131回利付国債(5年)  | 4,210,000,000 | 4,245,827,100 |    |
|      | 第132回利付国債(5年)  | 3,650,000,000 | 3,683,580,000 |    |
|      | 第133回利付国債(5年)  | 5,970,000,000 | 6,029,043,300 |    |
|      | 第134回利付国債(5年)  | 5,710,000,000 | 5,770,354,700 |    |
|      | 第135回利付国債(5年)  | 4,480,000,000 | 4,530,355,200 |    |
|      | 第136回利付国債(5年)  | 4,950,000,000 | 5,009,053,500 |    |
|      | 第137回利付国債(5年)  | 4,750,000,000 | 4,809,992,500 |    |
|      | 第1回利付国債(40年)   | 475,000,000   | 696,549,500   |    |
|      | 第2回利付国債(40年)   | 870,000,000   | 1,237,896,900 |    |
|      | 第3回利付国債(40年)   | 733,000,000   | 1,048,944,990 |    |
|      | 第4回利付国債(40年)   | 1,098,000,000 | 1,579,824,360 |    |
|      | 第5回利付国債(40年)   | 1,175,000,000 | 1,631,945,750 |    |
|      | 第6回利付国債(40年)   | 1,070,000,000 | 1,459,982,900 |    |
|      | 第7回利付国債(40年)   | 1,190,000,000 | 1,556,305,800 |    |
|      | 第8回利付国債(40年)   | 1,250,000,000 | 1,519,887,500 |    |
|      | 第9回利付国債(40年)   | 1,940,000,000 | 1,732,691,600 |    |
|      | 第10回利付国債(40年)  | 1,960,000,000 | 2,065,546,000 |    |
|      | 第11回利付国債(40年)  | 1,310,000,000 | 1,333,842,000 |    |
|      | 第306回利付国債(10年) | 3,688,000,000 | 3,754,162,720 |    |
|      | 第307回利付国債(10年) | 1,610,000,000 | 1,637,048,000 |    |
|      | 第308回利付国債(10年) | 1,374,000,000 | 1,402,112,040 |    |
|      | 第309回利付国債(10年) | 3,700,000,000 | 3,765,416,000 |    |

|                |               |               |  |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第310回利付国債(10年) | 2,136,000,000 | 2,177,118,000 |  |
| 第311回利付国債(10年) | 2,100,000,000 | 2,133,516,000 |  |
| 第312回利付国債(10年) | 6,860,000,000 | 7,037,536,800 |  |
| 第313回利付国債(10年) | 3,469,000,000 | 3,577,961,290 |  |
| 第314回利付国債(10年) | 1,190,000,000 | 1,222,272,800 |  |
| 第315回利付国債(10年) | 3,633,000,000 | 3,751,908,090 |  |
| 第316回利付国債(10年) | 2,280,000,000 | 2,349,175,200 |  |
| 第317回利付国債(10年) | 1,957,000,000 | 2,022,657,350 |  |
| 第318回利付国債(10年) | 2,480,000,000 | 2,556,632,000 |  |
| 第319回利付国債(10年) | 1,719,000,000 | 1,782,138,870 |  |
| 第320回利付国債(10年) | 1,980,000,000 | 2,046,983,400 |  |
| 第321回利付国債(10年) | 2,515,000,000 | 2,607,375,950 |  |
| 第322回利付国債(10年) | 1,470,000,000 | 1,519,362,600 |  |
| 第323回利付国債(10年) | 1,675,000,000 | 1,735,785,750 |  |
| 第324回利付国債(10年) | 2,800,000,000 | 2,892,064,000 |  |
| 第325回利付国債(10年) | 3,835,000,000 | 3,970,528,900 |  |
| 第326回利付国債(10年) | 730,000,000   | 754,717,800   |  |
| 第327回利付国債(10年) | 2,540,000,000 | 2,635,961,200 |  |
| 第328回利付国債(10年) | 3,700,000,000 | 3,817,882,000 |  |
| 第329回利付国債(10年) | 5,860,000,000 | 6,109,987,600 |  |
| 第330回利付国債(10年) | 3,330,000,000 | 3,480,282,900 |  |
| 第331回利付国債(10年) | 1,060,000,000 | 1,097,916,200 |  |
| 第332回利付国債(10年) | 5,040,000,000 | 5,230,058,400 |  |
| 第333回利付国債(10年) | 5,350,000,000 | 5,560,576,000 |  |
| 第334回利付国債(10年) | 4,830,000,000 | 5,029,527,300 |  |
| 第335回利付国債(10年) | 4,970,000,000 | 5,156,722,900 |  |
| 第336回利付国債(10年) | 4,080,000,000 | 4,240,099,200 |  |
| 第337回利付国債(10年) | 940,000,000   | 965,709,000   |  |
| 第338回利付国債(10年) | 3,730,000,000 | 3,859,431,000 |  |
| 第339回利付国債(10年) | 4,960,000,000 | 5,139,254,400 |  |
| 第340回利付国債(10年) | 5,350,000,000 | 5,549,234,000 |  |
| 第341回利付国債(10年) | 4,120,000,000 | 4,250,521,600 |  |
| 第342回利付国債(10年) | 3,580,000,000 | 3,645,872,000 |  |
| 第343回利付国債(10年) | 4,760,000,000 | 4,848,869,200 |  |
| 第344回利付国債(10年) | 3,660,000,000 | 3,727,819,800 |  |
| 第345回利付国債(10年) | 4,190,000,000 | 4,266,802,700 |  |
| 第346回利付国債(10年) | 4,790,000,000 | 4,876,555,300 |  |
| 第347回利付国債(10年) | 3,750,000,000 | 3,815,062,500 |  |
| 第348回利付国債(10年) | 5,600,000,000 | 5,692,624,000 |  |
| 第349回利付国債(10年) | 4,190,000,000 | 4,255,615,400 |  |
| 第350回利付国債(10年) | 5,550,000,000 | 5,628,976,500 |  |
| 第351回利付国債(10年) | 6,500,000,000 | 6,582,615,000 |  |

|                |               |               |  |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第352回利付国債(10年) | 5,710,000,000 | 5,776,178,900 |  |
| 第1回利付国債(30年)   | 76,000,000    | 98,122,080    |  |
| 第2回利付国債(30年)   | 98,000,000    | 123,331,040   |  |
| 第3回利付国債(30年)   | 117,000,000   | 146,425,500   |  |
| 第4回利付国債(30年)   | 127,000,000   | 168,893,490   |  |
| 第5回利付国債(30年)   | 108,000,000   | 135,483,840   |  |
| 第6回利付国債(30年)   | 169,000,000   | 217,467,510   |  |
| 第7回利付国債(30年)   | 164,000,000   | 210,128,280   |  |
| 第8回利付国債(30年)   | 142,000,000   | 173,238,580   |  |
| 第9回利付国債(30年)   | 116,000,000   | 135,177,120   |  |
| 第10回利付国債(30年)  | 185,000,000   | 208,176,800   |  |
| 第11回利付国債(30年)  | 137,000,000   | 165,857,680   |  |
| 第12回利付国債(30年)  | 220,000,000   | 279,457,200   |  |
| 第13回利付国債(30年)  | 205,000,000   | 257,795,700   |  |
| 第14回利付国債(30年)  | 493,000,000   | 650,439,550   |  |
| 第15回利付国債(30年)  | 346,000,000   | 463,079,480   |  |
| 第16回利付国債(30年)  | 302,000,000   | 405,196,420   |  |
| 第17回利付国債(30年)  | 327,000,000   | 434,448,930   |  |
| 第18回利付国債(30年)  | 427,000,000   | 561,902,110   |  |
| 第19回利付国債(30年)  | 303,000,000   | 399,532,770   |  |
| 第20回利付国債(30年)  | 495,000,000   | 669,725,100   |  |
| 第21回利付国債(30年)  | 379,000,000   | 501,659,560   |  |
| 第22回利付国債(30年)  | 570,000,000   | 775,017,600   |  |
| 第23回利付国債(30年)  | 554,000,000   | 754,802,840   |  |
| 第24回利付国債(30年)  | 411,000,000   | 561,080,760   |  |
| 第25回利付国債(30年)  | 742,000,000   | 989,768,640   |  |
| 第26回利付国債(30年)  | 884,000,000   | 1,196,113,880 |  |
| 第27回利付国債(30年)  | 860,000,000   | 1,182,525,800 |  |
| 第28回利付国債(30年)  | 911,000,000   | 1,257,781,260 |  |
| 第29回利付国債(30年)  | 1,450,000,000 | 1,983,513,000 |  |
| 第30回利付国債(30年)  | 1,496,000,000 | 2,025,703,680 |  |
| 第31回利付国債(30年)  | 1,358,000,000 | 1,818,864,460 |  |
| 第32回利付国債(30年)  | 1,739,000,000 | 2,373,682,830 |  |
| 第33回利付国債(30年)  | 1,764,000,000 | 2,307,735,360 |  |
| 第34回利付国債(30年)  | 2,116,000,000 | 2,864,344,560 |  |
| 第35回利付国債(30年)  | 2,389,000,000 | 3,143,398,420 |  |
| 第36回利付国債(30年)  | 1,829,000,000 | 2,412,944,830 |  |
| 第37回利付国債(30年)  | 2,057,000,000 | 2,677,164,930 |  |
| 第38回利付国債(30年)  | 1,185,000,000 | 1,518,423,450 |  |
| 第39回利付国債(30年)  | 1,340,000,000 | 1,749,705,000 |  |
| 第40回利付国債(30年)  | 1,140,000,000 | 1,465,116,600 |  |
| 第41回利付国債(30年)  | 1,070,000,000 | 1,351,228,100 |  |

|                 |               |               |  |
|-----------------|---------------|---------------|--|
| 第4 2 回利付国債(30年) | 1,250,000,000 | 1,581,412,500 |  |
| 第4 3 回利付国債(30年) | 1,320,000,000 | 1,671,212,400 |  |
| 第4 4 回利付国債(30年) | 1,290,000,000 | 1,634,378,400 |  |
| 第4 5 回利付国債(30年) | 1,190,000,000 | 1,452,787,700 |  |
| 第4 6 回利付国債(30年) | 1,550,000,000 | 1,892,968,500 |  |
| 第4 7 回利付国債(30年) | 1,720,000,000 | 2,143,584,400 |  |
| 第4 8 回利付国債(30年) | 1,310,000,000 | 1,568,725,000 |  |
| 第4 9 回利付国債(30年) | 2,150,000,000 | 2,575,076,500 |  |
| 第5 0 回利付国債(30年) | 1,470,000,000 | 1,540,398,300 |  |
| 第5 1 回利付国債(30年) | 1,890,000,000 | 1,740,236,400 |  |
| 第5 2 回利付国債(30年) | 1,660,000,000 | 1,611,079,800 |  |
| 第5 3 回利付国債(30年) | 980,000,000   | 975,335,200   |  |
| 第5 4 回利付国債(30年) | 1,870,000,000 | 1,955,309,400 |  |
| 第5 5 回利付国債(30年) | 1,500,000,000 | 1,567,065,000 |  |
| 第5 6 回利付国債(30年) | 1,490,000,000 | 1,555,217,300 |  |
| 第5 7 回利付国債(30年) | 1,560,000,000 | 1,626,799,200 |  |
| 第5 8 回利付国債(30年) | 2,160,000,000 | 2,250,396,000 |  |
| 第5 9 回利付国債(30年) | 990,000,000   | 1,004,691,600 |  |
| 第6 0 回利付国債(30年) | 1,580,000,000 | 1,686,539,400 |  |
| 第4 4 回利付国債(20年) | 480,000,000   | 494,654,400   |  |
| 第4 7 回利付国債(20年) | 114,000,000   | 118,463,100   |  |
| 第4 8 回利付国債(20年) | 209,000,000   | 219,619,290   |  |
| 第4 9 回利付国債(20年) | 515,000,000   | 540,137,150   |  |
| 第5 1 回利付国債(20年) | 200,000,000   | 210,422,000   |  |
| 第5 2 回利付国債(20年) | 214,000,000   | 226,899,920   |  |
| 第5 4 回利付国債(20年) | 480,000,000   | 513,043,200   |  |
| 第5 5 回利付国債(20年) | 241,000,000   | 257,506,090   |  |
| 第5 6 回利付国債(20年) | 449,000,000   | 482,127,220   |  |
| 第5 8 回利付国債(20年) | 147,000,000   | 158,119,080   |  |
| 第5 9 回利付国債(20年) | 589,000,000   | 632,008,780   |  |
| 第6 1 回利付国債(20年) | 289,000,000   | 303,022,280   |  |
| 第6 3 回利付国債(20年) | 442,000,000   | 480,396,540   |  |
| 第6 4 回利付国債(20年) | 441,000,000   | 483,477,120   |  |
| 第6 5 回利付国債(20年) | 318,000,000   | 350,286,540   |  |
| 第6 6 回利付国債(20年) | 500,000,000   | 548,300,000   |  |
| 第6 8 回利付国債(20年) | 846,000,000   | 949,161,240   |  |
| 第7 0 回利付国債(20年) | 422,000,000   | 480,590,480   |  |
| 第7 1 回利付国債(20年) | 160,000,000   | 180,476,800   |  |
| 第7 2 回利付国債(20年) | 534,000,000   | 602,522,880   |  |
| 第7 3 回利付国債(20年) | 620,000,000   | 699,422,000   |  |
| 第7 4 回利付国債(20年) | 318,000,000   | 360,627,900   |  |
| 第7 5 回利付国債(20年) | 575,000,000   | 655,333,250   |  |



|                |               |               |  |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第76回利付国債(20年)  | 200,000,000   | 225,464,000   |  |
| 第77回利付国債(20年)  | 210,000,000   | 238,039,200   |  |
| 第78回利付国債(20年)  | 410,000,000   | 464,366,000   |  |
| 第79回利付国債(20年)  | 50,000,000    | 56,953,000    |  |
| 第80回利付国債(20年)  | 315,000,000   | 360,835,650   |  |
| 第81回利付国債(20年)  | 350,000,000   | 400,477,000   |  |
| 第82回利付国債(20年)  | 662,000,000   | 761,909,040   |  |
| 第83回利付国債(20年)  | 413,000,000   | 477,696,450   |  |
| 第84回利付国債(20年)  | 670,000,000   | 770,292,300   |  |
| 第85回利付国債(20年)  | 490,000,000   | 569,331,000   |  |
| 第86回利付国債(20年)  | 515,000,000   | 605,804,800   |  |
| 第87回利付国債(20年)  | 450,000,000   | 526,099,500   |  |
| 第88回利付国債(20年)  | 804,000,000   | 950,464,680   |  |
| 第89回利付国債(20年)  | 410,000,000   | 481,631,100   |  |
| 第90回利付国債(20年)  | 1,100,000,000 | 1,297,802,000 |  |
| 第91回利付国債(20年)  | 468,000,000   | 555,768,720   |  |
| 第92回利付国債(20年)  | 1,432,000,000 | 1,685,234,880 |  |
| 第93回利付国債(20年)  | 390,000,000   | 457,563,600   |  |
| 第94回利付国債(20年)  | 615,000,000   | 726,591,750   |  |
| 第95回利付国債(20年)  | 1,017,000,000 | 1,223,491,680 |  |
| 第96回利付国債(20年)  | 320,000,000   | 379,558,400   |  |
| 第97回利付国債(20年)  | 343,000,000   | 411,226,130   |  |
| 第98回利付国債(20年)  | 470,000,000   | 559,394,000   |  |
| 第99回利付国債(20年)  | 1,345,000,000 | 1,606,104,850 |  |
| 第100回利付国債(20年) | 1,060,000,000 | 1,278,911,200 |  |
| 第101回利付国債(20年) | 573,000,000   | 701,856,240   |  |
| 第102回利付国債(20年) | 530,000,000   | 651,566,100   |  |
| 第103回利付国債(20年) | 640,000,000   | 780,768,000   |  |
| 第104回利付国債(20年) | 300,000,000   | 360,333,000   |  |
| 第105回利付国債(20年) | 870,000,000   | 1,048,158,600 |  |
| 第106回利付国債(20年) | 711,000,000   | 863,466,840   |  |
| 第107回利付国債(20年) | 567,000,000   | 685,100,430   |  |
| 第108回利付国債(20年) | 800,000,000   | 950,800,000   |  |
| 第109回利付国債(20年) | 800,000,000   | 953,592,000   |  |
| 第110回利付国債(20年) | 1,096,000,000 | 1,328,636,960 |  |
| 第111回利付国債(20年) | 711,000,000   | 871,693,110   |  |
| 第112回利付国債(20年) | 1,340,000,000 | 1,628,957,600 |  |
| 第113回利付国債(20年) | 1,382,000,000 | 1,685,431,920 |  |
| 第114回利付国債(20年) | 1,320,000,000 | 1,614,835,200 |  |
| 第115回利付国債(20年) | 1,154,000,000 | 1,424,278,340 |  |
| 第116回利付国債(20年) | 1,346,000,000 | 1,665,580,780 |  |
| 第117回利付国債(20年) | 1,210,000,000 | 1,483,895,600 |  |

|                |               |               |  |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第118回利付国債(20年) | 776,000,000   | 945,750,000   |  |
| 第119回利付国債(20年) | 660,000,000   | 789,452,400   |  |
| 第120回利付国債(20年) | 810,000,000   | 950,559,300   |  |
| 第121回利付国債(20年) | 989,000,000   | 1,197,293,290 |  |
| 第122回利付国債(20年) | 760,000,000   | 911,293,200   |  |
| 第123回利付国債(20年) | 1,368,000,000 | 1,692,475,920 |  |
| 第124回利付国債(20年) | 750,000,000   | 919,065,000   |  |
| 第125回利付国債(20年) | 1,054,000,000 | 1,320,208,780 |  |
| 第126回利付国債(20年) | 890,000,000   | 1,093,427,300 |  |
| 第127回利付国債(20年) | 440,000,000   | 535,290,800   |  |
| 第128回利付国債(20年) | 1,014,000,000 | 1,235,842,920 |  |
| 第129回利付国債(20年) | 450,000,000   | 542,947,500   |  |
| 第130回利付国債(20年) | 1,682,000,000 | 2,033,857,580 |  |
| 第131回利付国債(20年) | 780,000,000   | 933,457,200   |  |
| 第132回利付国債(20年) | 1,187,000,000 | 1,422,358,360 |  |
| 第133回利付国債(20年) | 1,740,000,000 | 2,107,053,000 |  |
| 第134回利付国債(20年) | 1,135,000,000 | 1,377,152,250 |  |
| 第135回利付国債(20年) | 600,000,000   | 720,276,000   |  |
| 第136回利付国債(20年) | 650,000,000   | 771,920,500   |  |
| 第137回利付国債(20年) | 882,000,000   | 1,060,737,300 |  |
| 第138回利付国債(20年) | 400,000,000   | 470,568,000   |  |
| 第139回利付国債(20年) | 100,000,000   | 118,953,000   |  |
| 第140回利付国債(20年) | 2,397,000,000 | 2,887,857,660 |  |
| 第141回利付国債(20年) | 2,220,000,000 | 2,679,096,000 |  |
| 第142回利付国債(20年) | 1,090,000,000 | 1,330,192,400 |  |
| 第143回利付国債(20年) | 1,980,000,000 | 2,365,981,200 |  |
| 第144回利付国債(20年) | 1,300,000,000 | 1,535,508,000 |  |
| 第145回利付国債(20年) | 2,810,000,000 | 3,401,898,400 |  |
| 第146回利付国債(20年) | 2,260,000,000 | 2,740,250,000 |  |
| 第147回利付国債(20年) | 2,410,000,000 | 2,889,493,600 |  |
| 第148回利付国債(20年) | 3,240,000,000 | 3,841,894,800 |  |
| 第149回利付国債(20年) | 2,220,000,000 | 2,635,117,800 |  |
| 第150回利付国債(20年) | 2,620,000,000 | 3,073,522,000 |  |
| 第151回利付国債(20年) | 2,540,000,000 | 2,902,127,800 |  |
| 第152回利付国債(20年) | 2,740,000,000 | 3,131,600,800 |  |
| 第153回利付国債(20年) | 2,960,000,000 | 3,430,403,200 |  |
| 第154回利付国債(20年) | 2,760,000,000 | 3,153,686,400 |  |
| 第155回利付国債(20年) | 2,800,000,000 | 3,107,580,000 |  |
| 第156回利付国債(20年) | 2,330,000,000 | 2,352,624,300 |  |
| 第157回利付国債(20年) | 2,340,000,000 | 2,280,587,400 |  |
| 第158回利付国債(20年) | 2,420,000,000 | 2,476,192,400 |  |
| 第159回利付国債(20年) | 2,250,000,000 | 2,338,785,000 |  |

|         |                   |                 |                 |
|---------|-------------------|-----------------|-----------------|
|         | 第160回利付国債（20年）    | 2,630,000,000   | 2,775,149,700   |
|         | 第161回利付国債（20年）    | 1,810,000,000   | 1,875,214,300   |
|         | 第162回利付国債（20年）    | 2,710,000,000   | 2,804,009,900   |
|         | 第163回利付国債（20年）    | 2,730,000,000   | 2,820,936,300   |
|         | 第164回利付国債（20年）    | 2,680,000,000   | 2,715,563,600   |
|         | 第165回利付国債（20年）    | 1,730,000,000   | 1,750,102,600   |
|         | 第166回利付国債（20年）    | 2,330,000,000   | 2,441,723,500   |
| 国債証券 合計 |                   | 445,169,000,000 | 484,502,656,770 |
| 地方債証券   | 第1回東京都公募公債（20年）   | 20,000,000      | 21,333,000      |
|         | 第7回東京都公募公債（30年）   | 10,000,000      | 13,497,400      |
|         | 第8回東京都公募公債（30年）   | 80,000,000      | 103,817,600     |
|         | 第16回東京都公募公債（20年）  | 100,000,000     | 118,316,000     |
|         | 第20回東京都公募公債（20年）  | 80,000,000      | 96,058,400      |
|         | 第21回東京都公募公債（20年）  | 80,000,000      | 97,179,200      |
|         | 第22回東京都公募公債（20年）  | 120,000,000     | 142,914,000     |
|         | 第24回東京都公募公債（20年）  | 70,000,000      | 84,555,100      |
|         | 第28回東京都公募公債（20年）  | 100,000,000     | 117,015,000     |
|         | 第680回東京都公募公債      | 100,000,000     | 101,551,000     |
|         | 第681回東京都公募公債      | 100,000,000     | 101,563,000     |
|         | 第686回東京都公募公債      | 100,000,000     | 101,465,000     |
|         | 第687回東京都公募公債      | 100,000,000     | 101,792,000     |
|         | 第693回東京都公募公債      | 100,000,000     | 102,894,000     |
|         | 第705回東京都公募公債      | 170,000,000     | 175,536,900     |
|         | 第709回東京都公募公債      | 100,000,000     | 102,576,000     |
|         | 第722回東京都公募公債      | 100,000,000     | 103,418,000     |
|         | 第729回東京都公募公債      | 100,000,000     | 103,438,000     |
|         | 第749回東京都公募公債      | 300,000,000     | 308,274,000     |
|         | 第752回東京都公募公債      | 100,000,000     | 100,729,000     |
|         | 第754回東京都公募公債      | 120,000,000     | 120,342,000     |
|         | 第755回東京都公募公債      | 300,000,000     | 300,855,000     |
|         | 第758回東京都公募公債      | 300,000,000     | 300,219,000     |
|         | 第765回東京都公募公債      | 300,000,000     | 304,506,000     |
|         | 平成21年度第14回北海道公募公債 | 100,000,000     | 101,604,000     |
|         | 平成22年度第8回北海道公募公債  | 100,000,000     | 101,618,000     |
|         | 平成25年度第4回北海道公募公債  | 100,000,000     | 103,610,000     |
|         | 平成25年度第7回北海道公募公債  | 150,000,000     | 155,287,500     |
|         | 平成25年度第9回北海道公募公債  | 300,000,000     | 309,546,000     |
|         | 平成27年度第9回北海道公募公債  | 200,000,000     | 206,146,000     |
|         | 平成27年度第15回北海道公募公債 | 100,000,000     | 101,342,000     |
|         | 平成29年度第15回北海道公募公債 | 117,000,000     | 118,208,610     |
|         | 第29回1号宮城県公募公債     | 100,000,000     | 103,125,000     |
|         | 第2回神奈川県公募公債（20年）  | 80,000,000      | 89,967,200      |

|                       |             |             |  |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 第2回神奈川県公募公債(30年)      | 80,000,000  | 111,396,800 |  |
| 第27回神奈川県公募公債(20年)     | 100,000,000 | 114,777,000 |  |
| 第171回神奈川県公募公債         | 100,000,000 | 101,578,000 |  |
| 第189回神奈川県公募公債         | 400,000,000 | 410,896,000 |  |
| 第191回神奈川県公募公債         | 100,000,000 | 102,745,000 |  |
| 第226回神奈川県公募公債         | 300,000,000 | 303,648,000 |  |
| 第228回神奈川県公募公債         | 200,000,000 | 202,418,000 |  |
| 第5回大阪府公募公債(20年)       | 100,000,000 | 121,178,000 |  |
| 第11回大阪府公募公債(20年)      | 200,000,000 | 236,472,000 |  |
| 第343回大阪府公募公債          | 70,000,000  | 71,155,000  |  |
| 第348回大阪府公募公債          | 10,000,000  | 10,278,200  |  |
| 第351回大阪府公募公債          | 100,000,000 | 102,879,000 |  |
| 第358回大阪府公募公債          | 56,000,000  | 57,620,080  |  |
| 第359回大阪府公募公債          | 56,000,000  | 57,699,600  |  |
| 第376回大阪府公募公債          | 106,000,000 | 109,898,680 |  |
| 第380回大阪府公募公債          | 100,000,000 | 103,658,000 |  |
| 第385回大阪府公募公債          | 200,000,000 | 206,698,000 |  |
| 第388回大阪府公募公債          | 400,000,000 | 411,532,000 |  |
| 第393回大阪府公募公債          | 110,000,000 | 112,922,700 |  |
| 第414回大阪府公募公債          | 100,000,000 | 99,859,000  |  |
| 第416回大阪府公募公債          | 108,000,000 | 109,074,600 |  |
| 第429回大阪府公募公債          | 103,000,000 | 103,758,080 |  |
| 第431回大阪府公募公債          | 300,000,000 | 300,957,000 |  |
| 平成21年度第3回京都府公募公債(20年) | 100,000,000 | 120,992,000 |  |
| 平成23年度第9回京都府公募公債      | 140,000,000 | 144,331,600 |  |
| 平成24年度第3回京都府公募公債(20年) | 200,000,000 | 234,152,000 |  |
| 平成24年度第10回京都府公募公債     | 100,000,000 | 102,692,000 |  |
| 平成25年度第2回京都府公募公債(15年) | 100,000,000 | 108,554,000 |  |
| 第1回兵庫県公募公債(18年)       | 200,000,000 | 223,494,000 |  |
| 第2回兵庫県公募公債(30年)       | 40,000,000  | 53,261,200  |  |
| 第4回兵庫県公募公債(15年)       | 100,000,000 | 110,435,000 |  |
| 第5回兵庫県公募公債(15年)       | 100,000,000 | 110,818,000 |  |
| 第8回兵庫県公募公債(15年)       | 100,000,000 | 108,908,000 |  |
| 第15回兵庫県公募公債(20年)      | 300,000,000 | 350,274,000 |  |
| 第16回兵庫県公募公債(20年)      | 100,000,000 | 117,704,000 |  |
| 平成27年度第6回兵庫県公募公債      | 200,000,000 | 206,932,000 |  |
| 第3回静岡県公募公債(15年)       | 100,000,000 | 111,192,000 |  |
| 平成22年度第1回静岡県公募公債      | 101,700,000 | 103,479,750 |  |
| 平成22年度第6回静岡県公募公債      | 100,000,000 | 101,705,000 |  |
| 平成22年度第8回静岡県公募公債      | 100,000,000 | 101,625,000 |  |
| 平成25年度第1回静岡県公募公債      | 100,000,000 | 102,365,000 |  |
| 平成25年度第5回静岡県公募公債      | 100,000,000 | 104,059,000 |  |

|                        |             |             |  |
|------------------------|-------------|-------------|--|
| 平成25年度第8回静岡県公募公債       | 130,000,000 | 134,176,900 |  |
| 平成27年度第3回静岡県公募公債       | 121,000,000 | 124,995,420 |  |
| 平成27年度第5回静岡県公募公債       | 100,000,000 | 103,562,000 |  |
| 平成30年度第9回静岡県公募公債       | 100,000,000 | 101,246,000 |  |
| 平成23年度第7回愛知県公募公債       | 100,000,000 | 102,708,000 |  |
| 平成23年度第9回愛知県公募公債       | 100,000,000 | 102,652,000 |  |
| 平成23年度第14回愛知県公募公債      | 100,000,000 | 102,782,000 |  |
| 平成23年度第17回愛知県公募公債      | 100,000,000 | 102,926,000 |  |
| 平成24年度第13回愛知県公募公債      | 100,000,000 | 102,884,000 |  |
| 平成24年度第14回愛知県公募公債（15年） | 300,000,000 | 332,472,000 |  |
| 平成26年度第9回愛知県公募公債       | 100,000,000 | 103,096,000 |  |
| 平成26年度第12回愛知県公募公債      | 100,000,000 | 102,838,000 |  |
| 平成27年度第18回愛知県公募公債      | 100,000,000 | 101,408,000 |  |
| 平成28年度第1回愛知県公募公債       | 100,000,000 | 100,434,000 |  |
| 平成28年度第8回愛知県公募公債       | 108,000,000 | 108,367,200 |  |
| 平成22年度第5回広島県公募公債       | 200,000,000 | 203,556,000 |  |
| 平成22年度第8回広島県公募公債       | 26,650,000  | 27,398,598  |  |
| 平成23年度第1回広島県公募公債       | 100,000,000 | 102,707,000 |  |
| 平成27年度第4回広島県公募公債       | 100,000,000 | 103,107,000 |  |
| 平成29年度第5回広島県公募公債       | 100,000,000 | 101,382,000 |  |
| 第4回埼玉県公募公債（20年）        | 200,000,000 | 236,268,000 |  |
| 平成23年度第1回埼玉県公募公債       | 100,000,000 | 103,016,000 |  |
| 平成23年度第4回埼玉県公募公債       | 100,000,000 | 102,926,000 |  |
| 平成24年度第6回埼玉県公募公債       | 100,000,000 | 102,920,000 |  |
| 平成26年度第8回埼玉県公募公債       | 100,000,000 | 101,887,000 |  |
| 平成27年度第6回埼玉県公募公債       | 200,000,000 | 206,458,000 |  |
| 平成29年度第8回埼玉県公募公債       | 200,000,000 | 202,764,000 |  |
| 平成19年度第1回福岡県公募公債（30年）  | 70,000,000  | 95,463,900  |  |
| 平成20年度第1回福岡県公募公債（30年）  | 80,000,000  | 104,526,400 |  |
| 平成21年度第11回福岡県公募公債      | 100,000,000 | 101,525,000 |  |
| 平成22年度第3回福岡県公募公債       | 100,000,000 | 101,702,000 |  |
| 平成22年度第5回福岡県公募公債       | 20,000,000  | 20,319,600  |  |
| 平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）  | 100,000,000 | 111,413,000 |  |
| 平成26年度第8回福岡県公募公債       | 100,000,000 | 102,483,000 |  |
| 平成26年度第1回福岡県公募公債       | 100,000,000 | 103,425,000 |  |
| 平成27年度第7回福岡県公募公債       | 100,000,000 | 103,062,000 |  |
| 第2回千葉県公募公債（20年）        | 100,000,000 | 117,084,000 |  |
| 第9回千葉県公募公債（20年）        | 80,000,000  | 94,676,000  |  |
| 平成22年度第11回千葉県公募公債      | 80,000,000  | 81,966,400  |  |
| 平成22年度第12回千葉県公募公債      | 100,000,000 | 102,605,000 |  |
| 平成22年度第14回千葉県公募公債      | 100,000,000 | 102,809,000 |  |
| 平成23年度第9回千葉県公募公債       | 20,000,000  | 20,617,600  |  |

|                  |             |             |  |
|------------------|-------------|-------------|--|
| 平成24年度第1回千葉県公募公債 | 20,000,000  | 20,666,600  |  |
| 平成24年度第6回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 103,019,000 |  |
| 平成25年度第1回千葉県公募公債 | 82,500,000  | 84,454,425  |  |
| 平成25年度第8回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 103,131,000 |  |
| 平成28年度第5回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 100,906,000 |  |
| 平成28年度第8回千葉県公募公債 | 200,000,000 | 202,842,000 |  |
| 第7回群馬県公募公債       | 400,000,000 | 407,696,000 |  |
| 第15回群馬県公募公債      | 200,000,000 | 200,780,000 |  |
| 平成28年度第1回岐阜県公募公債 | 100,000,000 | 100,231,000 |  |
| 平成24年度第1回大分県公募公債 | 100,260,000 | 103,194,610 |  |
| 第90回共同発行市場公募地方債  | 30,000,000  | 30,543,900  |  |
| 第91回共同発行市場公募地方債  | 175,000,000 | 177,653,000 |  |
| 第94回共同発行市場公募地方債  | 100,000,000 | 102,418,000 |  |
| 第95回共同発行市場公募地方債  | 100,000,000 | 102,605,000 |  |
| 第99回共同発行市場公募地方債  | 200,000,000 | 205,502,000 |  |
| 第100回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 102,938,000 |  |
| 第101回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 102,634,000 |  |
| 第103回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 102,668,000 |  |
| 第107回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 309,120,000 |  |
| 第109回共同発行市場公募地方債 | 170,000,000 | 175,666,100 |  |
| 第110回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 102,887,000 |  |
| 第113回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 102,677,000 |  |
| 第114回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 102,917,000 |  |
| 第117回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 205,454,000 |  |
| 第120回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 102,737,000 |  |
| 第126回共同発行市場公募地方債 | 210,000,000 | 217,719,600 |  |
| 第127回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 103,125,000 |  |
| 第129回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 206,764,000 |  |
| 第130回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 103,690,000 |  |
| 第132回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 206,588,000 |  |
| 第135回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 310,350,000 |  |
| 第140回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 205,642,000 |  |
| 第142回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 203,888,000 |  |
| 第144回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 205,530,000 |  |
| 第145回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 102,405,000 |  |
| 第146回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 206,722,000 |  |
| 第150回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 309,771,000 |  |
| 第153回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 103,096,000 |  |
| 第163回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 300,924,000 |  |
| 第166回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 303,465,000 |  |
| 第172回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 202,870,000 |  |
| 第178回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 202,496,000 |  |

|                        |             |             |  |
|------------------------|-------------|-------------|--|
| 平成24年度第2回堺市公募公債        | 200,000,000 | 205,402,000 |  |
| 平成25年度第1回長崎県公募公債       | 200,000,000 | 207,360,000 |  |
| 平成23年度第1回滋賀県公募公債       | 100,000,000 | 102,822,000 |  |
| 平成25年度第1回栃木県公募公債       | 100,000,000 | 103,043,000 |  |
| 平成24年度第2回熊本県公募公債       | 50,000,000  | 51,458,000  |  |
| 平成22年度第1回新潟市公募公債       | 54,980,000  | 56,219,799  |  |
| 平成23年度第1回浜松市公募公債       | 38,200,000  | 39,299,778  |  |
| 平成24年度第1回浜松市公募公債       | 100,000,000 | 103,286,000 |  |
| 平成25年度第1回浜松市公募公債       | 161,000,000 | 166,945,730 |  |
| 第1回大阪市公募公債(15年)        | 200,000,000 | 225,836,000 |  |
| 第5回大阪市公募公債(20年)        | 100,000,000 | 122,293,000 |  |
| 平成23年度第10回大阪市公募公債      | 10,000,000  | 10,279,500  |  |
| 平成26年度第5回大阪市公募公債       | 100,000,000 | 103,241,000 |  |
| 第1回名古屋市公募公債(20年)       | 200,000,000 | 219,260,000 |  |
| 第9回名古屋市公募公債(20年)       | 400,000,000 | 475,604,000 |  |
| 第10回名古屋市公募公債(20年)      | 80,000,000  | 97,279,200  |  |
| 第477回名古屋市公募公債          | 100,000,000 | 102,917,000 |  |
| 第1回京都市公募公債(20年)        | 200,000,000 | 224,958,000 |  |
| 第5回京都市公募公債(20年)        | 50,000,000  | 59,144,000  |  |
| 平成23年度第2回京都市公募公債       | 100,000,000 | 102,634,000 |  |
| 平成24年度第4回京都市公募公債       | 100,000,000 | 102,910,000 |  |
| 平成26年度第4回京都市公募公債       | 100,000,000 | 102,992,000 |  |
| 平成20年度第24回神戸市公募公債(20年) | 300,000,000 | 356,301,000 |  |
| 平成22年度第4回神戸市公募公債       | 100,000,000 | 118,918,000 |  |
| 平成22年度第9回神戸市公募公債(20年)  | 80,000,000  | 97,247,200  |  |
| 第7回横浜市公募公債(20年)        | 200,000,000 | 228,074,000 |  |
| 第17回横浜市公募公債(20年)       | 80,000,000  | 94,936,000  |  |
| 第20回横浜市公募公債(20年)       | 80,000,000  | 96,108,000  |  |
| 平成24年度第4回横浜市公募公債       | 100,000,000 | 103,207,000 |  |
| 第25回横浜市公募公債(20年)       | 100,000,000 | 118,222,000 |  |
| 平成27年度第2回横浜市公募公債       | 200,000,000 | 206,984,000 |  |
| 第27回横浜市公募公債(20年)       | 60,000,000  | 70,257,600  |  |
| 平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)  | 80,000,000  | 105,692,800 |  |
| 平成23年度第3回札幌市公募公債       | 300,000,000 | 361,812,000 |  |
| 平成26年度第5回札幌市公募公債       | 100,000,000 | 108,043,000 |  |
| 平成27年度第9回札幌市公募公債       | 100,000,000 | 101,169,000 |  |
| 第3回川崎市公募公債(15年)        | 100,000,000 | 103,401,000 |  |
| 第44回川崎市公募公債(5年)        | 130,400,000 | 130,647,760 |  |
| 第17回北九州市公募公債(20年)      | 100,000,000 | 116,623,000 |  |
| 平成22年度第2回北九州市公募公債      | 100,000,000 | 102,350,000 |  |
| 平成25年度第3回北九州市公募公債      | 300,000,000 | 310,416,000 |  |
| 平成22年度第9回福岡市公募公債       | 106,500,000 | 109,468,155 |  |

|      |                              |                |                |  |
|------|------------------------------|----------------|----------------|--|
|      | 平成23年度第6回福岡市公募公債             | 100,000,000    | 102,676,000    |  |
|      | 平成24年度第4回福岡市公募公債             | 200,000,000    | 205,854,000    |  |
|      | 平成25年度第4回福岡市公募公債             | 50,000,000     | 51,561,500     |  |
|      | 平成26年度第6回福岡市公募公債(20年)        | 100,000,000    | 114,379,000    |  |
|      | 平成25年度第2回広島市公募公債             | 100,000,000    | 103,435,000    |  |
|      | 平成29年度第6回広島市公募公債             | 300,000,000    | 303,642,000    |  |
|      | 平成22年度第2回千葉市公募公債             | 100,000,000    | 101,548,000    |  |
|      | 平成24年度第1回相模原市公募公債            | 200,000,000    | 205,368,000    |  |
|      | 平成22年度第1回三重県公募公債             | 87,050,000     | 88,698,727     |  |
|      | 平成23年度第1回三重県公募公債             | 98,410,000     | 101,190,082    |  |
|      | 平成24年度第4回福井県公募公債             | 100,000,000    | 101,862,000    |  |
|      | 平成27年度第4回福井県公募公債             | 200,000,000    | 200,940,000    |  |
|      | 平成23年度第1回徳島県公募公債             | 100,000,000    | 102,822,000    |  |
|      | 平成29年度第2回徳島県公募公債             | 108,000,000    | 108,946,080    |  |
|      | 平成24年度第1回山梨県公募公債             | 200,000,000    | 205,842,000    |  |
|      | 平成24年度第2回岡山県公募公債             | 100,000,000    | 102,745,000    |  |
|      | 平成26年度第1回岡山市公募公債             | 100,000,000    | 101,859,000    |  |
|      | 第4回京都市保証京都市土地開発公社債券          | 200,000,000    | 200,206,000    |  |
|      | 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    | 120,421,000    |  |
|      | 第132回福岡北九州高速道路債券             | 100,000,000    | 102,876,000    |  |
|      | 地方債証券 合計                     | 29,605,650,000 | 31,281,305,364 |  |
| 特殊債券 | 第11回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債     | 400,000,000    | 400,672,000    |  |
|      | 第7回政府保証日本政策投資銀行              | 100,000,000    | 101,526,000    |  |
|      | 第19回政府保証日本政策投資銀行             | 400,000,000    | 411,872,000    |  |
|      | 第22回政府保証日本政策投資銀行             | 20,000,000     | 20,728,000     |  |
|      | 第39回政府保証日本政策投資銀行             | 106,000,000    | 107,510,500    |  |
|      | 第47回政府保証日本政策投資銀行             | 700,000,000    | 700,693,000    |  |
|      | 第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券     | 100,000,000    | 104,048,000    |  |
|      | 第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  | 120,000,000    | 140,581,200    |  |
|      | 第9回道路債券(財投機関債)               | 100,000,000    | 132,929,000    |  |
|      | 第12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    | 118,271,000    |  |
|      | 第17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    | 234,912,000    |  |
|      | 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     | 45,292,500     |  |
|      | 第19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    | 148,178,000    |  |
|      | 第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 130,000,000    | 190,187,400    |  |
|      | 第27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    | 119,274,000    |  |



|                              |             |             |  |
|------------------------------|-------------|-------------|--|
| 第28回道路債券(財投機関債)              | 400,000,000 | 539,276,000 |  |
| 第33回道路債券(財投機関債)              | 500,000,000 | 683,945,000 |  |
| 第42回道路債券(財投機関債)              | 200,000,000 | 226,784,000 |  |
| 第47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 | 183,399,000 |  |
| 第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 50,000,000  | 60,434,000  |  |
| 第69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 | 122,496,000 |  |
| 第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 200,000,000 | 240,432,000 |  |
| 第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 50,000,000  | 59,884,000  |  |
| 第89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 | 117,553,000 |  |
| 第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000 | 120,660,000 |  |
| 第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000 | 120,769,000 |  |
| 第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 210,000,000 | 212,853,900 |  |
| 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 | 133,579,000 |  |
| 第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 50,000,000  | 50,765,000  |  |
| 第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 300,000,000 | 305,427,000 |  |
| 第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 100,000,000 | 121,310,000 |  |
| 第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 544,000,000 | 554,384,960 |  |
| 第112回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 354,000,000 | 360,099,420 |  |
| 第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 100,000,000 | 101,746,000 |  |
| 第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 300,000,000 | 304,971,000 |  |
| 第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 400,000,000 | 406,952,000 |  |
| 第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 571,000,000 | 584,624,060 |  |
| 第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 100,000,000 | 121,036,000 |  |
| 第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 400,000,000 | 412,124,000 |  |
| 第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 91,000,000  | 93,436,070  |  |
| 第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 660,000,000 | 678,915,600 |  |
| 第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 122,000,000 | 125,302,540 |  |

|                                   |             |             |  |
|-----------------------------------|-------------|-------------|--|
| 第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券<br>（財投機関債） | 200,000,000 | 234,538,000 |  |
| 第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 100,000,000 | 102,877,000 |  |
| 第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 200,000,000 | 238,616,000 |  |
| 第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 136,000,000 | 140,037,840 |  |
| 第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券<br>（財投機関債） | 100,000,000 | 129,286,000 |  |
| 第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 212,000,000 | 218,213,720 |  |
| 第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 109,000,000 | 112,249,290 |  |
| 第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券<br>（財投機関債） | 100,000,000 | 112,739,000 |  |
| 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 | 118,845,000 |  |
| 第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 200,000,000 | 250,904,000 |  |
| 第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 12,000,000  | 12,388,320  |  |
| 第173回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 301,000,000 | 310,616,950 |  |
| 第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 100,000,000 | 103,288,000 |  |
| 第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 201,000,000 | 208,135,500 |  |
| 第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 100,000,000 | 102,972,000 |  |
| 第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 100,000,000 | 114,872,000 |  |
| 第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 153,000,000 | 156,844,890 |  |
| 第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 100,000,000 | 104,123,000 |  |
| 第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 223,000,000 | 232,667,050 |  |
| 第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 100,000,000 | 103,981,000 |  |
| 第211回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 200,000,000 | 207,238,000 |  |
| 第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 222,000,000 | 229,987,560 |  |
| 第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 100,000,000 | 103,592,000 |  |
| 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 | 115,459,000 |  |
| 第243回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 200,000,000 | 205,530,000 |  |
| 第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券        | 130,000,000 | 133,381,300 |  |

|                              |             |             |  |
|------------------------------|-------------|-------------|--|
| 第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 100,000,000 | 101,385,000 |  |
| 第344回政府保証道路債券                | 100,000,000 | 102,403,000 |  |
| 第1回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)      | 600,000,000 | 609,894,000 |  |
| 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  | 60,537,500  |  |
| 第2回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)      | 300,000,000 | 304,773,000 |  |
| 第3回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)      | 300,000,000 | 304,701,000 |  |
| 第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)        | 20,000,000  | 20,810,600  |  |
| 第3回地方公共団体金融機構債券(15年)(財投機関債)  | 100,000,000 | 109,623,000 |  |
| 第5回政府保証公営企業債券(15年)           | 300,000,000 | 323,394,000 |  |
| 第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)        | 100,000,000 | 109,638,000 |  |
| 第8回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)  | 200,000,000 | 240,068,000 |  |
| 第9回政府保証地方公共団体金融機構債券          | 250,000,000 | 253,787,500 |  |
| 第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)        | 50,000,000  | 56,476,000  |  |
| 第10回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 100,000,000 | 101,508,000 |  |
| 第11回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 300,000,000 | 354,612,000 |  |
| 第12回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 250,000,000 | 302,917,500 |  |
| 第13回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)      | 100,000,000 | 101,771,000 |  |
| 第14回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 100,000,000 | 101,679,000 |  |
| 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  | 98,180,000  |  |
| 第16回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 100,000,000 | 101,700,000 |  |
| 第16回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)      | 100,000,000 | 101,912,000 |  |
| 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  | 95,108,800  |  |
| 第17回公営企業債券(20年)(財投機関債)       | 150,000,000 | 175,258,500 |  |
| 第17回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 100,000,000 | 119,222,000 |  |
| 第19回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)      | 50,000,000  | 51,205,000  |  |
| 第20回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)      | 100,000,000 | 102,529,000 |  |
| 第22回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 30,000,000  | 30,855,300  |  |
| 第22回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 200,000,000 | 234,860,000 |  |
| 第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 300,000,000 | 352,098,000 |  |
| F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)      | 70,000,000  | 74,706,800  |  |
| 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  | 59,615,500  |  |
| 第29回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 21,000,000  | 21,597,450  |  |
| 第30回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)      | 300,000,000 | 308,385,000 |  |
| 第31回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 50,000,000  | 51,649,000  |  |
| 第39回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 100,000,000 | 103,022,000 |  |

|                              |             |             |  |
|------------------------------|-------------|-------------|--|
| 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 | 112,961,000 |  |
| 第46回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 17,000,000  | 17,505,240  |  |
| 第48回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 36,000,000  | 37,014,120  |  |
| 第55回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 160,000,000 | 165,824,000 |  |
| 第61回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 100,000,000 | 103,740,000 |  |
| 第62回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 100,000,000 | 103,566,000 |  |
| F63回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)      | 100,000,000 | 109,917,000 |  |
| F77回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)      | 200,000,000 | 222,612,000 |  |
| 第77回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)      | 100,000,000 | 103,104,000 |  |
| 第89回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 203,000,000 | 203,862,750 |  |
| F89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)      | 300,000,000 | 338,526,000 |  |
| 第97回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 200,000,000 | 202,430,000 |  |
| 第99回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 400,000,000 | 405,464,000 |  |
| F104回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)     | 100,000,000 | 107,856,000 |  |
| F123回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)     | 100,000,000 | 114,876,000 |  |
| F124回地方公共団体金融機構債券            | 200,000,000 | 222,190,000 |  |
| F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)     | 100,000,000 | 115,082,000 |  |
| F132回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)     | 100,000,000 | 106,913,000 |  |
| F197回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)     | 300,000,000 | 324,633,000 |  |
| F226回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)     | 100,000,000 | 108,859,000 |  |
| F306回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)     | 100,000,000 | 104,245,000 |  |
| 第2回政府保証公営企業債券(15年)           | 100,000,000 | 104,752,000 |  |
| 第5回政府保証阪神高速道路債券              | 200,000,000 | 203,052,000 |  |
| 第10回日本政策金融公庫(財投機関債)          | 80,000,000  | 96,774,400  |  |
| 第15回日本政策金融公庫(財投機関債)          | 80,000,000  | 95,005,600  |  |
| 第25回政府保証日本政策金融公庫債券           | 100,000,000 | 103,530,000 |  |
| 第37回政府保証日本政策金融公庫債券           | 100,000,000 | 103,160,000 |  |
| 第211回政府保証預金保険機構債券            | 100,000,000 | 100,394,000 |  |
| 第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券          | 15,414,000  | 16,130,596  |  |
| 第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券        | 15,734,000  | 16,548,706  |  |
| 第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券          | 16,647,000  | 17,536,449  |  |
| 第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券        | 16,145,000  | 17,134,365  |  |
| 第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券        | 94,274,000  | 94,715,202  |  |
| 第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券        | 197,550,000 | 198,184,135 |  |
| 第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券          | 16,351,000  | 17,263,876  |  |
| 第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券          | 13,942,000  | 14,395,672  |  |
| 第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券          | 14,395,000  | 15,116,909  |  |

|                           |             |             |  |
|---------------------------|-------------|-------------|--|
| 第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 15,826,000  | 16,570,138  |  |
| 第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券     | 16,694,000  | 17,564,759  |  |
| 第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券       | 14,481,000  | 15,200,705  |  |
| 第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券         | 10,668,000  | 10,766,038  |  |
| 第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 17,083,000  | 17,932,025  |  |
| 第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券         | 10,549,000  | 10,634,974  |  |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券       | 15,090,000  | 15,834,993  |  |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券     | 17,795,000  | 18,902,382  |  |
| 第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券        | 22,630,000  | 22,911,969  |  |
| 第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券      | 15,640,000  | 16,467,199  |  |
| 第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 18,387,000  | 19,429,175  |  |
| 第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券        | 11,877,000  | 12,127,604  |  |
| 第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券    | 17,359,000  | 17,760,340  |  |
| 第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券    | 19,875,000  | 20,464,890  |  |
| 第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券    | 20,076,000  | 20,713,413  |  |
| 第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券    | 60,909,000  | 62,642,470  |  |
| 第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券        | 13,461,000  | 13,891,213  |  |
| 第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券        | 13,694,000  | 14,248,743  |  |
| 第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 52,546,000  | 57,118,552  |  |
| 第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券        | 13,879,000  | 14,230,138  |  |
| 第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券        | 31,052,000  | 32,124,846  |  |
| 第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券        | 16,741,000  | 17,359,579  |  |
| 第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 32,845,000  | 35,198,015  |  |
| 第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 34,634,000  | 36,963,482  |  |
| 第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 35,039,000  | 37,265,027  |  |
| 第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券        | 16,218,000  | 16,925,104  |  |
| 第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 37,868,000  | 40,075,325  |  |
| 第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券        | 15,591,000  | 16,192,033  |  |
| 第39回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 300,000,000 | 360,591,000 |  |
| 第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 39,196,000  | 41,158,935  |  |
| 第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券        | 17,056,000  | 17,938,818  |  |
| 第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券        | 15,398,000  | 16,194,692  |  |
| 第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 45,416,000  | 48,323,532  |  |
| 第43回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 122,279,000 |  |
| 第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 44,737,000  | 47,932,563  |  |
| 第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 37,872,000  | 40,424,572  |  |
| 第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 34,254,000  | 36,630,199  |  |
| 第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 106,695,000 | 114,099,633 |  |
| 第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 34,887,000  | 37,120,814  |  |
| 第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 35,414,000  | 37,577,441  |  |
| 第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券        | 15,212,000  | 15,978,836  |  |

|                               |             |             |  |
|-------------------------------|-------------|-------------|--|
| 第5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 38,313,000  | 40,714,841  |  |
| 第5 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 41,379,000  | 43,830,705  |  |
| 第5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 43,134,000  | 45,668,122  |  |
| 第5 4 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）   | 300,000,000 | 304,479,000 |  |
| 第5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 47,320,000  | 50,089,639  |  |
| 第5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 142,560,000 | 151,010,956 |  |
| 第5 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 48,796,000  | 51,729,615  |  |
| 第6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 50,623,000  | 53,458,900  |  |
| 第6 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 51,936,000  | 54,536,435  |  |
| 第6 2 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）   | 290,000,000 | 352,260,100 |  |
| 第6 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 51,587,000  | 53,923,891  |  |
| 第6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 54,230,000  | 56,719,157  |  |
| 第7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 49,905,000  | 52,443,667  |  |
| 第7 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 54,689,000  | 57,773,459  |  |
| 第7 5 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）   | 80,000,000  | 96,969,600  |  |
| 第7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 334,915,000 | 351,342,580 |  |
| 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  | 33,744,300  |  |
| 第7 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 50,621,000  | 52,820,988  |  |
| 第8 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 110,314,000 | 115,132,515 |  |
| 第8 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 54,856,000  | 57,259,789  |  |
| 第8 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 57,515,000  | 59,969,165  |  |
| 第8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 115,986,000 | 120,714,749 |  |
| 第8 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 118,168,000 | 123,141,691 |  |
| 第8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）   | 100,000,000 | 119,127,000 |  |
| 第8 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 62,862,000  | 65,306,074  |  |
| 第9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 191,502,000 | 198,210,315 |  |
| 第9 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 129,776,000 | 134,129,984 |  |
| 第9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 65,911,000  | 67,766,394  |  |
| 第9 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 139,090,000 | 141,881,536 |  |
| 第9 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 236,403,000 | 244,154,654 |  |
| 第9 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 235,938,000 | 245,073,519 |  |
| 第9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 158,654,000 | 164,611,457 |  |
| 第1 0 0 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 119,777,000 |  |
| 第1 0 2 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 300,000,000 | 332,874,000 |  |
| 第1 0 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 410,585,000 | 426,014,784 |  |
| 第1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 273,507,000 | 276,086,171 |  |
| 第1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 277,818,000 | 281,607,437 |  |

|                            |             |             |  |
|----------------------------|-------------|-------------|--|
| 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 | 171,506,400 |  |
| 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 | 119,194,000 |  |
| 第124回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 200,000,000 | 222,822,000 |  |
| 第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 569,868,000 | 575,521,090 |  |
| 第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 95,699,000  | 96,628,237  |  |
| 第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 96,461,000  | 97,659,045  |  |
| 第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 96,611,000  | 97,522,041  |  |
| 第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 194,078,000 | 195,552,992 |  |
| 第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 194,490,000 | 195,960,344 |  |
| 第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 195,296,000 | 196,995,075 |  |
| 第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 196,456,000 | 197,646,523 |  |
| 第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 197,750,000 | 199,674,107 |  |
| 第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 99,037,000  | 100,231,386 |  |
| 第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 99,464,000  | 100,895,286 |  |
| 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 | 198,480,600 |  |
| 第177回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 200,000,000 | 205,960,000 |  |
| 第6回沖縄振興開発金融公庫債券（財投機関債）     | 50,000,000  | 56,429,500  |  |
| 第25回沖縄振興開発金融公庫債券（財投機関債）    | 300,000,000 | 303,372,000 |  |
| い第781号商工債券                 | 100,000,000 | 100,246,000 |  |
| 第304回信金中金債                 | 200,000,000 | 200,462,000 |  |
| 第310回信金中金債                 | 200,000,000 | 200,660,000 |  |
| 第311回信金中金債                 | 200,000,000 | 200,696,000 |  |
| 第315回信金中金債                 | 400,000,000 | 400,164,000 |  |
| 第322回信金中金債                 | 300,000,000 | 299,796,000 |  |
| 第327回信金中金債                 | 200,000,000 | 199,868,000 |  |
| 第332回信金中金債                 | 300,000,000 | 300,102,000 |  |
| 第336回信金中金債                 | 300,000,000 | 300,228,000 |  |
| 第338回信金中金債                 | 200,000,000 | 200,238,000 |  |
| 第11号商工債券（10年）              | 100,000,000 | 102,567,000 |  |
| 第211号商工債券（3年）              | 300,000,000 | 300,021,000 |  |
| 第223号商工債券（3年）              | 300,000,000 | 300,033,000 |  |
| 第17回韓国輸出入銀行                | 100,000,000 | 100,025,000 |  |
| 第18回韓国輸出入銀行                | 100,000,000 | 100,208,000 |  |
| 第7回国際協力機構債券（財投機関債）         | 70,000,000  | 84,221,200  |  |
| 第11回国際協力機構債券（財投機関債）        | 30,000,000  | 30,949,200  |  |
| 第33回中日本高速道路                | 50,000,000  | 51,380,500  |  |
| 第21回政府保証西日本高速道路債券          | 150,000,000 | 152,338,500 |  |
| 第27回西日本高速道路                | 300,000,000 | 310,143,000 |  |
| 第29回西日本高速道路                | 200,000,000 | 203,362,000 |  |

|         |                                    |                |                |  |
|---------|------------------------------------|----------------|----------------|--|
|         | 第30回西日本高速道路                        | 300,000,000    | 302,070,000    |  |
| 特殊債券 合計 |                                    | 36,273,199,000 | 38,861,920,421 |  |
| 社債券     | 第14回フランス相互信用連合銀行                   | 300,000,000    | 302,844,000    |  |
|         | 第19回フランス相互信用連合銀行                   | 200,000,000    | 207,626,000    |  |
|         | 第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー              | 300,000,000    | 298,293,000    |  |
|         | 第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債<br>(2016)  | 200,000,000    | 199,638,000    |  |
|         | 第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債<br>(2017) | 200,000,000    | 199,298,000    |  |
|         | 第1回韓国石油公社債                         | 100,000,000    | 100,049,000    |  |
|         | 第12回新関西国際空港                        | 300,000,000    | 326,595,000    |  |
|         | 第38回関西国際空港                         | 50,000,000     | 51,511,500     |  |
|         | 第10回ゴールドマン・サックス・グループ・インク           | 200,000,000    | 212,332,000    |  |
|         | 第11回ナショナル・オーストラリア銀行                | 100,000,000    | 100,117,000    |  |
|         | 第17回ナショナル・オーストラリア銀行                | 100,000,000    | 100,038,000    |  |
|         | 第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション         | 300,000,000    | 300,357,000    |  |
|         | 第9回ラボバンク・ネダーランド                    | 100,000,000    | 103,293,000    |  |
|         | 第27回ラボバンク・ネダーランド                   | 100,000,000    | 100,344,000    |  |
|         | 第7回大和ハウス工業                         | 200,000,000    | 199,908,000    |  |
|         | 第5回日揮                              | 200,000,000    | 200,338,000    |  |
|         | 第7回明治ホールディングス                      | 100,000,000    | 100,447,000    |  |
|         | 第10回アサヒグループホールディングス                | 100,000,000    | 100,205,000    |  |
|         | 第11回アサヒグループホールディングス                | 100,000,000    | 100,373,000    |  |
|         | 第3回コカ・コーラウエスト                      | 300,000,000    | 304,503,000    |  |
|         | 第24回味の素                            | 100,000,000    | 100,304,000    |  |
|         | 第6回ヒューリック                          | 300,000,000    | 298,431,000    |  |
|         | 第6回J.フロント リテイリング                   | 200,000,000    | 202,070,000    |  |
|         | 第4回トヨタ紡織                           | 300,000,000    | 302,112,000    |  |
|         | 第22回森ビル                            | 200,000,000    | 199,316,000    |  |
|         | 第11回セブン&アイ・ホールディングス                | 300,000,000    | 304,515,000    |  |
|         | 第31回東レ                             | 100,000,000    | 100,270,000    |  |
|         | 第4回野村総合研究所                         | 100,000,000    | 100,710,000    |  |
|         | 第1回電通                              | 300,000,000    | 300,927,000    |  |
|         | 第2回電通                              | 200,000,000    | 201,808,000    |  |
|         | 第3回富士フィルムホールディングス                  | 100,000,000    | 102,939,000    |  |
|         | 第4回富士フィルムホールディングス                  | 500,000,000    | 499,770,000    |  |
|         | 第23回ジェイ エフ イー ホールディングス             | 300,000,000    | 299,811,000    |  |
|         | 第1回リクルートホールディングス                   | 300,000,000    | 300,567,000    |  |
|         | 第19回豊田自動織機                         | 100,000,000    | 102,691,000    |  |
|         | 第48回日本精工                           | 200,000,000    | 200,242,000    |  |
|         | 第15回パナソニック                         | 300,000,000    | 300,873,000    |  |
|         | 第17回パナソニック                         | 100,000,000    | 101,194,000    |  |



|                          |               |               |  |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| 第18回デンソー                 | 200,000,000   | 200,444,000   |  |
| 第1回村田製作所                 | 300,000,000   | 300,096,000   |  |
| 第29回三菱重工業                | 300,000,000   | 307,245,000   |  |
| 第34回三菱重工業                | 100,000,000   | 99,960,000    |  |
| 第1回明治安田生命2014基金          | 100,000,000   | 100,164,000   |  |
| 第7回JA三井リース               | 200,000,000   | 200,186,000   |  |
| 第9回JA三井リース               | 100,000,000   | 100,142,000   |  |
| 第1回日本生命2015基金            | 100,000,000   | 100,129,000   |  |
| 第1回日本生命2017基金            | 100,000,000   | 100,187,000   |  |
| 第2回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス | 200,000,000   | 200,642,000   |  |
| 第13回アイシン精機               | 100,000,000   | 103,290,000   |  |
| 第1回明治安田生命2018基金          | 300,000,000   | 300,003,000   |  |
| 第20回ニコン                  | 100,000,000   | 101,563,000   |  |
| 第78回三菱商事                 | 100,000,000   | 103,369,000   |  |
| 第33回丸井                   | 200,000,000   | 199,840,000   |  |
| 第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ    | 300,000,000   | 297,867,000   |  |
| 第8回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)    | 100,000,000   | 103,958,000   |  |
| 第9回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)    | 100,000,000   | 113,494,000   |  |
| 第28回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)     | 100,000,000   | 102,811,000   |  |
| 第30回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)     | 100,000,000   | 120,449,000   |  |
| 第57回三菱東京UFJ銀行            | 200,000,000   | 215,740,000   |  |
| 第6回りそな銀行(劣後特約付)          | 1,000,000,000 | 1,021,690,000 |  |
| 第6回住友信託銀行(劣後特約付)         | 100,000,000   | 116,921,000   |  |
| 第13回住友信託銀行(劣後特約付)        | 100,000,000   | 113,993,000   |  |
| 第22回三井住友銀行(劣後特約付)        | 100,000,000   | 102,211,000   |  |
| 第23回三井住友銀行(劣後特約付)        | 100,000,000   | 102,842,000   |  |
| 第25回三井住友銀行(劣後特約付)        | 200,000,000   | 225,976,000   |  |
| 第5回みずほ銀行(劣後特約付)          | 100,000,000   | 114,400,000   |  |
| 第9回みずほ銀行(劣後特約付)          | 100,000,000   | 116,453,000   |  |
| 第18回みずほ銀行(劣後特約付)         | 100,000,000   | 112,866,000   |  |
| 第13回芙蓉総合リース              | 200,000,000   | 200,366,000   |  |
| 第15回芙蓉総合リース              | 100,000,000   | 100,520,000   |  |
| 第47回日産フィナンシャルサービス        | 200,000,000   | 199,276,000   |  |
| 第20回東京センチュリーリース          | 100,000,000   | 100,096,000   |  |
| 第23回東京センチュリーリース          | 200,000,000   | 200,132,000   |  |
| 第26回東京センチュリーリース          | 100,000,000   | 99,840,000    |  |
| 第29回ホンダファイナンス            | 200,000,000   | 201,704,000   |  |
| 第38回ホンダファイナンス            | 300,000,000   | 299,877,000   |  |
| 第42回ホンダファイナンス            | 100,000,000   | 99,901,000    |  |
| 第77回トヨタファイナンス            | 200,000,000   | 200,600,000   |  |
| 第23回リコーリース               | 200,000,000   | 199,740,000   |  |
| 第30回リコーリース               | 200,000,000   | 200,184,000   |  |

|                    |             |             |  |
|--------------------|-------------|-------------|--|
| 第47回日立キャピタル        | 100,000,000 | 102,876,000 |  |
| 第52回日立キャピタル        | 200,000,000 | 202,042,000 |  |
| 第70回日立キャピタル        | 200,000,000 | 200,278,000 |  |
| 第188回オリックス         | 100,000,000 | 100,064,000 |  |
| 第194回オリックス         | 200,000,000 | 199,860,000 |  |
| 第21回三井住友ファイナンス&リース | 200,000,000 | 200,146,000 |  |
| 第36回三菱UFJリース       | 100,000,000 | 100,730,000 |  |
| 第48回三菱UFJリース       | 100,000,000 | 100,122,000 |  |
| 第27回野村ホールディングス     | 100,000,000 | 111,937,000 |  |
| 第50回野村ホールディングス     | 200,000,000 | 200,392,000 |  |
| 第58回三井不動産          | 300,000,000 | 299,949,000 |  |
| 第105回三菱地所          | 100,000,000 | 103,516,000 |  |
| 第116回三菱地所          | 100,000,000 | 102,701,000 |  |
| 第125回三菱地所          | 300,000,000 | 300,183,000 |  |
| 第99回住友不動産          | 300,000,000 | 308,952,000 |  |
| 第11回エヌ・ティ・ティ都市開発   | 100,000,000 | 102,710,000 |  |
| 第17回エヌ・ティ・ティ都市開発   | 100,000,000 | 102,575,000 |  |
| 第36回京王電鉄           | 100,000,000 | 100,930,000 |  |
| 第38回京王電鉄           | 100,000,000 | 100,647,000 |  |
| 第19回東日本旅客鉄道        | 100,000,000 | 107,191,000 |  |
| 第26回東日本旅客鉄道        | 100,000,000 | 104,470,000 |  |
| 第39回東日本旅客鉄道        | 500,000,000 | 562,100,000 |  |
| 第83回東日本旅客鉄道        | 100,000,000 | 111,663,000 |  |
| 第100回東日本旅客鉄道       | 100,000,000 | 127,129,000 |  |
| 第9回西日本旅客鉄道         | 123,000,000 | 131,739,150 |  |
| 第9回東海旅客鉄道          | 100,000,000 | 106,224,000 |  |
| 第11回東海旅客鉄道         | 100,000,000 | 104,375,000 |  |
| 第34回東海旅客鉄道         | 200,000,000 | 237,112,000 |  |
| 第53回東海旅客鉄道         | 100,000,000 | 116,645,000 |  |
| 第56回東海旅客鉄道         | 100,000,000 | 120,473,000 |  |
| 第74回東海旅客鉄道         | 100,000,000 | 120,146,000 |  |
| 第8回東京地下鉄           | 200,000,000 | 237,496,000 |  |
| 第11回東京地下鉄          | 100,000,000 | 103,217,000 |  |
| 第50回阪急阪神ホールディングス   | 200,000,000 | 202,344,000 |  |
| 第16回三菱倉庫           | 200,000,000 | 200,348,000 |  |
| 第5回関西高速鉄道          | 100,000,000 | 101,836,000 |  |
| 第8回関西高速鉄道          | 200,000,000 | 206,528,000 |  |
| 第63回日本電信電話         | 100,000,000 | 102,538,000 |  |
| 第21回KDDI           | 100,000,000 | 102,963,000 |  |
| 第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ   | 100,000,000 | 103,033,000 |  |
| 第563回東京電力          | 100,000,000 | 101,509,000 |  |
| 第567回東京電力          | 100,000,000 | 110,969,000 |  |

|                 |             |             |  |
|-----------------|-------------|-------------|--|
| 第568回東京電力       | 100,000,000 | 101,402,000 |  |
| 第499回中部電力       | 50,000,000  | 52,165,500  |  |
| 第500回中部電力       | 100,000,000 | 103,361,000 |  |
| 第518回中部電力       | 200,000,000 | 200,038,000 |  |
| 第528回中部電力       | 200,000,000 | 199,188,000 |  |
| 第496回関西電力       | 100,000,000 | 103,474,000 |  |
| 第499回関西電力       | 200,000,000 | 204,360,000 |  |
| 第508回関西電力       | 200,000,000 | 200,078,000 |  |
| 第510回関西電力       | 100,000,000 | 100,203,000 |  |
| 第512回関西電力       | 200,000,000 | 200,000,000 |  |
| 第381回中国電力       | 100,000,000 | 103,715,000 |  |
| 第385回中国電力       | 100,000,000 | 102,920,000 |  |
| 第402回中国電力       | 200,000,000 | 200,000,000 |  |
| 第304回北陸電力       | 100,000,000 | 103,801,000 |  |
| 第307回北陸電力       | 100,000,000 | 105,814,000 |  |
| 第310回北陸電力       | 200,000,000 | 206,604,000 |  |
| 第322回北陸電力       | 200,000,000 | 200,816,000 |  |
| 第481回東北電力       | 200,000,000 | 206,664,000 |  |
| 第490回東北電力       | 100,000,000 | 100,222,000 |  |
| 第494回東北電力       | 100,000,000 | 100,612,000 |  |
| 第253回四国電力       | 100,000,000 | 103,665,000 |  |
| 第371回九州電力       | 100,000,000 | 105,022,000 |  |
| 第429回九州電力       | 200,000,000 | 207,294,000 |  |
| 第430回九州電力       | 100,000,000 | 101,187,000 |  |
| 第437回九州電力       | 100,000,000 | 102,494,000 |  |
| 第460回九州電力       | 200,000,000 | 200,202,000 |  |
| 第310回北海道電力      | 50,000,000  | 51,133,000  |  |
| 第316回北海道電力      | 400,000,000 | 406,144,000 |  |
| 第333回北海道電力      | 300,000,000 | 299,919,000 |  |
| 第344回北海道電力      | 200,000,000 | 199,890,000 |  |
| 第19回沖縄電力        | 80,000,000  | 81,420,000  |  |
| 第38回電源開発        | 100,000,000 | 103,670,000 |  |
| 第39回電源開発        | 100,000,000 | 103,369,000 |  |
| 第40回電源開発        | 200,000,000 | 206,746,000 |  |
| 第50回電源開発        | 200,000,000 | 200,652,000 |  |
| 第57回電源開発        | 200,000,000 | 198,534,000 |  |
| 第4回東京電力パワーグリッド  | 400,000,000 | 402,512,000 |  |
| 第6回東京電力パワーグリッド  | 100,000,000 | 100,198,000 |  |
| 第7回東京電力パワーグリッド  | 300,000,000 | 300,285,000 |  |
| 第13回東京電力パワーグリッド | 200,000,000 | 198,964,000 |  |
| 第15回東京電力パワーグリッド | 200,000,000 | 198,318,000 |  |
| 第23回東京ガス        | 200,000,000 | 208,166,000 |  |

|        |                |                 |                 |  |
|--------|----------------|-----------------|-----------------|--|
|        | 第13回広島ガス       | 200,000,000     | 201,012,000     |  |
|        | 第6回SCSK        | 100,000,000     | 100,246,000     |  |
|        | 第3回ファーストリテイリング | 100,000,000     | 101,339,000     |  |
|        | 第4回ファーストリテイリング | 100,000,000     | 103,590,000     |  |
|        | 第7回ファーストリテイリング | 200,000,000     | 201,078,000     |  |
| 社債券 合計 |                | 28,753,000,000  | 29,472,971,150  |  |
|        | 合計             | 539,800,849,000 | 584,118,853,705 |  |

## 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)

[平成31年 1月28日現在]

|             |                 |  |
|-------------|-----------------|--|
| 資産の部        |                 |  |
| 流動資産        |                 |  |
| 預金          | 682,874,892     |  |
| コール・ローン     | 77,647,703      |  |
| 国債証券        | 129,050,997,810 |  |
| 派生商品評価勘定    | 50,500          |  |
| 未収利息        | 1,058,114,187   |  |
| 前払費用        | 80,940,712      |  |
| 流動資産合計      | 130,950,625,804 |  |
| 資産合計        | 130,950,625,804 |  |
| 負債の部        |                 |  |
| 流動負債        |                 |  |
| 派生商品評価勘定    | 44,222          |  |
| 未払金         | 13,163,967      |  |
| 未払解約金       | 23,912,827      |  |
| 未払利息        | 148             |  |
| その他未払費用     | 102             |  |
| 流動負債合計      | 37,121,266      |  |
| 負債合計        | 37,121,266      |  |
| 純資産の部       |                 |  |
| 元本等         |                 |  |
| 元本          | 65,118,468,587  |  |
| 剰余金         |                 |  |
| 剰余金又は欠損金( ) | 65,795,035,951  |  |
| 元本等合計       | 130,913,504,538 |  |
| 純資産合計       | 130,913,504,538 |  |
| 負債純資産合計     | 130,950,625,804 |  |

### 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本となる重要な事項 | 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。 |

## （貸借対照表に関する注記）

|                                  | [平成31年 1月28日現在] |
|----------------------------------|-----------------|
| 1. 期首                            | 平成30年 1月27日     |
| 期首元本額                            | 59,459,328,166円 |
| 期中追加設定元本額                        | 14,172,269,862円 |
| 期中一部解約元本額                        | 8,513,129,441円  |
| 元本の内訳                            |                 |
| ファンド・マネジャー（海外債券）                 | 888,729,772円    |
| eMAXIS 先進国債券インデックス               | 6,699,721,724円  |
| eMAXIS バランス（8資産均等型）              | 1,707,929,143円  |
| eMAXIS バランス（波乗り型）                | 240,508,506円    |
| コアバランス                           | 1,576,287円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金） | 6,604,208円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金） | 6,333,105円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金） | 4,177,211円      |
| eMAXIS Slim 先進国債券インデックス          | 1,520,929,297円  |
| 海外債券セレクション（ラップ向け）                | 1,600,291,780円  |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）         | 1,263,294,578円  |
| つみたて8資産均等バランス                    | 349,112,572円    |
| つみたて4資産均等バランス                    | 83,945,579円     |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s            | 574,619円        |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s            | 166,584円        |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s            | 33,631円         |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金） | 746,652円        |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金） | 550,361円        |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金） | 450,798円        |
| 三菱UFJ DC年金インデックス（先進国債券）          | 486,600円        |

[平成31年 1月28日現在]

|                                       |                 |
|---------------------------------------|-----------------|
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)      | 242,474円        |
| 三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド                | 8,660,507,764円  |
| eMAXIS バランス(4資産均等型)                   | 173,140,017円    |
| eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)             | 127,367,668円    |
| eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)             | 68,913,531円     |
| eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)            | 101,568,794円    |
| eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)               | 14,450,977円     |
| eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)              | 7,429,969円      |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)         | 55,448,599円     |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)         | 2,724,998,246円  |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)       | 1,760,812,866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)        | 26,243,351,488円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)       | 760,804,529円    |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投資家限定)       | 12,910,050円     |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)         | 8,278,974円      |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定)       | 55,393,391円     |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)       | 14,716,854円     |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)         | 2,301,759,926円  |
| アドバンスト・バランス (FOFs用)(適格機関投資家限定)        | 99,358,385円     |
| アドバンスト・バランス (FOFs用)(適格機関投資家限定)        | 138,503,938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) | 399,331,426円    |
| 世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)            | 11,606,936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)      | 1,732,559,220円  |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA            | 2,131,513円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA          | 5,290,761円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA            | 5,099,727円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA            | 1,909,291円      |
| 三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA                | 53,450,262円     |
| 三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)            | 38,976,814円     |
| 三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)            | 63,796,539円     |
| 三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)            | 52,750,153円     |
| 三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)            | 84,579,388円     |
| 外国債券インデックスファンドi(適格機関投資家限定)            | 1,644,890,385円  |
| 三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド              | 1,981,480,291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)   | 218,384,639円    |

|   | [平成31年 1月28日現在] |
|---|-----------------|
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド<br>(安定成長型) | 562,594,328円    |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド<br>(成長型)   | 405,956,799円    |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド<br>(積極型)   | 147,558,668円    |
| 合計  | 65,118,468,587円 |
| 2. 受益権の総数                                 | 65,118,468,587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 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日   |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。  |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。<br><br>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。<br><br>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。<br><br>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。  |

2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                   | [平成31年 1月28日現在]  |
|----------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。   |
| 2. 時価の算定方法           | (1) 有価証券<br>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。<br><br>(2) デリバティブ取引 |

| 区分                        | [平成31年 1月28日現在]  |
|---------------------------|--|
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>（3）上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種類   | [平成31年 1月28日現在]    |             |
|------|--------------------|-------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |             |
| 国債証券 |                    | 599,911,389 |
| 合計   |                    | 599,911,389 |

（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

[平成31年 1月28日現在]

| 区分        | 種類           | 契約額等（円）    |       | 時価（円）      | 評価損益（円） |
|-----------|--------------|------------|-------|------------|---------|
|           |              |            | うち1年超 |            |         |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引<br>買建 |            |       |            |         |
|           | アメリカドル       | 38,310,702 |       | 38,266,600 | 44,102  |
|           | カナダドル        | 1,644,520  |       | 1,654,400  | 9,880   |
|           | イギリスポンド      | 5,768,790  |       | 5,773,600  | 4,810   |
|           | シンガポールドル     | 807,010    |       | 808,400    | 1,390   |
|           | ユーロ          | 28,660,500 |       | 28,694,800 | 34,300  |
| 合計        |              | 75,191,522 |       | 75,197,800 | 6,278   |

## （注）時価の算定方法

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

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

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

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



- (ロ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 1口当たり情報 )

|              | [ 平成31年 1月28日現在 ] |
|--------------|-------------------|
| 1口当たり純資産額    | 2.0104円           |
| (1万口当たり純資産額) | (20,104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 | 1.125 T-NOTE 191231 | 1,600,000.00 | 1,578,437.49 |    |
|        |      | 1.125 T-NOTE 200331 | 6,500,000.00 | 6,390,820.31 |    |
|        |      | 1.125 T-NOTE 200430 | 1,500,000.00 | 1,472,695.31 |    |
|        |      | 1.125 T-NOTE 210228 | 2,600,000.00 | 2,522,406.25 |    |
|        |      | 1.125 T-NOTE 210630 | 2,000,000.00 | 1,932,656.25 |    |
|        |      | 1.125 T-NOTE 210731 | 1,600,000.00 | 1,543,375.00 |    |
|        |      | 1.125 T-NOTE 210831 | 2,200,000.00 | 2,119,562.50 |    |
|        |      | 1.125 T-NOTE 210930 | 2,100,000.00 | 2,022,398.43 |    |
|        |      | 1.25 T-NOTE 200131  | 2,800,000.00 | 2,762,593.75 |    |
|        |      | 1.25 T-NOTE 200229  | 1,350,000.00 | 1,330,382.81 |    |
|        |      | 1.25 T-NOTE 210331  | 1,000,000.00 | 972,187.50   |    |
|        |      | 1.25 T-NOTE 211031  | 2,000,000.00 | 1,929,375.00 |    |
|        |      | 1.25 T-NOTE 230731  | 2,000,000.00 | 1,887,500.00 |    |
|        |      | 1.375 T-NOTE 200115 | 300,000.00   | 296,519.53   |    |
|        |      | 1.375 T-NOTE 200131 | 1,150,000.00 | 1,136,029.29 |    |
|        |      | 1.375 T-NOTE 200215 | 1,500,000.00 | 1,480,957.03 |    |

|                     |              |              |
|---------------------|--------------|--------------|
| 1.375 T-NOTE 200229 | 2,000,000.00 | 1,973,750.00 |
| 1.375 T-NOTE 200331 | 3,250,000.00 | 3,204,296.87 |
| 1.375 T-NOTE 200430 | 2,000,000.00 | 1,969,375.00 |
| 1.375 T-NOTE 200531 | 1,700,000.00 | 1,672,507.81 |
| 1.375 T-NOTE 200831 | 2,600,000.00 | 2,549,625.00 |
| 1.375 T-NOTE 200915 | 800,000.00   | 784,406.24   |
| 1.375 T-NOTE 200930 | 1,900,000.00 | 1,861,406.25 |
| 1.375 T-NOTE 201031 | 2,550,000.00 | 2,496,011.71 |
| 1.375 T-NOTE 210131 | 3,800,000.00 | 3,708,859.37 |
| 1.375 T-NOTE 210430 | 2,400,000.00 | 2,336,437.50 |
| 1.375 T-NOTE 210531 | 2,400,000.00 | 2,334,000.00 |
| 1.375 T-NOTE 230630 | 1,850,000.00 | 1,756,488.28 |
| 1.375 T-NOTE 230831 | 2,150,000.00 | 2,037,628.90 |
| 1.375 T-NOTE 230930 | 2,100,000.00 | 1,988,273.43 |
| 1.5 T-NOTE 200415   | 1,750,000.00 | 1,727,373.04 |
| 1.5 T-NOTE 200531   | 2,500,000.00 | 2,463,964.84 |
| 1.5 T-NOTE 200615   | 3,800,000.00 | 3,743,445.31 |
| 1.5 T-NOTE 200815   | 2,000,000.00 | 1,966,015.62 |
| 1.5 T-NOTE 220131   | 2,300,000.00 | 2,229,023.43 |
| 1.5 T-NOTE 230228   | 2,300,000.00 | 2,203,507.81 |
| 1.5 T-NOTE 230331   | 3,250,000.00 | 3,110,351.56 |
| 1.5 T-NOTE 260815   | 4,250,000.00 | 3,905,683.59 |
| 1.625 T-NOTE 191231 | 3,100,000.00 | 3,072,996.09 |
| 1.625 T-NOTE 200315 | 2,800,000.00 | 2,770,359.37 |
| 1.625 T-NOTE 200630 | 1,900,000.00 | 1,873,875.00 |
| 1.625 T-NOTE 200731 | 2,600,000.00 | 2,561,812.50 |
| 1.625 T-NOTE 201015 | 1,200,000.00 | 1,180,078.12 |
| 1.625 T-NOTE 201130 | 1,900,000.00 | 1,866,304.68 |
| 1.625 T-NOTE 220815 | 1,700,000.00 | 1,645,281.25 |
| 1.625 T-NOTE 220831 | 7,640,000.00 | 7,390,506.24 |
| 1.625 T-NOTE 221115 | 1,300,000.00 | 1,255,210.93 |
| 1.625 T-NOTE 230430 | 2,450,000.00 | 2,355,062.50 |
| 1.625 T-NOTE 230531 | 1,500,000.00 | 1,441,054.68 |
| 1.625 T-NOTE 231031 | 3,100,000.00 | 2,966,554.68 |
| 1.625 T-NOTE 260215 | 3,700,000.00 | 3,451,117.18 |
| 1.625 T-NOTE 260515 | 3,150,000.00 | 2,930,976.56 |
| 1.75 T-NOTE 201031  | 2,200,000.00 | 2,167,171.87 |
| 1.75 T-NOTE 201115  | 3,400,000.00 | 3,348,867.18 |
| 1.75 T-NOTE 201231  | 1,600,000.00 | 1,575,000.00 |
| 1.75 T-NOTE 211130  | 3,700,000.00 | 3,616,171.87 |
| 1.75 T-NOTE 220228  | 1,900,000.00 | 1,853,835.93 |
| 1.75 T-NOTE 220331  | 2,100,000.00 | 2,047,500.00 |

|                     |               |               |
|---------------------|---------------|---------------|
| 1.75 T-NOTE 220430  | 1,100,000.00  | 1,072,070.31  |
| 1.75 T-NOTE 220515  | 1,400,000.00  | 1,363,523.43  |
| 1.75 T-NOTE 220531  | 1,700,000.00  | 1,655,242.18  |
| 1.75 T-NOTE 220630  | 4,900,000.00  | 4,768,312.50  |
| 1.75 T-NOTE 220930  | 1,800,000.00  | 1,748,109.37  |
| 1.75 T-NOTE 230131  | 2,700,000.00  | 2,614,570.31  |
| 1.75 T-NOTE 230515  | 3,500,000.00  | 3,380,507.81  |
| 1.875 T-NOTE 200630 | 2,420,000.00  | 2,394,760.15  |
| 1.875 T-NOTE 201215 | 3,200,000.00  | 3,157,374.99  |
| 1.875 T-NOTE 211130 | 2,300,000.00  | 2,255,617.18  |
| 1.875 T-NOTE 220131 | 2,550,000.00  | 2,498,003.90  |
| 1.875 T-NOTE 220228 | 2,100,000.00  | 2,056,359.37  |
| 1.875 T-NOTE 220331 | 2,450,000.00  | 2,398,320.31  |
| 1.875 T-NOTE 220430 | 11,100,000.00 | 10,856,320.30 |
| 1.875 T-NOTE 220531 | 2,000,000.00  | 1,955,156.25  |
| 1.875 T-NOTE 220731 | 3,000,000.00  | 2,929,453.12  |
| 1.875 T-NOTE 220831 | 1,500,000.00  | 1,463,906.25  |
| 1.875 T-NOTE 220930 | 2,000,000.00  | 1,950,781.25  |
| 1.875 T-NOTE 221031 | 2,700,000.00  | 2,632,078.12  |
| 1.875 T-NOTE 240831 | 2,200,000.00  | 2,116,984.37  |
| 2 T-NOTE 200731     | 2,000,000.00  | 1,981,562.50  |
| 2 T-NOTE 200930     | 1,600,000.00  | 1,583,875.00  |
| 2 T-NOTE 201130     | 1,100,000.00  | 1,087,882.81  |
| 2 T-NOTE 210115     | 2,900,000.00  | 2,866,355.46  |
| 2 T-NOTE 210228     | 1,300,000.00  | 1,284,156.25  |
| 2 T-NOTE 210531     | 1,700,000.00  | 1,677,089.84  |
| 2 T-NOTE 210831     | 1,850,000.00  | 1,822,466.79  |
| 2 T-NOTE 211031     | 1,700,000.00  | 1,673,835.93  |
| 2 T-NOTE 211115     | 2,650,000.00  | 2,609,007.81  |
| 2 T-NOTE 211231     | 2,750,000.00  | 2,706,601.56  |
| 2 T-NOTE 220215     | 2,200,000.00  | 2,163,218.75  |
| 2 T-NOTE 220731     | 1,200,000.00  | 1,176,937.50  |
| 2 T-NOTE 221031     | 2,000,000.00  | 1,958,593.75  |
| 2 T-NOTE 221130     | 2,700,000.00  | 2,642,835.93  |
| 2 T-NOTE 230215     | 3,050,000.00  | 2,981,613.28  |
| 2 T-NOTE 240430     | 2,000,000.00  | 1,940,937.49  |
| 2 T-NOTE 240531     | 1,400,000.00  | 1,357,890.62  |
| 2 T-NOTE 240630     | 1,600,000.00  | 1,550,625.00  |
| 2 T-NOTE 250215     | 3,600,000.00  | 3,471,187.50  |
| 2 T-NOTE 250815     | 4,700,000.00  | 4,514,570.31  |
| 2 T-NOTE 261115     | 5,150,000.00  | 4,897,328.12  |
| 2.125 T-NOTE 200831 | 1,900,000.00  | 1,885,304.68  |
| 2.125 T-NOTE 210131 | 1,610,000.00  | 1,594,780.46  |

|                     |              |              |
|---------------------|--------------|--------------|
| 2.125 T-NOTE 210630 | 1,650,000.00 | 1,632,210.93 |
| 2.125 T-NOTE 210815 | 4,500,000.00 | 4,447,792.95 |
| 2.125 T-NOTE 210930 | 2,200,000.00 | 2,174,218.75 |
| 2.125 T-NOTE 211231 | 2,560,000.00 | 2,528,000.00 |
| 2.125 T-NOTE 220630 | 1,800,000.00 | 1,773,703.12 |
| 2.125 T-NOTE 221231 | 2,650,000.00 | 2,604,660.15 |
| 2.125 T-NOTE 231130 | 4,500,000.00 | 4,404,375.00 |
| 2.125 T-NOTE 240229 | 1,350,000.00 | 1,319,730.46 |
| 2.125 T-NOTE 240331 | 1,900,000.00 | 1,856,359.37 |
| 2.125 T-NOTE 240731 | 1,750,000.00 | 1,706,250.00 |
| 2.125 T-NOTE 240930 | 2,250,000.00 | 2,191,113.28 |
| 2.125 T-NOTE 241130 | 1,900,000.00 | 1,848,046.87 |
| 2.125 T-NOTE 250515 | 4,900,000.00 | 4,750,703.12 |
| 2.25 T-BOND 460815  | 4,350,000.00 | 3,689,343.75 |
| 2.25 T-NOTE 200229  | 2,400,000.00 | 2,390,812.50 |
| 2.25 T-NOTE 210215  | 1,200,000.00 | 1,191,515.62 |
| 2.25 T-NOTE 210331  | 1,600,000.00 | 1,588,375.00 |
| 2.25 T-NOTE 210430  | 1,800,000.00 | 1,786,359.37 |
| 2.25 T-NOTE 210731  | 1,400,000.00 | 1,388,406.25 |
| 2.25 T-NOTE 231231  | 1,900,000.00 | 1,870,015.62 |
| 2.25 T-NOTE 240131  | 1,700,000.00 | 1,672,507.81 |
| 2.25 T-NOTE 241031  | 2,000,000.00 | 1,959,843.75 |
| 2.25 T-NOTE 241115  | 9,650,000.00 | 9,452,476.56 |
| 2.25 T-NOTE 241231  | 2,500,000.00 | 2,447,851.56 |
| 2.25 T-NOTE 251115  | 7,370,000.00 | 7,179,992.18 |
| 2.25 T-NOTE 270215  | 4,750,000.00 | 4,593,027.34 |
| 2.25 T-NOTE 270815  | 6,070,000.00 | 5,851,859.37 |
| 2.25 T-NOTE 271115  | 3,500,000.00 | 3,368,203.12 |
| 2.375 T-NOTE 200430 | 2,000,000.00 | 1,993,984.37 |
| 2.375 T-NOTE 201231 | 800,000.00   | 796,562.50   |
| 2.375 T-NOTE 210315 | 1,400,000.00 | 1,393,820.30 |
| 2.375 T-NOTE 210415 | 3,300,000.00 | 3,284,402.34 |
| 2.375 T-NOTE 230131 | 5,000,000.00 | 4,960,937.50 |
| 2.375 T-NOTE 240815 | 3,800,000.00 | 3,752,500.00 |
| 2.375 T-NOTE 270515 | 3,650,000.00 | 3,559,890.62 |
| 2.5 T-BOND 450215   | 2,800,000.00 | 2,518,906.25 |
| 2.5 T-BOND 460215   | 1,870,000.00 | 1,676,279.68 |
| 2.5 T-BOND 460515   | 3,050,000.00 | 2,730,941.40 |
| 2.5 T-NOTE 230815   | 3,400,000.00 | 3,386,984.37 |
| 2.5 T-NOTE 240515   | 4,350,000.00 | 4,326,550.78 |
| 2.5 T-NOTE 250131   | 2,200,000.00 | 2,183,500.00 |
| 2.625 T-NOTE 200815 | 2,300,000.00 | 2,299,910.15 |

|                     |               |               |
|---------------------|---------------|---------------|
| 2.625 T-NOTE 201115 | 3,200,000.00  | 3,200,124.99  |
| 2.625 T-NOTE 210515 | 2,300,000.00  | 2,301,167.96  |
| 2.625 T-NOTE 210615 | 3,100,000.00  | 3,103,027.34  |
| 2.625 T-NOTE 230228 | 2,200,000.00  | 2,203,437.50  |
| 2.625 T-NOTE 230630 | 2,500,000.00  | 2,504,101.56  |
| 2.625 T-NOTE 250331 | 1,700,000.00  | 1,698,406.25  |
| 2.75 T-BOND 420815  | 1,350,000.00  | 1,284,292.96  |
| 2.75 T-BOND 421115  | 1,550,000.00  | 1,472,984.37  |
| 2.75 T-BOND 470815  | 3,340,000.00  | 3,137,773.43  |
| 2.75 T-BOND 471115  | 1,460,000.00  | 1,370,917.18  |
| 2.75 T-NOTE 200930  | 6,000,000.00  | 6,012,421.87  |
| 2.75 T-NOTE 210815  | 12,560,000.00 | 12,609,553.11 |
| 2.75 T-NOTE 230531  | 1,800,000.00  | 1,812,515.62  |
| 2.75 T-NOTE 231115  | 5,650,000.00  | 5,690,609.37  |
| 2.75 T-NOTE 240215  | 3,200,000.00  | 3,223,000.00  |
| 2.75 T-NOTE 250228  | 2,150,000.00  | 2,163,605.45  |
| 2.75 T-NOTE 250831  | 5,840,000.00  | 5,873,306.25  |
| 2.75 T-NOTE 280215  | 7,360,000.00  | 7,365,750.00  |
| 2.875 T-BOND 430515 | 2,800,000.00  | 2,716,437.50  |
| 2.875 T-BOND 450815 | 2,800,000.00  | 2,709,218.75  |
| 2.875 T-BOND 461115 | 3,080,000.00  | 2,974,365.62  |
| 2.875 T-NOTE 201031 | 2,800,000.00  | 2,812,359.37  |
| 2.875 T-NOTE 211015 | 4,700,000.00  | 4,734,699.21  |
| 2.875 T-NOTE 250430 | 2,600,000.00  | 2,633,921.87  |
| 2.875 T-NOTE 250531 | 2,400,000.00  | 2,431,500.00  |
| 2.875 T-NOTE 251130 | 300,000.00    | 304,054.68    |
| 2.875 T-NOTE 280515 | 3,600,000.00  | 3,637,687.50  |
| 2.875 T-NOTE 280815 | 3,460,000.00  | 3,496,221.87  |
| 3 T-BOND 420515     | 950,000.00    | 944,878.90    |
| 3 T-BOND 441115     | 2,500,000.00  | 2,477,929.68  |
| 3 T-BOND 450515     | 2,750,000.00  | 2,724,218.75  |
| 3 T-BOND 451115     | 2,950,000.00  | 2,922,804.68  |
| 3 T-BOND 470215     | 3,150,000.00  | 3,117,515.62  |
| 3 T-BOND 470515     | 1,950,000.00  | 1,927,453.12  |
| 3 T-BOND 480215     | 3,050,000.00  | 3,009,253.90  |
| 3 T-BOND 480815     | 3,710,000.00  | 3,661,016.38  |
| 3.125 T-BOND 411115 | 800,000.00    | 813,750.00    |
| 3.125 T-BOND 420215 | 900,000.00    | 915,539.06    |
| 3.125 T-BOND 430215 | 1,700,000.00  | 1,723,242.18  |
| 3.125 T-BOND 440815 | 5,100,000.00  | 5,169,328.12  |
| 3.125 T-BOND 480515 | 2,600,000.00  | 2,628,640.62  |
| 3.125 T-NOTE 210515 | 1,100,000.00  | 1,113,019.53  |
| 3.125 T-NOTE 281115 | 3,300,000.00  | 3,405,445.31  |

|          |      |                      |                |                                    |  |
|----------|------|----------------------|----------------|------------------------------------|--|
|          |      | 3.375 T-BOND 440515  | 2,200,000.00   | 2,326,843.75                       |  |
|          |      | 3.375 T-BOND 481115  | 1,500,000.00   | 1,591,640.62                       |  |
|          |      | 3.5 T-BOND 390215    | 1,000,000.00   | 1,086,484.37                       |  |
|          |      | 3.5 T-NOTE 200515    | 2,100,000.00   | 2,123,050.78                       |  |
|          |      | 3.625 T-BOND 430815  | 2,350,000.00   | 2,585,550.78                       |  |
|          |      | 3.625 T-BOND 440215  | 2,950,000.00   | 3,247,996.09                       |  |
|          |      | 3.625 T-NOTE 200215  | 2,900,000.00   | 2,930,246.09                       |  |
|          |      | 3.625 T-NOTE 210215  | 2,900,000.00   | 2,958,906.25                       |  |
|          |      | 3.75 T-BOND 410815   | 1,000,000.00   | 1,120,546.87                       |  |
|          |      | 3.75 T-BOND 431115   | 2,900,000.00   | 3,254,570.31                       |  |
|          |      | 3.875 T-BOND 400815  | 1,000,000.00   | 1,140,781.25                       |  |
|          |      | 4.25 T-BOND 390515   | 1,350,000.00   | 1,619,472.65                       |  |
|          |      | 4.25 T-BOND 401115   | 900,000.00     | 1,080,632.81                       |  |
|          |      | 4.375 T-BOND 380215  | 450,000.00     | 547,980.46                         |  |
|          |      | 4.375 T-BOND 391115  | 500,000.00     | 609,179.68                         |  |
|          |      | 4.375 T-BOND 400515  | 1,250,000.00   | 1,525,097.65                       |  |
|          |      | 4.375 T-BOND 410515  | 1,300,000.00   | 1,589,148.43                       |  |
|          |      | 4.5 T-BOND 360215    | 1,150,000.00   | 1,408,480.46                       |  |
|          |      | 4.5 T-BOND 380515    | 510,000.00     | 631,284.37                         |  |
|          |      | 4.5 T-BOND 390815    | 400,000.00     | 495,281.25                         |  |
|          |      | 4.625 T-BOND 400215  | 2,950,000.00   | 3,714,925.77                       |  |
|          |      | 4.75 T-BOND 410215   | 1,000,000.00   | 1,282,968.75                       |  |
|          |      | 5 T-BOND 370515      | 300,000.00     | 391,593.75                         |  |
|          |      | 5.25 T-BOND 281115   | 550,000.00     | 666,359.37                         |  |
|          |      | 5.25 T-BOND 290215   | 300,000.00     | 364,933.59                         |  |
|          |      | 5.375 T-BOND 310215  | 1,250,000.00   | 1,577,734.37                       |  |
|          |      | 5.5 T-BOND 280815    | 600,000.00     | 737,250.00                         |  |
|          |      | 6 T-BOND 260215      | 400,000.00     | 485,187.50                         |  |
|          |      | 6.125 T-BOND 271115  | 600,000.00     | 757,828.12                         |  |
|          |      | 6.25 T-BOND 230815   | 130,000.00     | 150,190.62                         |  |
|          |      | 6.25 T-BOND 300515   | 550,000.00     | 733,433.59                         |  |
|          |      | 6.5 T-BOND 261115    | 900,000.00     | 1,139,906.25                       |  |
|          |      | 8 T-BOND 211115      | 600,000.00     | 687,070.31                         |  |
|          |      | 8.75 T-BOND 200815   | 800,000.00     | 873,531.24                         |  |
| アメリカドル合計 |      |                      | 547,940,000.00 | 543,466,683.09<br>(59,428,081,795) |  |
| カナダドル    | 国債証券 | 0.5 CAN GOVT 220301  | 1,100,000.00   | 1,054,581.00                       |  |
|          |      | 0.75 CAN GOVT 200901 | 1,650,000.00   | 1,621,405.50                       |  |
|          |      | 0.75 CAN GOVT 210301 | 850,000.00     | 830,577.50                         |  |
|          |      | 0.75 CAN GOVT 210901 | 2,120,000.00   | 2,060,343.20                       |  |
|          |      | 1 CAN GOVT 220901    | 1,050,000.00   | 1,017,901.50                       |  |
|          |      | 1 CAN GOVT 270601    | 950,000.00     | 880,745.00                         |  |

|           |      |                          |               |                                  |  |
|-----------|------|--------------------------|---------------|----------------------------------|--|
|           |      | 1.25 CAN GOVT 200201     | 1,420,000.00  | 1,411,536.80                     |  |
|           |      | 1.5 CAN GOVT 200301      | 2,200,000.00  | 2,191,662.00                     |  |
|           |      | 1.5 CAN GOVT 230601      | 850,000.00    | 836,230.00                       |  |
|           |      | 1.5 CAN GOVT 260601      | 800,000.00    | 776,336.00                       |  |
|           |      | 1.75 CAN GOVT 200501     | 700,000.00    | 699,062.00                       |  |
|           |      | 1.75 CAN GOVT 230301     | 800,000.00    | 795,536.00                       |  |
|           |      | 2 CAN GOVT 230901        | 2,400,000.00  | 2,411,520.00                     |  |
|           |      | 2 CAN GOVT 280601        | 900,000.00    | 902,205.00                       |  |
|           |      | 2 CAN GOVT 511201        | 250,000.00    | 239,012.50                       |  |
|           |      | 2.25 CAN GOVT 250601     | 950,000.00    | 968,829.00                       |  |
|           |      | 2.25 CAN GOVT 290601     | 440,000.00    | 450,458.80                       |  |
|           |      | 2.5 CAN GOVT 240601      | 1,000,000.00  | 1,030,330.00                     |  |
|           |      | 2.75 CAN GOVT 220601     | 850,000.00    | 873,740.50                       |  |
|           |      | 2.75 CAN GOVT 481201     | 980,000.00    | 1,099,658.00                     |  |
|           |      | 2.75 CANADA GOVER 641201 | 310,000.00    | 363,059.60                       |  |
|           |      | 3.25 CAN GOVT 210601     | 800,000.00    | 825,096.00                       |  |
|           |      | 3.5 CAN GOVT 200601      | 900,000.00    | 919,431.00                       |  |
|           |      | 3.5 CAN GOVT 451201      | 1,250,000.00  | 1,576,625.00                     |  |
|           |      | 4 CAN GOVT 410601        | 950,000.00    | 1,250,266.50                     |  |
|           |      | 5 CAN GOVT 370601        | 850,000.00    | 1,213,621.50                     |  |
|           |      | 5.75 CAN GOVT 290601     | 850,000.00    | 1,145,307.00                     |  |
|           |      | 5.75 CAN GOVT 330601     | 800,000.00    | 1,161,264.00                     |  |
|           |      | 8 CAN GOVT 270601        | 500,000.00    | 730,775.00                       |  |
| カナダドル合計   |      |                          | 29,470,000.00 | 31,337,115.90<br>(2,592,519,598) |  |
| オーストラリアドル | 国債証券 | 1.75 AUST GOVT 201121    | 1,650,000.00  | 1,648,291.11                     |  |
|           |      | 2 AUST GOVT 211221       | 1,150,000.00  | 1,159,259.45                     |  |
|           |      | 2.25 AUST GOVT 221121    | 1,000,000.00  | 1,019,272.00                     |  |
|           |      | 2.25 AUST GOVT 280521    | 1,800,000.00  | 1,807,724.34                     |  |
|           |      | 2.5 AUST GOVT 300521     | 500,000.00    | 512,933.35                       |  |
|           |      | 2.75 AUST GOVT 240421    | 1,700,000.00  | 1,775,581.14                     |  |
|           |      | 2.75 AUST GOVT 271121    | 1,950,000.00  | 2,040,729.01                     |  |
|           |      | 2.75 AUST GOVT 281121    | 1,400,000.00  | 1,466,579.24                     |  |
|           |      | 2.75 AUST GOVT 291121    | 930,000.00    | 976,883.34                       |  |
|           |      | 2.75 AUST GOVT 350621    | 500,000.00    | 519,536.60                       |  |
|           |      | 3 AUST GOVT 470321       | 890,000.00    | 941,000.20                       |  |
|           |      | 3.25 AUST GOVT 250421    | 1,550,000.00  | 1,667,262.15                     |  |
|           |      | 3.25 AUST GOVT 290421    | 1,550,000.00  | 1,696,505.38                     |  |
|           |      | 3.25 AUST GOVT 390621    | 900,000.00    | 994,141.71                       |  |
|           |      | 3.75 AUST GOVT 370421    | 800,000.00    | 944,257.12                       |  |
|           |      | 4.25 AUST GOVT 260421    | 3,500,000.00  | 4,016,766.60                     |  |
|           |      | 4.5 AUST GOVT 200415     | 1,750,000.00  | 1,804,547.67                     |  |

|                  |              |                       |               |                                  |
|------------------|--------------|-----------------------|---------------|----------------------------------|
|                  |              | 4.5 AUST GOVT 330421  | 1,270,000.00  | 1,599,923.14                     |
|                  |              | 4.75 AUST GOVT 270421 | 1,950,000.00  | 2,335,936.78                     |
|                  |              | 5.5 AUST GOVT 230421  | 1,550,000.00  | 1,785,233.89                     |
|                  |              | 5.75 AUST GOVT 210515 | 2,060,000.00  | 2,244,215.08                     |
|                  |              | 5.75 AUST GOVT 220715 | 1,600,000.00  | 1,816,862.72                     |
| オーストラリアドル合計      |              |                       | 31,950,000.00 | 34,773,442.02<br>(2,731,801,605) |
| イギリス<br>ポンド      | 国債証券         | 0.5 GILT 220722       | 1,500,000.00  | 1,481,948.10                     |
|                  |              | 0.75 GILT 230722      | 2,250,000.00  | 2,230,295.40                     |
|                  |              | 1.25 GILT 270722      | 1,350,000.00  | 1,354,104.00                     |
|                  |              | 1.5 GILT 210122       | 1,720,000.00  | 1,743,330.08                     |
|                  |              | 1.5 GILT 260722       | 1,660,000.00  | 1,706,264.20                     |
|                  |              | 1.5 GILT 470722       | 1,520,000.00  | 1,422,264.00                     |
|                  |              | 1.625 GILT 281022     | 1,150,000.00  | 1,183,304.00                     |
|                  |              | 1.625 GILT 711022     | 1,120,000.00  | 1,106,376.32                     |
|                  |              | 1.75 GILT 220907      | 1,700,000.00  | 1,752,768.68                     |
|                  |              | 1.75 GILT 370907      | 870,000.00    | 874,201.05                       |
|                  |              | 1.75 GILT 570722      | 1,070,000.00  | 1,085,215.40                     |
|                  |              | 2 GILT 200722         | 2,050,000.00  | 2,086,328.46                     |
|                  |              | 2 GILT 250907         | 1,300,000.00  | 1,379,170.00                     |
|                  |              | 2.25 GILT 230907      | 2,050,000.00  | 2,171,524.00                     |
|                  |              | 2.5 GILT 650722       | 1,350,000.00  | 1,707,723.00                     |
|                  |              | 2.75 GILT 240907      | 1,150,000.00  | 1,259,658.25                     |
|                  |              | 3.25 GILT 440122      | 1,700,000.00  | 2,197,284.00                     |
|                  |              | 3.5 GILT 450122       | 1,770,000.00  | 2,395,850.76                     |
|                  |              | 3.5 GILT 680722       | 1,290,000.00  | 2,075,429.40                     |
|                  |              | 3.75 GILT 200907      | 1,200,000.00  | 1,256,283.36                     |
|                  |              | 3.75 GILT 210907      | 900,000.00    | 968,124.78                       |
|                  |              | 3.75 GILT 520722      | 1,250,000.00  | 1,889,470.00                     |
|                  |              | 4 GILT 220307         | 450,000.00    | 493,747.56                       |
|                  |              | 4 GILT 600122         | 910,000.00    | 1,532,212.50                     |
|                  |              | 4.25 GILT 271207      | 750,000.00    | 941,776.50                       |
|                  |              | 4.25 GILT 320607      | 1,220,000.00  | 1,624,144.52                     |
|                  |              | 4.25 GILT 360307      | 1,275,000.00  | 1,766,570.64                     |
|                  |              | 4.25 GILT 390907      | 1,150,000.00  | 1,652,977.80                     |
|                  |              | 4.25 GILT 401207      | 990,000.00    | 1,439,865.90                     |
|                  |              | 4.25 GILT 461207      | 1,100,000.00  | 1,692,251.00                     |
|                  |              | 4.25 GILT 491207      | 820,000.00    | 1,302,570.00                     |
|                  |              | 4.25 GILT 551207      | 1,020,000.00  | 1,727,084.40                     |
| 4.5 GILT 340907  | 1,210,000.00 | 1,693,491.80          |               |                                  |
| 4.5 GILT 421207  | 1,100,000.00 | 1,684,350.80          |               |                                  |
| 4.75 GILT 200307 | 300,000.00   | 312,976.98            |               |                                  |



|                         |            |                          |               |                                  |
|-------------------------|------------|--------------------------|---------------|----------------------------------|
|                         |            | 4.75 GILT 301207         | 1,060,000.00  | 1,446,363.21                     |
|                         |            | 4.75 GILT 381207         | 1,600,000.00  | 2,421,532.16                     |
|                         |            | 5 GILT 250307            | 950,000.00    | 1,173,128.40                     |
|                         |            | 6 GILT 281207            | 900,000.00    | 1,292,310.00                     |
|                         |            | 8 GILT 210607            | 900,000.00    | 1,051,622.46                     |
| イギリスポンド合計               |            |                          | 49,625,000.00 | 60,575,893.87<br>(8,744,130,280) |
| シンガ<br>ポールド<br>ル        | 国債証券       | 1.25 SINGAPORGOVT 211001 | 200,000.00    | 196,100.00                       |
|                         |            | 1.75 SINGAPORGOVT 220401 | 350,000.00    | 347,200.00                       |
|                         |            | 1.75 SINGAPORGOVT 230201 | 250,000.00    | 247,300.00                       |
|                         |            | 2 SINGAPORGOVT 200701    | 450,000.00    | 450,090.00                       |
|                         |            | 2.125 SINGAPORGOV 260601 | 230,000.00    | 229,655.00                       |
|                         |            | 2.25 SINGAPORGOVT 210601 | 420,000.00    | 422,352.00                       |
|                         |            | 2.25 SINGAPORGOVT 360801 | 260,000.00    | 250,200.60                       |
|                         |            | 2.375 SINGAPORGOV 250601 | 300,000.00    | 304,680.00                       |
|                         |            | 2.625 SINGAPORGOV 280501 | 100,000.00    | 103,604.00                       |
|                         |            | 2.75 SINGAPORGOVT 230701 | 450,000.00    | 463,160.25                       |
|                         |            | 2.75 SINGAPORGOVT 420401 | 290,000.00    | 296,090.00                       |
|                         |            | 2.75 SINGAPORGOVT 460301 | 420,000.00    | 428,897.70                       |
|                         |            | 2.875 SINGAPORGOV 290701 | 100,000.00    | 105,900.00                       |
|                         |            | 2.875SINGAPORGOVT 300901 | 300,000.00    | 316,800.00                       |
|                         |            | 3 SINGAPORGOVT 240901    | 350,000.00    | 366,730.00                       |
|                         |            | 3.125SINGAPORGOVT 220901 | 300,000.00    | 311,430.00                       |
|                         |            | 3.25 SINGAPORGOVT 200901 | 370,000.00    | 377,205.75                       |
|                         |            | 3.375 SINGAPORGOV 330901 | 310,000.00    | 344,487.50                       |
| 3.5 SINGAPORGOVT 270301 | 650,000.00 | 714,480.00               |               |                                  |
| シンガポールドル合計              |            |                          | 6,100,000.00  | 6,276,362.80<br>(507,443,932)    |
| マレーシ<br>アリン<br>ギット      | 国債証券       | 3.418MALAYSIAGOV 220815  | 900,000.00    | 890,975.28                       |
|                         |            | 3.48 MALAYSIAGOV 230315  | 1,200,000.00  | 1,185,743.98                     |
|                         |            | 3.492 MALAYSIAGOV 200331 | 500,000.00    | 500,112.90                       |
|                         |            | 3.502MALAYSIAGOV 270531  | 300,000.00    | 287,883.33                       |
|                         |            | 3.659 MALAYSIAGOV 201015 | 1,000,000.00  | 1,002,619.20                     |
|                         |            | 3.733 MALAYSIAGO 280615  | 600,000.00    | 583,661.91                       |
|                         |            | 3.795 MALAYSIAGOV 220930 | 500,000.00    | 500,951.35                       |
|                         |            | 3.8 MALAYSIAGOV 230817   | 200,000.00    | 199,500.09                       |
|                         |            | 3.844 MALAYSIAGOV 330415 | 600,000.00    | 561,940.23                       |
|                         |            | 3.882 MALAYSIAGOV 220310 | 500,000.00    | 504,246.00                       |
|                         |            | 3.882 MALAYSIAGOV 250314 | 1,000,000.00  | 995,761.45                       |
|                         |            | 3.889 MALAYSIAGO 200731  | 700,000.00    | 704,095.56                       |
|                         |            | 3.892 MALAYSIAGOV 270315 | 500,000.00    | 493,959.98                       |
|                         |            | 3.899 MALAYSIAGOV 271116 | 1,100,000.00  | 1,083,715.38                     |

|                |      |                          |               |                                |
|----------------|------|--------------------------|---------------|--------------------------------|
|                |      | 3.9 MALAYSIAGOV 261130   | 1,000,000.00  | 989,754.80                     |
|                |      | 3.955 MALAYSIAGOV 250915 | 800,000.00    | 799,277.92                     |
|                |      | 4.048 MALAYSIA 210930    | 900,000.00    | 909,903.60                     |
|                |      | 4.127 MALAYSIA 320415    | 600,000.00    | 584,588.85                     |
|                |      | 4.16 MALAYSIAGOV 210715  | 1,050,000.00  | 1,062,976.84                   |
|                |      | 4.181 MALAYSIAGOV 240715 | 1,000,000.00  | 1,013,416.00                   |
|                |      | 4.232MALAYSIAGOV 310630  | 800,000.00    | 792,333.70                     |
|                |      | 4.254 MALAYSIAGOV 350531 | 350,000.00    | 339,641.80                     |
|                |      | 4.392 MALAYSIAGOV 260415 | 500,000.00    | 511,575.65                     |
|                |      | 4.498 MALAYSIAGOV 300415 | 900,000.00    | 917,271.72                     |
|                |      | 4.642 MALAYSIAGOV 331107 | 800,000.00    | 819,938.56                     |
|                |      | 4.736 MALAYSIAGOV 460315 | 1,050,000.00  | 1,039,273.11                   |
|                |      | 4.762 MALAYSIAGOV 370407 | 1,100,000.00  | 1,125,607.01                   |
|                |      | 4.935 MALAYSIAGOV 430930 | 350,000.00    | 357,447.79                     |
|                |      | 5.248 MALAYSIA 280915    | 200,000.00    | 216,972.64                     |
| マレーシアリングット合計   |      |                          | 21,000,000.00 | 20,975,146.63<br>(558,148,651) |
| スウェーデン<br>クローネ | 国債証券 | 0.75 SWD GOVT 280512     | 3,850,000.00  | 3,967,956.30                   |
|                |      | 0.75 SWD GOVT 291112     | 2,200,000.00  | 2,237,125.00                   |
|                |      | 1 SWD GOVT 261112        | 3,960,000.00  | 4,182,552.00                   |
|                |      | 1.5 SWD GOVT 231113      | 4,720,000.00  | 5,075,467.92                   |
|                |      | 2.5 SWD GOVT 250512      | 4,630,000.00  | 5,326,663.13                   |
|                |      | 3.5 SWD GOVT 220601      | 7,900,000.00  | 8,889,996.40                   |
|                |      | 3.5 SWD GOVT 390330      | 3,130,000.00  | 4,495,493.80                   |
|                |      | 5 SWD GOVT 201201        | 5,700,000.00  | 6,271,849.08                   |
| スウェーデンクローネ合計   |      |                          | 36,090,000.00 | 40,447,103.63<br>(489,005,482) |
| ノルウェー<br>クローネ  | 国債証券 | 1.5 NORWE GOVT 260219    | 2,560,000.00  | 2,548,019.20                   |
|                |      | 1.75 NORWE GOVT 250313   | 2,300,000.00  | 2,332,987.98                   |
|                |      | 1.75 NORWE GOVT 270217   | 1,950,000.00  | 1,964,322.75                   |
|                |      | 2 NORWE GOVT 230524      | 5,150,000.00  | 5,291,522.00                   |
|                |      | 2 NORWE GOVT 280426      | 2,550,000.00  | 2,608,140.00                   |
|                |      | 3 NORWE GOVT 240314      | 3,150,000.00  | 3,396,726.90                   |
|                |      | 3.75 NORWE GOVT 210525   | 4,750,000.00  | 5,028,578.00                   |
| ノルウェークローネ合計    |      |                          | 22,410,000.00 | 23,170,296.83<br>(297,506,611) |
| デンマーク<br>クローネ  | 国債証券 | 0.25 DMK GOVT 201115     | 1,900,000.00  | 1,928,587.40                   |
|                |      | 0.5 DMK GOVT 271115      | 7,650,000.00  | 7,897,189.86                   |
|                |      | 1.5 DMK GOVT 231115      | 3,150,000.00  | 3,422,440.98                   |
|                |      | 1.75 DMK GOVT 251115     | 5,350,000.00  | 6,020,863.25                   |
|                |      | 3 DMK GOVT 211115        | 6,020,000.00  | 6,617,602.99                   |
|                |      | 4.5 DMK GOVT 391115      | 8,760,000.00  | 15,428,917.92                  |

|                          |              |                          |                |                                 |
|--------------------------|--------------|--------------------------|----------------|---------------------------------|
| デンマーククローネ合計              |              |                          | 32,830,000.00  | 41,315,602.40<br>(690,383,716)  |
| メキシコ<br>ペソ               | 国債証券         | 10 MEXICAN BONOS 241205  | 19,300,000.00  | 20,850,755.00                   |
|                          |              | 10 MEXICAN BONOS 361120  | 4,100,000.00   | 4,596,387.00                    |
|                          |              | 5.75 MEXICAN BONO 260305 | 11,700,000.00  | 10,092,771.00                   |
|                          |              | 6.5 MEXICAN BONOS 210610 | 23,100,000.00  | 22,267,938.00                   |
|                          |              | 6.5 MEXICAN BONOS 220609 | 15,900,000.00  | 15,110,088.00                   |
|                          |              | 7.25 MEXICAN BONO 211209 | 6,500,000.00   | 6,339,938.02                    |
|                          |              | 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 24,150,000.00  | 22,854,352.50                   |
|                          |              | 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 9,450,000.00   | 8,864,289.00                    |
|                          |              | 7.75 MEXICAN BONO 341123 | 9,500,000.00   | 8,774,580.00                    |
|                          |              | 7.75 MEXICAN BONO 421113 | 13,240,000.00  | 11,964,193.60                   |
|                          |              | 8 MEXICAN BONOS 200611   | 15,000,000.00  | 14,956,800.00                   |
|                          |              | 8 MEXICAN BONOS 231207   | 8,350,000.00   | 8,280,444.50                    |
|                          |              | 8 MEXICAN BONOS 471107   | 4,350,000.00   | 4,020,939.16                    |
|                          |              | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 5,500,000.00   | 5,512,375.00                    |
| 8.5 MEXICAN BONOS 381118 | 8,600,000.00 | 8,432,644.00             |                |                                 |
| メキシコペソ合計                 |              |                          | 178,740,000.00 | 172,918,494.78<br>(996,010,529) |
| ポーランド<br>ズロチ             | 国債証券         | 1.5 POLAND 200425        | 3,200,000.00   | 3,209,056.00                    |
|                          |              | 1.75 POLAND 210725       | 1,900,000.00   | 1,911,964.30                    |
|                          |              | 2 POLAND 210425          | 1,800,000.00   | 1,822,680.00                    |
|                          |              | 2.25 POLAND 220425       | 1,250,000.00   | 1,269,750.00                    |
|                          |              | 2.5 POLAND 230125        | 2,500,000.00   | 2,554,467.50                    |
|                          |              | 2.5 POLAND 260725        | 2,650,000.00   | 2,628,879.50                    |
|                          |              | 2.5 POLAND 270725        | 2,050,000.00   | 2,016,453.80                    |
|                          |              | 2.75 POLAND 280425       | 1,900,000.00   | 1,890,386.00                    |
|                          |              | 3.25 POLAND 250725       | 2,050,000.00   | 2,147,272.50                    |
|                          |              | 4 POLAND 231025          | 1,800,000.00   | 1,953,090.00                    |
|                          |              | 5.25 POLAND 201025       | 700,000.00     | 746,886.00                      |
|                          |              | 5.75 POLAND 211025       | 1,700,000.00   | 1,888,751.00                    |
|                          |              | 5.75 POLAND 220923       | 1,550,000.00   | 1,760,087.00                    |
|                          |              | 5.75 POLAND 290425       | 870,000.00     | 1,097,565.90                    |
| POLAND 200725            | 700,000.00   | 686,761.36               |                |                                 |
| ポーランドズロチ合計               |              |                          | 26,620,000.00  | 27,584,050.86<br>(802,144,199)  |
| 南アフリ<br>カランド             | 国債証券         | 10.5 SOUTH AFRICA 261221 | 13,100,000.00  | 14,399,520.00                   |
|                          |              | 6.25 SOUTH AFRICA 360331 | 6,950,000.00   | 5,035,742.17                    |
|                          |              | 6.5 SOUTH AFRICA 410228  | 7,200,000.00   | 5,108,760.00                    |
|                          |              | 6.75 SOUTH AFRICA 210331 | 3,000,000.00   | 2,981,700.00                    |
|                          |              | 7 SOUTH AFRICA 310228    | 9,500,000.00   | 7,911,267.50                    |
|                          |              | 7.25 SOUTH AFRICA 200115 | 1,700,000.00   | 1,715,130.00                    |

|            |      |                          |                |                                |
|------------|------|--------------------------|----------------|--------------------------------|
|            |      | 7.75 SOUTH AFRICA 230228 | 5,000,000.00   | 4,981,325.00                   |
|            |      | 8 SOUTH AFRICA 300131    | 11,500,000.00  | 10,546,455.53                  |
|            |      | 8.25 SOUTH AFRICA 320331 | 5,800,000.00   | 5,285,217.57                   |
|            |      | 8.5 SOUTH AFRICA 370131  | 7,700,000.00   | 6,942,476.00                   |
|            |      | 8.75 SOUTH AFRICA 440131 | 10,050,000.00  | 9,099,914.00                   |
|            |      | 8.75 SOUTH AFRICA 480228 | 14,300,000.00  | 12,942,930.00                  |
|            |      | 8.875 SOUTH AFRIC 350228 | 4,950,000.00   | 4,656,602.85                   |
|            |      | 9 SOUTH AFRICA 400131    | 5,000,000.00   | 4,674,810.20                   |
| 南アフリカランド合計 |      |                          | 105,750,000.00 | 96,281,850.82<br>(774,106,080) |
| ユーロ        | 国債証券 | 0 AUSTRIA GOVT 220920    | 400,000.00     | 404,772.00                     |
|            |      | 0 AUSTRIA GOVT 230715    | 350,000.00     | 353,348.69                     |
|            |      | 0 BUND 260815            | 1,900,000.00   | 1,910,940.20                   |
|            |      | 0 FINNISH GOVT 220415    | 250,000.00     | 252,995.82                     |
|            |      | 0 FINNISH GOVT 230915    | 350,000.00     | 353,251.50                     |
|            |      | 0 IRISH GOVT 221018      | 250,000.00     | 251,419.12                     |
|            |      | 0 NETH GOVT 220115       | 800,000.00     | 811,782.08                     |
|            |      | 0 NETH GOVT 240115       | 650,000.00     | 657,107.75                     |
|            |      | 0 O.A.T 200225           | 1,500,000.00   | 1,508,576.10                   |
|            |      | 0 O.A.T 200525           | 1,550,000.00   | 1,561,010.27                   |
|            |      | 0 O.A.T 210225           | 3,140,000.00   | 3,170,765.72                   |
|            |      | 0 O.A.T 210525           | 2,300,000.00   | 2,324,612.99                   |
|            |      | 0 O.A.T 220525           | 1,750,000.00   | 1,770,045.72                   |
|            |      | 0 O.A.T 230325           | 2,100,000.00   | 2,118,764.13                   |
|            |      | 0 O.A.T 240325           | 700,000.00     | 701,940.12                     |
|            |      | 0 OBL 200417             | 1,450,000.00   | 1,460,788.72                   |
|            |      | 0 OBL 210409             | 1,250,000.00   | 1,266,091.25                   |
|            |      | 0 OBL 211008             | 1,000,000.00   | 1,015,128.00                   |
|            |      | 0 OBL 220408             | 1,000,000.00   | 1,016,653.90                   |
|            |      | 0 OBL 221007             | 900,000.00     | 915,768.90                     |
|            |      | 0 OBL 230414             | 700,000.00     | 712,270.30                     |
|            |      | 0 OBL 231013             | 2,450,000.00   | 2,491,878.34                   |
|            |      | 0 SCHATS 201211          | 1,700,000.00   | 1,718,701.36                   |
|            |      | 0.2 BEL GOVT 231022      | 1,000,000.00   | 1,014,279.00                   |
|            |      | 0.2 ITALY GOVT 201015    | 900,000.00     | 898,814.70                     |
|            |      | 0.25 BUND 270215         | 1,650,000.00   | 1,686,748.63                   |
|            |      | 0.25 BUND 280815         | 1,440,000.00   | 1,454,958.72                   |
|            |      | 0.25 NETH GOVT 200115    | 800,000.00     | 806,948.80                     |
|            |      | 0.25 NETH GOVT 250715    | 2,150,000.00   | 2,192,946.25                   |
|            |      | 0.25 O.A.T 201125        | 1,200,000.00   | 1,216,773.60                   |
|            |      | 0.25 O.A.T 261125        | 2,000,000.00   | 1,990,614.00                   |
|            |      | 0.25 OBL 201016          | 1,350,000.00   | 1,369,928.70                   |

|                          |              |              |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 0.35 ITALY GOVT 200615   | 550,000.00   | 551,420.10   |
| 0.35 ITALY GOVT 211101   | 400,000.00   | 396,193.84   |
| 0.35 SPAIN GOVT 230730   | 700,000.00   | 704,375.28   |
| 0.375 FINNISH GOV 200915 | 400,000.00   | 405,786.80   |
| 0.4 SPAIN GOVT 220430    | 1,500,000.00 | 1,523,430.00 |
| 0.45 ITALY GOVT 210601   | 1,300,000.00 | 1,297,680.80 |
| 0.45 SPAIN GOVT 221031   | 550,000.00   | 559,025.50   |
| 0.5 AUSTRIA GOVT 270420  | 500,000.00   | 508,131.00   |
| 0.5 BEL GOVT 241022      | 300,000.00   | 307,222.80   |
| 0.5 BUND 250215          | 1,250,000.00 | 1,305,422.50 |
| 0.5 BUND 260215          | 1,900,000.00 | 1,984,529.10 |
| 0.5 BUND 270815          | 2,300,000.00 | 2,393,681.30 |
| 0.5 BUND 280215          | 1,200,000.00 | 1,245,440.03 |
| 0.5 FINNISH GOVT 260415  | 400,000.00   | 410,277.40   |
| 0.5 FINNISH GOVT 270915  | 350,000.00   | 355,418.70   |
| 0.5 FINNISH GOVT 280915  | 250,000.00   | 251,433.50   |
| 0.5 NETH GOVT 260715     | 1,000,000.00 | 1,033,207.00 |
| 0.5 O.A.T 250525         | 3,750,000.00 | 3,847,522.50 |
| 0.5 O.A.T 260525         | 1,950,000.00 | 1,987,239.15 |
| 0.65 ITALY GOVT 201101   | 600,000.00   | 603,589.80   |
| 0.65 ITALY GOVT 231015   | 900,000.00   | 868,513.00   |
| 0.7 ITALY GOVT 200501    | 1,050,000.00 | 1,056,641.25 |
| 0.75 AUSTRIA GOVT 261020 | 800,000.00   | 832,128.00   |
| 0.75 AUSTRIA GOVT 280220 | 600,000.00   | 618,374.40   |
| 0.75 FINNISH GOVT 310415 | 250,000.00   | 253,366.50   |
| 0.75 NETH GOVT 270715    | 880,000.00   | 921,469.12   |
| 0.75 NETH GOVT 280715    | 880,000.00   | 917,324.32   |
| 0.75 O.A.T 280525        | 3,190,000.00 | 3,253,162.00 |
| 0.75 O.A.T 281125        | 800,000.00   | 811,630.80   |
| 0.75 SPAIN GOVT 210730   | 2,600,000.00 | 2,661,705.80 |
| 0.8 BEL GOVT 250622      | 1,300,000.00 | 1,352,222.30 |
| 0.8 BEL GOVT 270622      | 1,080,000.00 | 1,107,044.28 |
| 0.8 BEL GOVT 280622      | 700,000.00   | 710,493.00   |
| 0.8 IRISH GOVT 220315    | 500,000.00   | 516,488.00   |
| 0.875 FINNISH GOV 250915 | 500,000.00   | 527,115.00   |
| 0.9 IRISH GOVT 280515    | 900,000.00   | 911,816.64   |
| 0.9 ITALY GOVT 220801    | 3,550,000.00 | 3,526,126.74 |
| 0.95 ITALY GOVT 230315   | 1,980,000.00 | 1,952,254.26 |
| 1 BEL GOVT 260622        | 1,100,000.00 | 1,153,454.28 |
| 1 BEL GOVT 310622        | 650,000.00   | 655,832.25   |
| 1 BUND 240815            | 1,150,000.00 | 1,232,256.05 |
| 1 BUND 250815            | 2,050,000.00 | 2,209,807.75 |

|                          |              |              |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 1 IRISH GOVT 260515      | 600,000.00   | 623,626.80   |
| 1 O.A.T 251125           | 1,920,000.00 | 2,029,958.40 |
| 1 O.A.T 270525           | 2,050,000.00 | 2,152,196.60 |
| 1.125 FINNISH GOV 340415 | 280,000.00   | 292,679.24   |
| 1.15 SPAIN GOVT 200730   | 1,300,000.00 | 1,328,116.40 |
| 1.2 AUSTRIA GOVT 251020  | 1,250,000.00 | 1,345,136.25 |
| 1.2 ITALY GOVT 220401    | 900,000.00   | 906,890.40   |
| 1.25 BEL GOVT 330422     | 590,000.00   | 604,608.40   |
| 1.25 BUND 480815         | 1,340,000.00 | 1,505,890.66 |
| 1.25 ITALY GOVT 261201   | 1,300,000.00 | 1,214,693.12 |
| 1.25 O.A.T 340525        | 380,000.00   | 391,898.52   |
| 1.25 O.A.T 360525        | 2,780,000.00 | 2,824,044.92 |
| 1.3 IRISH GOVT 330515    | 300,000.00   | 300,868.20   |
| 1.3 SPAIN GOVT 261031    | 1,400,000.00 | 1,440,965.40 |
| 1.35 IRISH GOVT 310318   | 100,000.00   | 102,753.10   |
| 1.35 ITALY GOVT 220415   | 1,150,000.00 | 1,163,641.30 |
| 1.375 FINNISH GOV 470415 | 180,000.00   | 193,953.42   |
| 1.4 SPAIN GOVT 200131    | 1,550,000.00 | 1,577,217.22 |
| 1.4 SPAIN GOVT 280430    | 1,300,000.00 | 1,326,500.50 |
| 1.4 SPAIN GOVT 280730    | 1,100,000.00 | 1,116,640.80 |
| 1.45 BEL GOVT 370622     | 270,000.00   | 275,479.38   |
| 1.45 ITALY GOVT 220915   | 900,000.00   | 909,738.90   |
| 1.45 ITALY GOVT 241115   | 900,000.00   | 881,436.60   |
| 1.45 ITALY GOVT 250515   | 700,000.00   | 679,714.00   |
| 1.45 SPAIN GOVT 271031   | 2,500,000.00 | 2,573,751.50 |
| 1.5 AUSTRIA GOVT 470220  | 390,000.00   | 413,126.22   |
| 1.5 AUSTRIA GOVT 861102  | 150,000.00   | 145,311.75   |
| 1.5 BUND 220904          | 1,300,000.00 | 1,394,094.00 |
| 1.5 BUND 230215          | 1,200,000.00 | 1,295,292.00 |
| 1.5 BUND 230515          | 1,200,000.00 | 1,299,757.44 |
| 1.5 BUND 240515          | 1,150,000.00 | 1,260,927.85 |
| 1.5 FINNISH GOVT 230415  | 250,000.00   | 268,662.25   |
| 1.5 ITALY GOVT 250601    | 1,550,000.00 | 1,508,067.85 |
| 1.5 O.A.T 310525         | 3,260,000.00 | 3,517,119.46 |
| 1.5 SPAIN GOVT 270430    | 1,050,000.00 | 1,089,132.45 |
| 1.6 BEL GOVT 470622      | 800,000.00   | 795,643.20   |
| 1.6 ITALY GOVT 260601    | 1,200,000.00 | 1,157,829.60 |
| 1.6 SPAIN GOVT 250430    | 1,500,000.00 | 1,593,195.00 |
| 1.625 FINNISH GOV 220915 | 300,000.00   | 321,579.48   |
| 1.65 AUSTRIA GOVT 241021 | 700,000.00   | 769,060.95   |
| 1.65 ITALY GOVT 320301   | 3,060,000.00 | 2,668,170.06 |
| 1.7 IRISH GOVT 370515    | 450,000.00   | 467,107.78   |
| 1.75 AUSTRIA GOVT 231020 | 800,000.00   | 874,751.60   |

|                         |              |              |  |
|-------------------------|--------------|--------------|--|
| 1.75 BUND 220704        | 1,600,000.00 | 1,724,585.60 |  |
| 1.75 BUND 240215        | 1,150,000.00 | 1,271,931.05 |  |
| 1.75 NETH GOVT 230715   | 1,000,000.00 | 1,093,057.00 |  |
| 1.75 O.A.T 230525       | 2,550,000.00 | 2,768,427.90 |  |
| 1.75 O.A.T 241125       | 2,500,000.00 | 2,754,292.50 |  |
| 1.75 O.A.T 390625       | 940,000.00   | 1,022,234.20 |  |
| 1.75 O.A.T 660525       | 720,000.00   | 719,640.00   |  |
| 1.85 ITALY GOVT 240515  | 850,000.00   | 856,606.20   |  |
| 1.9 BEL GOVT 380622     | 650,000.00   | 709,198.75   |  |
| 1.95 SPAIN GOVT 260430  | 1,400,000.00 | 1,509,694.20 |  |
| 1.95 SPAIN GOVT 300730  | 1,350,000.00 | 1,419,376.09 |  |
| 2 BUND 220104           | 1,300,000.00 | 1,397,974.50 |  |
| 2 BUND 230815           | 1,450,000.00 | 1,609,153.01 |  |
| 2 FINNISH GOVT 240415   | 200,000.00   | 222,247.00   |  |
| 2 IRISH GOVT 450218     | 550,000.00   | 592,519.95   |  |
| 2 ITALY GOVT 251201     | 1,200,000.00 | 1,197,025.20 |  |
| 2 ITALY GOVT 280201     | 2,030,000.00 | 1,959,254.50 |  |
| 2 NETH GOVT 240715      | 950,000.00   | 1,063,607.65 |  |
| 2 O.A.T 480525          | 1,800,000.00 | 1,997,532.00 |  |
| 2.05 ITALY GOVT 270801  | 1,300,000.00 | 1,266,687.50 |  |
| 2.1 AUSTRIA GOVT 170920 | 350,000.00   | 421,160.60   |  |
| 2.15 BEL GOVT 660622    | 310,000.00   | 329,917.50   |  |
| 2.15 ITALY GOVT 211215  | 1,000,000.00 | 1,038,116.60 |  |
| 2.15 SPAIN GOVT 251031  | 2,200,000.00 | 2,407,240.00 |  |
| 2.2 ITALY GOVT 270601   | 1,100,000.00 | 1,087,425.90 |  |
| 2.25 BEL GOVT 230622    | 820,000.00   | 909,308.66   |  |
| 2.25 BEL GOVT 570622    | 290,000.00   | 320,911.10   |  |
| 2.25 BUND 200904        | 1,300,000.00 | 1,359,853.30 |  |
| 2.25 BUND 210904        | 800,000.00   | 859,132.48   |  |
| 2.25 ITALY GOVT 360901  | 1,170,000.00 | 1,043,146.51 |  |
| 2.25 NETH GOVT 220715   | 1,400,000.00 | 1,532,241.20 |  |
| 2.25 O.A.T 221025       | 2,350,000.00 | 2,575,120.60 |  |
| 2.25 O.A.T 240525       | 2,300,000.00 | 2,584,192.60 |  |
| 2.35 SPAIN GOVT 330730  | 990,000.00   | 1,064,962.10 |  |
| 2.4 AUSTRIA GOVT 340523 | 450,000.00   | 547,690.50   |  |
| 2.4 IRISH GOVT 300515   | 600,000.00   | 689,845.80   |  |
| 2.45 ITALY GOVT 330901  | 500,000.00   | 469,397.00   |  |
| 2.5 BUND 210104         | 1,500,000.00 | 1,591,347.00 |  |
| 2.5 BUND 440704         | 1,600,000.00 | 2,262,860.80 |  |
| 2.5 BUND 460815         | 1,640,000.00 | 2,356,352.00 |  |
| 2.5 ITALY GOVT 241201   | 1,800,000.00 | 1,867,348.80 |  |
| 2.5 ITALY GOVT 251115   | 1,360,000.00 | 1,395,009.12 |  |

|                          |              |              |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 2.5 NETH GOVT 330115     | 900,000.00   | 1,134,350.10 |
| 2.5 O.A.T 201025         | 2,400,000.00 | 2,526,501.60 |
| 2.5 O.A.T 300525         | 2,150,000.00 | 2,564,606.00 |
| 2.6 BEL GOVT 240622      | 1,180,000.00 | 1,345,185.84 |
| 2.625 FINNISH GOV 420704 | 300,000.00   | 406,636.20   |
| 2.7 ITALY GOVT 470301    | 1,200,000.00 | 1,067,690.40 |
| 2.7 SPAIN GOVT 481031    | 750,000.00   | 795,690.30   |
| 2.75 FINNISH GOVT 280704 | 300,000.00   | 366,018.00   |
| 2.75 NETH GOVT 470115    | 930,000.00   | 1,376,513.46 |
| 2.75 O.A.T 271025        | 2,450,000.00 | 2,943,289.61 |
| 2.75 SPAIN GOVT 241031   | 1,550,000.00 | 1,747,812.55 |
| 2.8 ITALY GOVT 281201    | 550,000.00   | 558,206.55   |
| 2.8 ITALY GOVT 670301    | 410,000.00   | 350,066.20   |
| 2.9 SPAIN GOVT 461031    | 1,260,000.00 | 1,402,429.14 |
| 2.95 ITALY GOVT 380901   | 980,000.00   | 936,733.00   |
| 3 BEL GOVT 340622        | 200,000.00   | 252,667.38   |
| 3 BUND 200704            | 1,500,000.00 | 1,577,947.35 |
| 3 O.A.T 220425           | 3,000,000.00 | 3,329,352.00 |
| 3.15 AUSTRIA GOVT 440620 | 450,000.00   | 647,302.50   |
| 3.25 BUND 200104         | 1,200,000.00 | 1,244,206.80 |
| 3.25 BUND 210704         | 1,800,000.00 | 1,968,202.80 |
| 3.25 BUND 420704         | 950,000.00   | 1,486,875.40 |
| 3.25 ITALY GOVT 460901   | 1,150,000.00 | 1,122,819.75 |
| 3.25 NETH GOVT 210715    | 1,600,000.00 | 1,751,464.00 |
| 3.25 O.A.T 211025        | 2,600,000.00 | 2,864,157.40 |
| 3.25 O.A.T 450525        | 1,640,000.00 | 2,295,120.96 |
| 3.375 FINNISH GOV 200415 | 450,000.00   | 471,537.90   |
| 3.4 AUSTRIA GOVT 221122  | 650,000.00   | 743,359.04   |
| 3.4 IRISH GOVT 240318    | 600,000.00   | 702,105.00   |
| 3.45 ITALY GOVT 480301   | 1,020,000.00 | 1,015,484.05 |
| 3.45 SPAIN GOVT 660730   | 600,000.00   | 720,248.40   |
| 3.5 AUSTRIA GOVT 210915  | 1,050,000.00 | 1,161,031.20 |
| 3.5 FINNISH GOVT 210415  | 400,000.00   | 435,458.40   |
| 3.5 ITALY GOVT 300301    | 1,400,000.00 | 1,496,070.66 |
| 3.5 NETH GOVT 200715     | 750,000.00   | 795,301.20   |
| 3.5 O.A.T 200425         | 2,800,000.00 | 2,940,022.68 |
| 3.5 O.A.T 260425         | 2,550,000.00 | 3,158,723.25 |
| 3.65 AUSTRIA GOVT 220420 | 600,000.00   | 678,298.20   |
| 3.75 BEL GOVT 200928     | 1,200,000.00 | 1,286,033.28 |
| 3.75 BEL GOVT 450622     | 670,000.00   | 990,040.24   |
| 3.75 ITALY GOVT 210301   | 1,900,000.00 | 2,029,029.00 |
| 3.75 ITALY GOVT 210501   | 1,800,000.00 | 1,927,769.94 |
| 3.75 ITALY GOVT 210801   | 2,100,000.00 | 2,257,613.40 |



|                          |              |              |  |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| 3.75 ITALY GOVT 240901   | 1,200,000.00 | 1,322,688.00 |  |
| 3.75 NETH GOVT 230115    | 300,000.00   | 349,970.28   |  |
| 3.75 NETH GOVT 420115    | 1,020,000.00 | 1,672,067.64 |  |
| 3.75 O.A.T 210425        | 2,500,000.00 | 2,737,647.50 |  |
| 3.8 AUSTRIA GOVT 620126  | 250,000.00   | 446,730.00   |  |
| 3.8 SPAIN GOVT 240430    | 1,300,000.00 | 1,528,176.00 |  |
| 3.9 AUSTRIA GOVT 200715  | 820,000.00   | 873,104.84   |  |
| 3.9 IRISH GOVT 230320    | 400,000.00   | 466,741.20   |  |
| 4 BEL GOVT 220328        | 750,000.00   | 854,943.22   |  |
| 4 BEL GOVT 320328        | 620,000.00   | 854,227.32   |  |
| 4 BUND 370104            | 1,550,000.00 | 2,473,570.60 |  |
| 4 FINNISH GOVT 250704    | 550,000.00   | 691,575.50   |  |
| 4 ITALY GOVT 200901      | 1,450,000.00 | 1,535,654.98 |  |
| 4 ITALY GOVT 370201      | 1,600,000.00 | 1,778,753.60 |  |
| 4 NETH GOVT 370115       | 1,150,000.00 | 1,802,942.40 |  |
| 4 O.A.T 381025           | 1,700,000.00 | 2,544,274.57 |  |
| 4 O.A.T 550425           | 940,000.00   | 1,547,289.82 |  |
| 4 O.A.T 600425           | 980,000.00   | 1,655,296.44 |  |
| 4 SPAIN GOVT 200430      | 2,300,000.00 | 2,424,131.00 |  |
| 4.15 AUSTRIA GOVT 370315 | 900,000.00   | 1,378,930.50 |  |
| 4.2 SPAIN GOVT 370131    | 1,570,000.00 | 2,115,906.27 |  |
| 4.25 BEL GOVT 210928     | 950,000.00   | 1,069,910.33 |  |
| 4.25 BEL GOVT 220928     | 1,100,000.00 | 1,285,733.90 |  |
| 4.25 BEL GOVT 410328     | 1,050,000.00 | 1,610,080.50 |  |
| 4.25 BUND 390704         | 930,000.00   | 1,585,862.77 |  |
| 4.25 ITALY GOVT 200301   | 1,650,000.00 | 1,723,305.21 |  |
| 4.25 O.A.T 231025        | 2,950,000.00 | 3,571,948.50 |  |
| 4.4 SPAIN GOVT 231031    | 1,350,000.00 | 1,612,061.32 |  |
| 4.5 BEL GOVT 260328      | 800,000.00   | 1,039,406.40 |  |
| 4.5 IRISH GOVT 200418    | 650,000.00   | 689,908.05   |  |
| 4.5 ITALY GOVT 200201    | 1,700,000.00 | 1,774,783.00 |  |
| 4.5 ITALY GOVT 230501    | 1,300,000.00 | 1,467,250.20 |  |
| 4.5 ITALY GOVT 240301    | 1,350,000.00 | 1,533,605.40 |  |
| 4.5 ITALY GOVT 260301    | 1,450,000.00 | 1,673,828.96 |  |
| 4.5 O.A.T 410425         | 2,490,000.00 | 4,039,427.40 |  |
| 4.65 SPAIN GOVT 250730   | 1,550,000.00 | 1,943,346.75 |  |
| 4.7 SPAIN GOVT 410730    | 1,210,000.00 | 1,759,635.96 |  |
| 4.75 BUND 280704         | 650,000.00   | 934,716.25   |  |
| 4.75 BUND 340704         | 1,300,000.00 | 2,139,316.40 |  |
| 4.75 BUND 400704         | 1,000,000.00 | 1,836,642.00 |  |
| 4.75 ITALY GOVT 210901   | 3,000,000.00 | 3,305,715.00 |  |
| 4.75 ITALY GOVT 230801   | 1,700,000.00 | 1,946,454.10 |  |

|                          |              |              |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 4.75 ITALY GOVT 280901   | 1,300,000.00 | 1,544,294.70 |
| 4.75 ITALY GOVT 440901   | 1,220,000.00 | 1,475,402.12 |
| 4.75 O.A.T 350425        | 1,730,000.00 | 2,701,227.88 |
| 4.8 SPAIN GOVT 240131    | 1,100,000.00 | 1,342,663.30 |
| 4.85 AUSTRIA GOVT 260315 | 550,000.00   | 734,704.30   |
| 4.85 SPAIN GOVT 201031   | 1,650,000.00 | 1,798,650.64 |
| 4.9 SPAIN GOVT 400730    | 1,100,000.00 | 1,632,637.16 |
| 5 BEL GOVT 350328        | 1,520,000.00 | 2,377,971.60 |
| 5 IRISH GOVT 201018      | 550,000.00   | 601,801.75   |
| 5 ITALY GOVT 220301      | 1,500,000.00 | 1,683,538.50 |
| 5 ITALY GOVT 250301      | 1,350,000.00 | 1,587,265.20 |
| 5 ITALY GOVT 340801      | 1,930,000.00 | 2,379,402.43 |
| 5 ITALY GOVT 390801      | 1,450,000.00 | 1,794,064.70 |
| 5 ITALY GOVT 400901      | 1,400,000.00 | 1,725,379.60 |
| 5.15 SPAIN GOVT 281031   | 950,000.00   | 1,290,362.20 |
| 5.15 SPAIN GOVT 441031   | 1,100,000.00 | 1,715,172.80 |
| 5.25 ITALY GOVT 291101   | 1,750,000.00 | 2,158,838.50 |
| 5.4 IRISH GOVT 250313    | 700,000.00   | 918,342.60   |
| 5.4 SPAIN GOVT 230131    | 1,750,000.00 | 2,121,502.25 |
| 5.5 BEL GOVT 280328      | 1,300,000.00 | 1,872,135.20 |
| 5.5 BUND 310104          | 1,090,000.00 | 1,764,567.21 |
| 5.5 ITALY GOVT 220901    | 1,150,000.00 | 1,325,725.75 |
| 5.5 ITALY GOVT 221101    | 1,700,000.00 | 1,964,168.10 |
| 5.5 NETH GOVT 280115     | 850,000.00   | 1,252,998.60 |
| 5.5 O.A.T 290425         | 2,300,000.00 | 3,424,711.50 |
| 5.5 SPAIN GOVT 210430    | 1,700,000.00 | 1,918,493.18 |
| 5.625 BUND 280104        | 950,000.00   | 1,425,172.90 |
| 5.75 ITALY GOVT 330201   | 1,350,000.00 | 1,763,858.70 |
| 5.75 O.A.T 321025        | 2,140,000.00 | 3,494,234.37 |
| 5.75 SPAIN GOVT 320730   | 1,500,000.00 | 2,257,040.55 |
| 5.85 SPAIN GOVT 220131   | 1,850,000.00 | 2,180,829.02 |
| 5.9 SPAIN GOVT 260730    | 1,300,000.00 | 1,774,965.40 |
| 6 ITALY GOVT 310501      | 1,950,000.00 | 2,573,555.40 |
| 6 O.A.T 251025           | 2,300,000.00 | 3,208,391.44 |
| 6 SPAIN GOVT 290131      | 1,850,000.00 | 2,672,800.82 |
| 6.25 AUSTRIA GOVT 270715 | 670,000.00   | 1,004,860.64 |
| 6.25 BUND 240104         | 700,000.00   | 929,316.50   |
| 6.25 BUND 300104         | 600,000.00   | 994,607.70   |
| 6.5 BUND 270704          | 800,000.00   | 1,240,795.20 |
| 6.5 ITALY GOVT 271101    | 2,000,000.00 | 2,638,946.00 |
| 7.25 ITALY GOVT 261101   | 850,000.00   | 1,151,617.40 |
| 7.5 NETH GOVT 230115     | 650,000.00   | 854,974.90   |
| 8.5 O.A.T 230425         | 1,000,000.00 | 1,372,743.00 |

|       |                     |                |                                      |
|-------|---------------------|----------------|--------------------------------------|
|       | 9 ITALY GOVT 231101 | 1,200,000.00   | 1,611,972.00                         |
| ユーロ合計 |                     | 354,430,000.00 | 404,293,967.08<br>(50,439,715,332)   |
|       | 合計                  |                | 129,050,997,810<br>(129,050,997,810) |

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

| 種類          | 銘柄数        | 組入債券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|-------------|------------|--------------|-------------------------|
| アメリカドル      | 国債証券 220銘柄 | 100.00%      | 46.05%                  |
| カナダドル       | 国債証券 29銘柄  | 100.00%      | 2.01%                   |
| オーストラリアドル   | 国債証券 22銘柄  | 100.00%      | 2.12%                   |
| イギリスポンド     | 国債証券 40銘柄  | 100.00%      | 6.78%                   |
| シンガポールドル    | 国債証券 19銘柄  | 100.00%      | 0.39%                   |
| マレーシアリングギット | 国債証券 29銘柄  | 100.00%      | 0.43%                   |
| スウェーデンクローネ  | 国債証券 8銘柄   | 100.00%      | 0.38%                   |
| ノルウェークローネ   | 国債証券 7銘柄   | 100.00%      | 0.23%                   |
| デンマーククローネ   | 国債証券 6銘柄   | 100.00%      | 0.53%                   |
| メキシコペソ      | 国債証券 15銘柄  | 100.00%      | 0.77%                   |
| ポーランドズロチ    | 国債証券 15銘柄  | 100.00%      | 0.62%                   |
| 南アフリカランド    | 国債証券 14銘柄  | 100.00%      | 0.60%                   |
| ユーロ         | 国債証券 288銘柄 | 100.00%      | 39.09%                  |

#### 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)

[平成31年 1月28日現在]

|      |             |
|------|-------------|
| 資産の部 |             |
| 流動資産 |             |
| 預金   | 355,836,718 |

[平成31年 1月28日現在]

|             |                |
|-------------|----------------|
| コール・ローン     | 16,390,831     |
| 国債証券        | 19,746,620,648 |
| 派生商品評価勘定    | 19,850         |
| 未収利息        | 328,702,224    |
| 前払費用        | 20,147,773     |
| 流動資産合計      | 20,467,718,044 |
| 資産合計        | 20,467,718,044 |
| 負債の部        |                |
| 流動負債        |                |
| 派生商品評価勘定    | 6,998          |
| 未払金         | 36,513,910     |
| 未払解約金       | 10,091,599     |
| 未払利息        | 31             |
| その他未払費用     | 174            |
| 流動負債合計      | 46,612,712     |
| 負債合計        | 46,612,712     |
| 純資産の部       |                |
| 元本等         |                |
| 元本          | 15,407,521,844 |
| 剰余金         |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 5,013,583,488  |
| 元本等合計       | 20,421,105,332 |
| 純資産合計       | 20,421,105,332 |
| 負債純資産合計     | 20,467,718,044 |

## 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本となる重要な事項 | 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

|                             | [平成31年 1月28日現在] |
|-----------------------------|-----------------|
| 1. 期首                       | 平成30年 1月27日     |
| 期首元本額                       | 11,529,608,091円 |
| 期中追加設定元本額                   | 4,721,874,122円  |
| 期中一部解約元本額                   | 843,960,369円    |
| 元本の内訳                       |                 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型)         | 2,636,974,728円  |
| eMAXIS バランス(波乗り型)           | 367,429,952円    |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 451,431,430円    |
| コアバランス                      | 1,273,894円      |

|                               | [平成31年 1月28日現在] |
|-------------------------------|-----------------|
| 海外債券セレクション（ラップ向け）             | 209,620,850円    |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）      | 1,923,147,334円  |
| つみたて8資産均等バランス                 | 530,822,174円    |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s         | 911,980円        |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s         | 1,327,052円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s         | 102,285円        |
| eMAXIS 新興国債券インデックス            | 4,449,112,305円  |
| 三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド       | 4,445,715,591円  |
| 新興国債券インデックスファンド（ラップ向け）        | 5,852,031円      |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）     | 24,740,097円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）    | 154,811,371円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）       | 132,206,685円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）      | 22,592,149円     |
| アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定） | 15,092,845円     |
| アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定） | 19,846,333円     |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）    | 14,510,758円     |
| 合計                            | 15,407,521,844円 |
| 2. 受益権の総数                     | 15,407,521,844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 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日  |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。   |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>  |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                        | [平成31年 1月28日現在]  |
|---------------------------|--|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。   |
| 2.時価の算定方法                 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。<br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。<br>(3)上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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   | [平成31年 1月28日現在]    |             |
|------|--------------------|-------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |             |
| 国債証券 |                    | 431,701,187 |
| 合計   |                    | 431,701,187 |

(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

[平成31年 1月28日現在]

| 区分        | 種類           | 契約額等(円)   |       | 時価(円)     | 評価損益(円) |
|-----------|--------------|-----------|-------|-----------|---------|
|           |              |           | うち1年超 |           |         |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引<br>買建 |           |       |           |         |
|           | アメリカドル       | 9,839,862 |       | 9,839,700 | 162     |
|           | メキシコペソ       | 2,879,000 |       | 2,875,000 | 4,000   |
|           | チェココルナ       | 1,458,420 |       | 1,458,000 | 420     |
|           | ハンガリーフォリント   | 1,571,200 |       | 1,570,800 | 400     |

|  |          |            |  |            |        |
|--|----------|------------|--|------------|--------|
|  | ポーランドズロチ | 3,489,888  |  | 3,488,400  | 1,488  |
|  | トルコリラ    | 1,244,328  |  | 1,243,800  | 528    |
|  | 売建       |            |  |            |        |
|  | アメリカドル   | 5,486,850  |  | 5,467,000  | 19,850 |
|  | 合計       | 25,969,548 |  | 25,942,700 | 12,852 |

## (注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (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)

|              |                 |
|--------------|-----------------|
|              | [平成31年 1月28日現在] |
| 1口当たり純資産額    | 1.3254円         |
| (1万口当たり純資産額) | (13,254円)       |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

| 通貨                  | 種類   | 銘柄                       | 券面総額         | 評価額          | 備考 |
|---------------------|------|--------------------------|--------------|--------------|----|
| マレーシア<br>アリン<br>ギット | 国債証券 | 3.492 MALAYSIAGOV 200331 | 2,000,000.00 | 2,000,451.60 |    |
|                     |      | 3.62 MALAYSIAGOV 211130  | 4,000,000.00 | 4,001,989.20 |    |
|                     |      | 3.659 MALAYSIAGOV 201015 | 3,400,000.00 | 3,408,905.28 |    |
|                     |      | 3.733 MALAYSIAGO 280615  | 3,300,000.00 | 3,210,140.53 |    |

|                       |               |                          |                   |                                   |
|-----------------------|---------------|--------------------------|-------------------|-----------------------------------|
|                       |               | 3.8 MALAYSIAGOV 230817   | 3,900,000.00      | 3,890,251.78                      |
|                       |               | 3.899 MALAYSIAGOV 271116 | 3,800,000.00      | 3,743,744.04                      |
|                       |               | 3.9 MALAYSIAGOV 261130   | 2,920,000.00      | 2,890,084.01                      |
|                       |               | 3.955 MALAYSIAGOV 250915 | 4,400,000.00      | 4,396,028.56                      |
|                       |               | 4.059 MALAYSIAGOV 240930 | 3,100,000.00      | 3,121,551.20                      |
|                       |               | 4.16 MALAYSIAGOV 210715  | 3,200,000.00      | 3,239,548.48                      |
|                       |               | 4.181 MALAYSIAGOV 240715 | 1,600,000.00      | 1,621,465.60                      |
|                       |               | 4.369 MALAYSIA IN 281031 | 2,700,000.00      | 2,737,834.02                      |
|                       |               | 4.762 MALAYSIAGOV 370407 | 2,600,000.00      | 2,660,525.66                      |
| マレーシアリングット合計          |               |                          | 40,920,000.00     | 40,922,519.96<br>(1,088,948,256)  |
| タイバーツ                 | 国債証券          | 1.875 THAILAND 220617    | 39,700,000.00     | 39,658,422.58                     |
|                       |               | 2 THAILAND 221217        | 31,800,000.00     | 31,823,185.38                     |
|                       |               | 2.125 THAILAND 261217    | 46,400,000.00     | 45,730,228.06                     |
|                       |               | 2.4 THAILAND 231217      | 8,600,000.00      | 8,722,402.94                      |
|                       |               | 2.55 THAILAND 200626     | 17,500,000.00     | 17,692,913.00                     |
|                       |               | 2.875 THAILAND 460617    | 27,100,000.00     | 25,351,463.82                     |
|                       |               | 3.4 THAILAND 360617      | 35,700,000.00     | 37,548,556.71                     |
|                       |               | 3.625 THAILAND 230616    | 42,400,000.00     | 45,178,505.92                     |
|                       |               | 3.65 THAILAND 211217     | 58,200,000.00     | 61,185,817.14                     |
|                       |               | 3.65 THAILAND 310620     | 36,200,000.00     | 39,766,369.70                     |
|                       |               | 3.775 THAILAND 320625    | 33,000,000.00     | 36,591,957.60                     |
|                       |               | 3.85 THAILAND 251212     | 40,500,000.00     | 44,569,638.45                     |
| 4.875 THAILAND 290622 | 43,900,000.00 | 53,194,007.54            |                   |                                   |
| タイバーツ合計               |               |                          | 461,000,000.00    | 487,013,468.84<br>(1,689,936,736) |
| フィリピンペソ               | 国債証券          | 4.95 PHILIPPI(GL) 210115 | 10,000,000.00     | 10,026,200.00                     |
|                       |               | 6.25 PHILIPPI(GL) 360114 | 20,000,000.00     | 20,600,000.00                     |
| フィリピンペソ合計             |               |                          | 30,000,000.00     | 30,626,200.00<br>(63,702,496)     |
| インドネシアルピア             | 国債証券          | 10.5 INDONESIA 300815    | 4,550,000,000.00  | 5,318,614,210.00                  |
|                       |               | 11 INDONESIA 201115      | 2,740,000,000.00  | 2,917,495,282.00                  |
|                       |               | 11 INDONESIA 250915      | 3,450,000,000.00  | 3,960,843,570.00                  |
|                       |               | 12.8 INDONESIA 210615    | 3,190,000,000.00  | 3,550,552,940.00                  |
|                       |               | 5.625 INDONESIA 230515   | 20,500,000,000.00 | 18,865,125,000.00                 |
|                       |               | 6.125 INDONESIA 280515   | 15,100,000,000.00 | 13,137,000,000.00                 |
|                       |               | 6.625 INDONESIA 330515   | 15,200,000,000.00 | 12,844,000,000.00                 |
|                       |               | 7 INDONESIA 220515       | 14,850,000,000.00 | 14,587,486,897.00                 |
|                       |               | 7 INDONESIA 270515       | 18,450,000,000.00 | 17,130,825,000.00                 |
|                       |               | 7.5 INDONESIA 320815     | 8,900,000,000.00  | 8,154,625,000.00                  |
|                       |               | 7.5 INDONESIA 380515     | 11,100,000,000.00 | 10,148,841,000.00                 |
|                       |               | 8.25 INDONESIA 210715    | 18,400,000,000.00 | 18,653,000,000.00                 |



|                          |               |                          |                    |                    |                 |
|--------------------------|---------------|--------------------------|--------------------|--------------------|-----------------|
|                          |               | 8.25 INDONESIA 320615    | 7,000,000,000.00   | 6,880,053,250.00   |                 |
|                          |               | 8.25 INDONESIA 360515    | 12,900,000,000.00  | 12,629,100,000.00  |                 |
|                          |               | 8.375 INDONESIA 240315   | 24,400,000,000.00  | 24,796,500,000.00  |                 |
|                          |               | 8.375 INDONESIA 260915   | 18,130,000,000.00  | 18,390,934,212.00  |                 |
|                          |               | 8.375 INDONESIA 340315   | 13,700,000,000.00  | 13,648,886,259.00  |                 |
|                          |               | 8.75 INDONESIA 310515    | 10,800,000,000.00  | 11,037,825,720.00  |                 |
|                          |               | 9 INDONESIA 290315       | 15,500,000,000.00  | 16,325,218,450.00  |                 |
|                          |               | 9.5 INDONESIA 310715     | 3,150,000,000.00   | 3,409,119,000.00   |                 |
| インドネシアルピア合計              |               |                          | 242,010,000,000.00 | 236,386,045,790.00 | (1,843,811,157) |
| アルゼンチンペソ                 | 国債証券          | 15.5 REPUBLIC OF 261017  | 18,500,000.00      | 16,233,750.00      |                 |
|                          |               | 16 REPUBLIC OF AR 231017 | 17,000,000.00      | 16,065,000.00      |                 |
|                          |               | 18.2 REPUBLIC OF 211003  | 12,000,000.00      | 10,560,000.00      |                 |
| アルゼンチンペソ合計               |               |                          | 47,500,000.00      | 42,858,750.00      | (126,433,312)   |
| メキシコペソ                   | 国債証券          | 10 MEXICAN BONOS 241205  | 37,400,000.00      | 40,405,090.00      |                 |
|                          |               | 10 MEXICAN BONOS 361120  | 9,000,000.00       | 10,089,630.00      |                 |
|                          |               | 5.75 MEXICAN BONO 260305 | 31,700,000.00      | 27,345,371.00      |                 |
|                          |               | 6.5 MEXICAN BONOS 210610 | 36,900,000.00      | 35,570,862.00      |                 |
|                          |               | 6.5 MEXICAN BONOS 220609 | 36,700,000.00      | 34,876,744.00      |                 |
|                          |               | 7.25 MEXICAN BONO 211209 | 13,000,000.00      | 12,679,876.04      |                 |
|                          |               | 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 38,700,000.00      | 36,623,745.00      |                 |
|                          |               | 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 18,400,000.00      | 17,259,568.00      |                 |
|                          |               | 7.75 MEXICAN BONO 341123 | 18,800,000.00      | 17,364,432.00      |                 |
|                          |               | 7.75 MEXICAN BONO 421113 | 29,400,000.00      | 26,567,016.00      |                 |
|                          |               | 8 MEXICAN BONOS 200611   | 34,000,000.00      | 33,902,080.00      |                 |
|                          |               | 8 MEXICAN BONOS 231207   | 25,000,000.00      | 24,791,750.00      |                 |
|                          |               | 8 MEXICAN BONOS 471107   | 10,500,000.00      | 9,705,715.21       |                 |
|                          |               | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 12,600,000.00      | 12,628,350.00      |                 |
| 8.5 MEXICAN BONOS 381118 | 14,400,000.00 | 14,119,776.00            |                    |                    |                 |
| メキシコペソ合計                 |               |                          | 366,500,000.00     | 353,930,005.25     | (2,038,636,830) |
| ブラジルレアル                  | 国債証券          | 10 (IN)BRAZIL NT 270101  | 6,870,000.00       | 7,308,606.90       |                 |
|                          |               | 10 (IN)BRAZIL NTN 250101 | 6,600,000.00       | 7,019,309.88       |                 |
|                          |               | 10(IN) BRAZIL NTN 290101 | 1,000,000.00       | 1,066,988.20       |                 |
|                          |               | 10(IN)BRAZIL NTN-F210101 | 9,600,000.00       | 10,121,119.68      |                 |
|                          |               | 10(IN)BRAZIL NTN-F230101 | 12,900,000.00      | 13,701,162.24      |                 |
|                          |               | BRAZIL-LTN 200401        | 3,700,000.00       | 3,431,340.91       |                 |
|                          |               | BRAZIL-LTN 200701        | 13,900,000.00      | 12,661,444.36      |                 |
|                          |               | BRAZIL-LTN 210701        | 9,500,000.00       | 7,966,782.80       |                 |
|                          |               | BRAZIL-LTN 220101        | 8,700,000.00       | 6,967,265.37       |                 |
|                          |               |                          | 72,770,000.00      | 70,244,020.34      |                 |

|                          |                  |                           |                   |                                      |
|--------------------------|------------------|---------------------------|-------------------|--------------------------------------|
| ブラジルリアル合計                |                  |                           |                   | (2,036,374,149)                      |
| チリペソ                     | 国債証券             | 5.5 CHILE (GL) 200805     | 3,110,000,000.00  | 3,200,357,318.00                     |
| チリペソ合計                   |                  |                           | 3,110,000,000.00  | 3,200,357,318.00<br>(524,218,528)    |
| チェココルナ                   | 国債証券             | 0 CZECH REPUBLIC 200210   | 5,000,000.00      | 4,903,221.80                         |
|                          |                  | 0.25 CZECH REPUB 270210   | 11,500,000.00     | 10,166,195.50                        |
|                          |                  | 0.95 CZECH REPUB 300515   | 13,000,000.00     | 11,531,000.00                        |
|                          |                  | 1 CZECH REPUBLIC 260626   | 8,700,000.00      | 8,216,427.90                         |
|                          |                  | 2.4 CZECH REPUBLI 250917  | 24,800,000.00     | 25,931,500.00                        |
|                          |                  | 2.5 CZECH REPUBLI 280825  | 21,900,000.00     | 23,242,470.00                        |
|                          |                  | 3.75 CZECH REPUB 200912   | 17,600,000.00     | 18,193,912.00                        |
|                          |                  | 3.85 CZECH REPUB 210929   | 17,600,000.00     | 18,619,920.00                        |
|                          |                  | 4.7 CZECH REPUBLI 220912  | 13,400,000.00     | 14,827,770.00                        |
|                          |                  | 5.7 CZECH REPUBLI 240525  | 20,500,000.00     | 24,881,875.00                        |
| チェココルナ合計                 |                  |                           | 154,000,000.00    | 160,514,292.20<br>(780,099,460)      |
| コロンビアペソ                  | 国債証券             | 10 TITULOS DE TES 240724  | 6,200,000,000.00  | 7,284,337,220.00                     |
|                          |                  | 11 TITULOS DE TES 200724  | 4,020,000,000.00  | 4,372,644,450.00                     |
|                          |                  | 4.375 COLOMBI (GL) 230321 | 1,680,000,000.00  | 1,597,192,934.40                     |
|                          |                  | 6 TITULOS DE TESO 280428  | 3,050,000,000.00  | 2,888,516,225.00                     |
|                          |                  | 6.25 TITULOS DE T 251126  | 1,800,000,000.00  | 1,784,278,836.00                     |
|                          |                  | 7 TITULOS DE TESO 220504  | 3,710,000,000.00  | 3,878,622,839.00                     |
|                          |                  | 7 TITULOS DE TESO 320630  | 3,700,000,000.00  | 3,654,832,176.00                     |
|                          |                  | 7.5 TITULOS DE TE 260826  | 7,770,000,000.00  | 8,201,705,862.00                     |
|                          |                  | 7.75 COLOMBI (GL) 210414  | 1,000,000,000.00  | 1,041,350,000.00                     |
|                          |                  | 7.75 TITULOS DE T 300918  | 3,820,000,000.00  | 4,035,954,532.00                     |
| 9.85 COLOMBI (GL) 270628 | 1,290,000,000.00 | 1,584,184,500.00          |                   |                                      |
| コロンビアペソ合計                |                  |                           | 38,040,000,000.00 | 40,323,619,574.40<br>(1,399,229,599) |
| ハンガリーフォロント               | 国債証券             | 0.5 HUNGARY 210421        | 132,000,000.00    | 130,421,280.00                       |
|                          |                  | 1 HUNGARY 200923          | 21,000,000.00     | 21,221,684.40                        |
|                          |                  | 1.75 HUNGARY 221026       | 242,000,000.00    | 243,384,240.00                       |
|                          |                  | 2.5 HUNGARY 211027        | 30,000,000.00     | 31,086,276.00                        |
|                          |                  | 2.75 HUNGARY 261222       | 100,000,000.00    | 100,136,550.00                       |
|                          |                  | 3 HUNGARY 240626          | 174,000,000.00    | 181,841,901.60                       |
|                          |                  | 3 HUNGARY 271027          | 242,000,000.00    | 245,408,376.40                       |
|                          |                  | 3.5 HUNGARY 200624        | 214,000,000.00    | 223,090,827.00                       |
|                          |                  | 5.5 HUNGARY 250624        | 265,000,000.00    | 312,872,250.00                       |
|                          |                  | 6 HUNGARY 231124          | 214,000,000.00    | 256,024,763.60                       |
|                          |                  | 6.75 HUNGARY 281022       | 100,000,000.00    | 132,460,000.00                       |
|                          |                  | 7 HUNGARY 220624          | 254,500,000.00    | 300,500,875.00                       |
|                          |                  | 7.5 HUNGARY 201112        | 179,000,000.00    | 201,234,771.40                       |

|              |      |                          |                  |                                   |
|--------------|------|--------------------------|------------------|-----------------------------------|
| ハンガリーフォリント合計 |      |                          | 2,167,500,000.00 | 2,379,683,795.40<br>(934,501,826) |
| ペルーヌエボソル     | 国債証券 | 5.7 PERU 240812          | 2,000,000.00     | 2,081,107.60                      |
|              |      | 5.94 PERU 290212         | 2,300,000.00     | 2,358,551.33                      |
|              |      | 6.15 PERU 320812         | 2,400,000.00     | 2,445,463.20                      |
|              |      | 6.35 PERU 280812         | 2,900,000.00     | 3,062,197.29                      |
|              |      | 6.9 PERU 370812          | 2,100,000.00     | 2,260,342.77                      |
|              |      | 6.95 PERU 310812         | 3,000,000.00     | 3,268,382.40                      |
|              |      | 8.2 PERU 260812          | 2,900,000.00     | 3,416,629.20                      |
| ペルーヌエボソル合計   |      |                          | 17,600,000.00    | 18,892,673.79<br>(617,601,506)    |
| ポーランドズロチ     | 国債証券 | 1.5 POLAND 200425        | 5,300,000.00     | 5,314,999.00                      |
|              |      | 1.75 POLAND 210725       | 5,700,000.00     | 5,735,892.90                      |
|              |      | 2 POLAND 210425          | 4,900,000.00     | 4,961,740.00                      |
|              |      | 2.25 POLAND 220425       | 5,000,000.00     | 5,079,000.00                      |
|              |      | 2.5 POLAND 230125        | 5,400,000.00     | 5,517,649.80                      |
|              |      | 2.5 POLAND 240425        | 1,400,000.00     | 1,419,180.00                      |
|              |      | 2.5 POLAND 260725        | 5,900,000.00     | 5,852,977.00                      |
|              |      | 2.5 POLAND 270725        | 4,900,000.00     | 4,819,816.40                      |
|              |      | 2.75 POLAND 280425       | 4,300,000.00     | 4,278,242.00                      |
|              |      | 3.25 POLAND 250725       | 5,000,000.00     | 5,237,250.00                      |
|              |      | 4 POLAND 231025          | 4,200,000.00     | 4,557,210.00                      |
|              |      | 5.25 POLAND 201025       | 2,800,000.00     | 2,987,544.00                      |
|              |      | 5.75 POLAND 211025       | 2,500,000.00     | 2,777,575.00                      |
|              |      | 5.75 POLAND 220923       | 3,000,000.00     | 3,406,620.00                      |
| ポーランドズロチ合計   |      |                          | 60,300,000.00    | 61,945,696.10<br>(1,801,380,842)  |
| 南アフリカランド     | 国債証券 | 10.5 SOUTH AFRICA 261221 | 33,400,000.00    | 36,713,280.00                     |
|              |      | 6.25 SOUTH AFRICA 360331 | 17,300,000.00    | 12,535,012.90                     |
|              |      | 6.5 SOUTH AFRICA 410228  | 12,800,000.00    | 9,082,240.00                      |
|              |      | 6.75 SOUTH AFRICA 210331 | 6,500,000.00     | 6,460,350.00                      |
|              |      | 7 SOUTH AFRICA 310228    | 19,300,000.00    | 16,072,364.50                     |
|              |      | 7.75 SOUTH AFRICA 230228 | 13,900,000.00    | 13,848,083.50                     |
|              |      | 8 SOUTH AFRICA 300131    | 19,200,000.00    | 17,607,995.32                     |
|              |      | 8.25 SOUTH AFRICA 320331 | 15,000,000.00    | 13,668,666.14                     |
|              |      | 8.5 SOUTH AFRICA 370131  | 18,400,000.00    | 16,589,812.78                     |
|              |      | 8.75 SOUTH AFRICA 440131 | 21,000,000.00    | 19,014,745.68                     |
|              |      | 8.75 SOUTH AFRICA 480228 | 35,700,000.00    | 32,312,070.00                     |
|              |      | 8.875 SOUTH AFRIC 350228 | 11,500,000.00    | 10,818,370.26                     |
|              |      | 9 SOUTH AFRICA 400131    | 11,000,000.00    | 10,284,582.44                     |
| 南アフリカランド合計   |      |                          | 235,000,000.00   | 215,007,573.52<br>(1,728,660,891) |

|                       |               |                          |                |                |                 |
|-----------------------|---------------|--------------------------|----------------|----------------|-----------------|
| ウルグアイ<br>ペソ           | 国債証券          | 8.5 URUGUAY(GL) 280315   | 5,000,000.00   | 4,400,000.00   |                 |
|                       |               | 9.875 URUGUAY(GL) 220620 | 8,200,000.00   | 8,225,625.00   |                 |
| ウルグアイペソ合計             |               |                          | 13,200,000.00  | 12,625,625.00  | (42,422,100)    |
| ロシア<br>ルーブル           | 国債証券          | 6.4 RUSSIA OFZ 200527    | 42,700,000.00  | 42,015,946.00  |                 |
|                       |               | 7 RUSSIA GOVT 230125     | 36,500,000.00  | 35,364,704.00  |                 |
|                       |               | 7 RUSSIA GOVT BON 230816 | 62,000,000.00  | 59,706,620.00  |                 |
|                       |               | 7 RUSSIA OFZ 211215      | 76,000,000.00  | 74,540,800.00  |                 |
|                       |               | 7.05 RUSSIA GOVT 280119  | 60,000,000.00  | 55,920,000.00  |                 |
|                       |               | 7.1 RUSSIA OFZ 241016    | 107,900,000.00 | 103,488,508.50 |                 |
|                       |               | 7.25 RUSSIA OFZ 340510   | 25,200,000.00  | 23,007,348.00  |                 |
|                       |               | 7.4 RUSSIA OFZ 221207    | 61,700,000.00  | 60,793,010.00  |                 |
|                       |               | 7.5 RUSSIA OFZ 210818    | 61,900,000.00  | 61,497,959.50  |                 |
|                       |               | 7.6 RUSSIA GOVT 210414   | 31,200,000.00  | 31,158,348.00  |                 |
|                       |               | 7.6 RUSSIA GOVT 220720   | 31,000,000.00  | 30,749,210.00  |                 |
|                       |               | 7.7 RUSSIA OFZ 330323    | 95,700,000.00  | 91,679,164.50  |                 |
|                       |               | 7.75 RUSSIA OFZ 260916   | 78,200,000.00  | 76,823,680.00  |                 |
|                       |               | 8.15 RUSSIA GOVT 270203  | 74,500,000.00  | 74,664,645.00  |                 |
| 8.5 RUSSIA OFZ 310917 | 52,200,000.00 | 53,487,774.00            |                |                |                 |
| ロシアルーブル合計             |               |                          | 896,700,000.00 | 874,897,717.50 | (1,452,330,211) |
| ドミニカ<br>ペソ            | 国債証券          | 8.9 DOMINICAN 230215     | 8,000,000.00   | 7,760,000.00   |                 |
| ドミニカペソ合計              |               |                          | 8,000,000.00   | 7,760,000.00   | (16,761,600)    |
| ルーマニ<br>アレイ           | 国債証券          | 3.4 ROMANIA GOVER 220308 | 1,200,000.00   | 1,164,132.00   |                 |
|                       |               | 3.5 ROMANIA GOVER 221219 | 3,200,000.00   | 3,077,040.00   |                 |
|                       |               | 4.75 ROMANIA GOVE 250224 | 3,800,000.00   | 3,753,032.00   |                 |
|                       |               | 5.75 ROMANIA GOVE 200429 | 3,600,000.00   | 3,698,262.00   |                 |
|                       |               | 5.8 ROMANIA GOV 270726   | 2,100,000.00   | 2,186,950.50   |                 |
|                       |               | 5.85 ROMANIA GOVE 230426 | 2,900,000.00   | 3,021,481.00   |                 |
|                       |               | 5.95 ROMANIA 210611      | 5,200,000.00   | 5,407,688.00   |                 |
| ルーマニアレイ合計             |               |                          | 22,000,000.00  | 22,308,585.50  | (585,600,369)   |
| トルコリ<br>ラ             | 国債証券          | 10.4 TURKEY GOVT 240320  | 1,000,000.00   | 808,000.00     |                 |
|                       |               | 10.5 TURKEY GOVT 270811  | 3,800,000.00   | 2,979,200.00   |                 |
|                       |               | 10.6 TURKEY GOVT 260211  | 4,100,000.00   | 3,291,070.00   |                 |
|                       |               | 10.7 TURKEY GOVT 210217  | 3,900,000.00   | 3,439,800.00   |                 |
|                       |               | 10.7 TURKEY GOVT 220817  | 3,800,000.00   | 3,186,300.00   |                 |
|                       |               | 11 TURKEY GOVT 220302    | 2,900,000.00   | 2,482,400.00   |                 |
|                       |               | 11 TURKEY GOVT 270224    | 3,300,000.00   | 2,653,200.00   |                 |
|                       |               | 12.2 TURKEY GOVT 230118  | 2,100,000.00   | 1,841,700.00   |                 |
|                       |               | 12.4 TURKEY GOVT 280308  | 2,800,000.00   | 2,455,600.00   |                 |

|         |                         |               |                                    |  |
|---------|-------------------------|---------------|------------------------------------|--|
|         | 16.2 TURKEY GOVT 230614 | 2,300,000.00  | 2,302,300.00                       |  |
|         | 7.1 TURKEY GOVT 230308  | 3,900,000.00  | 2,847,000.00                       |  |
|         | 7.4 TURKEY GOVT 200205  | 2,000,000.00  | 1,795,000.00                       |  |
|         | 8 TURKEY GOVT 250312    | 3,400,000.00  | 2,404,820.00                       |  |
|         | 8.5 TURKEY GOVT 220914  | 3,400,000.00  | 2,692,800.00                       |  |
|         | 8.8 TURKEY GOVT 230927  | 2,700,000.00  | 2,072,250.00                       |  |
|         | 9 TURKEY GOVT 240724    | 3,100,000.00  | 2,357,240.00                       |  |
|         | 9.2 TURKEY GOVT 210922  | 3,600,000.00  | 3,020,400.00                       |  |
|         | 9.4 TURKEY GOVT 200708  | 2,800,000.00  | 2,487,800.00                       |  |
|         | 9.5 TURKEY GOVT 220112  | 2,300,000.00  | 1,895,200.00                       |  |
| トルコリラ合計 |                         | 57,200,000.00 | 47,012,080.00<br>(975,970,780)     |  |
| 合計      |                         |               | 19,746,620,648<br>(19,746,620,648) |  |

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

| 種類         | 銘柄数       | 組入債券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|------------|-----------|--------------|-------------------------|
| マレーシアリングット | 国債証券 13銘柄 | 100.00%      | 5.51%                   |
| タイバーツ      | 国債証券 13銘柄 | 100.00%      | 8.56%                   |
| フィリピンペソ    | 国債証券 2銘柄  | 100.00%      | 0.32%                   |
| インドネシアルピア  | 国債証券 20銘柄 | 100.00%      | 9.34%                   |
| アルゼンチンペソ   | 国債証券 3銘柄  | 100.00%      | 0.64%                   |
| メキシコペソ     | 国債証券 15銘柄 | 100.00%      | 10.32%                  |
| ブラジルリアル    | 国債証券 9銘柄  | 100.00%      | 10.31%                  |
| チリペソ       | 国債証券 1銘柄  | 100.00%      | 2.65%                   |
| チェココルナ     | 国債証券 10銘柄 | 100.00%      | 3.95%                   |
| コロンビアペソ    | 国債証券 11銘柄 | 100.00%      | 7.09%                   |
| ハンガリーフォリント | 国債証券 13銘柄 | 100.00%      | 4.73%                   |
| ペルーヌエボソル   | 国債証券 7銘柄  | 100.00%      | 3.13%                   |
| ポーランドズロチ   | 国債証券 14銘柄 | 100.00%      | 9.12%                   |
| 南アフリカランド   | 国債証券 13銘柄 | 100.00%      | 8.75%                   |
| ウルグアイペソ    | 国債証券 2銘柄  | 100.00%      | 0.21%                   |
| ロシアルーブル    | 国債証券 15銘柄 | 100.00%      | 7.35%                   |
| ドミニカペソ     | 国債証券 1銘柄  | 100.00%      | 0.08%                   |
| ルーマニアレイ    | 国債証券 7銘柄  | 100.00%      | 2.97%                   |
| トルコリラ      | 国債証券 19銘柄 | 100.00%      | 4.94%                   |

## 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）          |                |
|-----------------|----------------|
| [平成31年 1月28日現在] |                |
| <b>資産の部</b>     |                |
| 流動資産            |                |
| コール・ローン         | 259,700,314    |
| 投資証券            | 23,375,165,775 |
| 派生商品評価勘定        | 14,976,160     |
| 未収入金            | 287,808        |
| 未収配当金           | 191,684,316    |
| 差入委託証拠金         | 7,564,000      |
| 流動資産合計          | 23,849,378,373 |
| 資産合計            | 23,849,378,373 |
| <b>負債の部</b>     |                |
| 流動負債            |                |
| 派生商品評価勘定        | 18,240         |
| 前受金             | 13,270,400     |
| 未払解約金           | 43,195,173     |
| 未払利息            | 495            |
| その他未払費用         | 264            |
| 流動負債合計          | 56,484,572     |
| 負債合計            | 56,484,572     |
| <b>純資産の部</b>    |                |
| 元本等             |                |
| 元本              | 8,070,576,759  |
| 剰余金             |                |
| 剰余金又は欠損金（ ）     | 15,722,317,042 |
| 元本等合計           | 23,792,893,801 |
| 純資産合計           | 23,792,893,801 |
| 負債純資産合計         | 23,849,378,373 |

## 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）

|                             | [平成31年 1月28日現在] |
|-----------------------------|-----------------|
| 1. 期首                       | 平成30年 1月27日     |
| 期首元本額                       | 8,027,016,238円  |
| 期中追加設定元本額                   | 1,823,795,083円  |
| 期中一部解約元本額                   | 1,780,234,562円  |
| 元本の内訳                       |                 |
| eMAXIS 国内リートインデックス          | 3,720,559,990円  |
| eMAXIS バランス（8資産均等型）         | 1,192,556,358円  |
| eMAXIS バランス（波乗り型）           | 166,493,794円    |
| 三菱UFJ <DC>J-REITインデックスファンド  | 1,045,852円      |
| 三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金） | 154,123,650円    |
| J-REITインデックスファンド（ラップ向け）     | 1,348,375,312円  |
| オルタナティブ資産セレクション（ラップ向け）      | 199,933,015円    |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）    | 872,123,010円    |
| つみたて8資産均等バランス               | 240,006,693円    |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s       | 312,569円        |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s       | 471,224円        |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s       | 92,446円         |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）      | 5,515,399円      |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）    | 28,464,765円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）   | 6,289,579円      |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）   | 11,208,678円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）  | 52,607,383円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）     | 44,930,203円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）    | 20,512,702円     |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）  | 4,954,137円      |
| 合計                          | 8,070,576,759円  |
| 2. 受益権の総数                   | 8,070,576,759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 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日  |
|-----------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 |

|                          |  |
|--------------------------|--|
| 区分                       | 自 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日   |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。<br>当ファンドは、運用の効率化を図るために、不動産投信指数先物取引を利用してしております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。<br>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。<br>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。  |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

|                            |   |
|----------------------------|---|
| 区分                         | [平成31年 1月28日現在]   |
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。  |
| 2. 時価の算定方法                 | (1) 有価証券<br>売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。<br>(2) デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。<br>(3) 上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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   | [平成31年 1月28日現在]    |
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 投資証券 | 1,124,665,113      |
| 合計   | 1,124,665,113      |

(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

[平成31年 1月28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<br>買建 | 458,604,000 |       | 473,590,000 | 14,986,000 |
|      | 合計                | 458,604,000 |       | 473,590,000 | 14,986,000 |

## （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）

|              | [平成31年 1月28日現在] |
|--------------|-----------------|
| 1口当たり純資産額    | 2.9481円         |
| (1万口当たり純資産額) | (29,481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 | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 862 | 492,202,000 |    |

|                         |        |               |  |
|-------------------------|--------|---------------|--|
| MCUBS MidCity投資法人       | 2,922  | 264,733,200   |  |
| 森ヒルズリート投資法人             | 2,973  | 430,193,100   |  |
| 産業ファンド投資法人              | 3,021  | 356,780,100   |  |
| アドバンス・レジデンス投資法人         | 2,527  | 827,592,500   |  |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 1,538  | 278,378,000   |  |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人      | 1,362  | 638,097,000   |  |
| GLP投資法人                 | 6,424  | 715,633,600   |  |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人      | 989    | 294,722,000   |  |
| 日本プロロジスリート投資法人          | 3,478  | 806,896,000   |  |
| 星野リゾート・リート投資法人          | 394    | 210,396,000   |  |
| Oneリート投資法人              | 378    | 103,005,000   |  |
| イオンリート投資法人              | 2,661  | 350,985,900   |  |
| ヒューリックリート投資法人           | 2,096  | 368,267,200   |  |
| 日本リート投資法人               | 837    | 318,060,000   |  |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人   | 15,368 | 251,574,160   |  |
| 日本ヘルスケア投資法人             | 119    | 20,349,000    |  |
| 積水ハウス・リート投資法人           | 6,689  | 496,323,800   |  |
| トーセイ・リート投資法人            | 499    | 56,536,700    |  |
| ケネディクス商業リート投資法人         | 950    | 245,100,000   |  |
| ヘルスケア&メディカル投資法人         | 343    | 40,885,600    |  |
| サムティ・レジデンシャル投資法人        | 519    | 48,630,300    |  |
| 野村不動産マスターファンド投資法人       | 7,684  | 1,175,652,000 |  |
| いちごホテルリート投資法人           | 453    | 63,873,000    |  |
| ラサールロジポート投資法人           | 1,956  | 210,661,200   |  |
| スターアジア不動産投資法人           | 805    | 88,469,500    |  |
| マリモ地方創生リート投資法人          | 223    | 23,950,200    |  |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人     | 443    | 158,594,000   |  |
| 大江戸温泉リート投資法人            | 418    | 34,652,200    |  |
| さくら総合リート投資法人            | 561    | 47,460,600    |  |
| 投資法人みらい                 | 698    | 133,736,800   |  |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人        | 608    | 82,262,400    |  |
| 三菱地所物流リート投資法人           | 274    | 68,445,200    |  |
| CREロジスティクスファンド投資法人      | 260    | 27,118,000    |  |
| ザイマックス・リート投資法人          | 239    | 27,485,000    |  |
| タカラレーベン不動産投資法人          | 388    | 35,773,600    |  |
| 伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人    | 401    | 35,648,900    |  |
| 日本ビルファンド投資法人            | 2,511  | 1,747,656,000 |  |
| ジャパンリアルエステイト投資法人        | 2,593  | 1,656,927,000 |  |
| 日本リテールファンド投資法人          | 4,900  | 1,078,000,000 |  |
| オリックス不動産投資法人            | 5,166  | 957,259,800   |  |
| 日本プライムリアルティ投資法人         | 1,641  | 722,860,500   |  |
| プレミア投資法人                | 2,465  | 327,105,500   |  |

|                        |         |                |  |
|------------------------|---------|----------------|--|
| 東急リアル・エステート投資法人        | 1,738   | 292,679,200    |  |
| グローバル・ワン不動産投資法人        | 1,658   | 204,763,000    |  |
| ユナイテッド・アーバン投資法人        | 5,718   | 970,916,400    |  |
| 森トラスト総合リート投資法人         | 1,853   | 316,492,400    |  |
| インヴィンシブル投資法人           | 9,073   | 427,791,950    |  |
| フロンティア不動産投資法人          | 882     | 393,813,000    |  |
| 平和不動産リート投資法人           | 1,615   | 193,961,500    |  |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人      | 1,711   | 397,636,400    |  |
| 福岡リート投資法人              | 1,341   | 224,885,700    |  |
| ケネディクス・オフィス投資法人        | 802     | 595,084,000    |  |
| いちごオフィスリート投資法人         | 2,151   | 213,809,400    |  |
| 大和証券オフィス投資法人           | 598     | 428,168,000    |  |
| 阪急阪神リート投資法人            | 1,166   | 166,738,000    |  |
| スタートアップリート投資法人         | 409     | 70,266,200     |  |
| 大和ハウスリート投資法人           | 3,246   | 818,965,800    |  |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人       | 8,345   | 696,807,500    |  |
| 日本賃貸住宅投資法人             | 2,916   | 253,400,400    |  |
| ジャパンエクセレント投資法人         | 2,322   | 358,052,400    |  |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人（新）  | 8       | 2,344,400      |  |
| ヘルスケア&メディカル投資法人（新）     | 119     | 13,815,900     |  |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人（新） | 45      | 15,841,665     |  |
| 合計                     | 139,352 | 23,375,165,775 |  |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

## MUAM G-REITマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

[平成31年 1月28日現在]

|          |                |
|----------|----------------|
| 資産の部     |                |
| 流動資産     |                |
| 預金       | 212,241,058    |
| コール・ローン  | 15,111,309     |
| 投資証券     | 21,483,220,483 |
| 派生商品評価勘定 | 67,490         |
| 未収入金     | 130,467        |
| 未収配当金    | 32,826,912     |

[平成31年 1月28日現在]

|             |                |
|-------------|----------------|
| 流動資産合計      | 21,743,597,719 |
| 資産合計        | 21,743,597,719 |
| 負債の部        |                |
| 流動負債        |                |
| 派生商品評価勘定    | 297            |
| 未払解約金       | 23,978,585     |
| 未払利息        | 28             |
| その他未払費用     | 36             |
| 流動負債合計      | 23,978,946     |
| 負債合計        | 23,978,946     |
| 純資産の部       |                |
| 元本等         |                |
| 元本          | 13,296,026,449 |
| 剰余金         |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 8,423,592,324  |
| 元本等合計       | 21,719,618,773 |
| 純資産合計       | 21,719,618,773 |
| 負債純資産合計     | 21,743,597,719 |

## 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      | 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本となる重要な事項 | 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

|                           | [平成31年 1月28日現在] |
|---------------------------|-----------------|
| 1. 期首                     | 平成30年 1月27日     |
| 期首元本額                     | 11,593,498,620円 |
| 期中追加設定元本額                 | 2,974,370,713円  |
| 期中一部解約元本額                 | 1,271,842,884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) | 165,461,350円    |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)    | 115,484,933円    |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド(分配型)       | 31,021,295円     |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド(バランス型)     | 59,083,764円     |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド(株式重視型)     | 25,387,367円     |
| ファンド・マネジャー(海外リート)         | 45,390,136円     |
| eMAXIS 先進国リートインデックス       | 5,351,927,720円  |
| eMAXIS バランス(8資産均等型)       | 2,183,405,715円  |

|                             | [平成31年 1月28日現在] |
|-----------------------------|-----------------|
| eMAXIS バランス（波乗り型）           | 302,208,206円    |
| 三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド | 1,835,768,044円  |
| 三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金） | 286,739,034円    |
| オルタナティブ資産セレクション（ラップ向け）      | 431,151,916円    |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）    | 1,584,124,198円  |
| つみたて8資産均等バランス               | 433,779,432円    |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s       | 842,557円        |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s       | 1,081,252円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s       | 333,985円        |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）      | 11,558,325円     |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）    | 50,339,632円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）   | 16,988,146円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）   | 30,270,661円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）  | 142,230,726円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）     | 108,260,683円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）    | 73,970,467円     |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）  | 9,216,905円      |
| 合計                          | 13,296,026,449円 |
| 2. 受益権の総数                   | 13,296,026,449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 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日  |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。   |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |

|                  |  |
|------------------|--|
| 区分               | 自 平成30年 1月27日<br>至 平成31年 1月28日   |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

|                           |  |
|---------------------------|--|
| 区分                        | [平成31年 1月28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<br/>         売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引<br/>         デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品<br/>         上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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   | [平成31年 1月28日現在]    |
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 投資証券 | 1,533,672,133      |
| 合計   | 1,533,672,133      |

(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

[平成31年 1月28日現在]

| 区分        | 種類           | 契約額等（円）    |       | 時価（円）      | 評価損益（円） |
|-----------|--------------|------------|-------|------------|---------|
|           |              |            | うち1年超 |            |         |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引<br>買建 |            |       |            |         |
|           | アメリカドル       | 18,039,747 |       | 18,039,450 | 297     |
|           | 売建           |            |       |            |         |
|           | アメリカドル       | 18,655,290 |       | 18,587,800 | 67,490  |
|           | 合計           | 36,695,037 |       | 36,627,250 | 67,193  |

## （注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

|              | [平成31年 1月28日現在] |
|--------------|-----------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.6335円         |
| (1万口当たり純資産額) | (16,335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 |
|----|------|---------------------|--------|------------|----|
|    | 投資証券 | ACADIA REALTY TRUST | 13,632 | 370,517.76 |    |

アメリカ  
ドル

|                              |        |              |
|------------------------------|--------|--------------|
| AGREE REALTY CORP            | 6,174  | 388,344.60   |
| ALEXANDER'S INC              | 654    | 209,201.52   |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 18,707 | 2,346,044.87 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC    | 6,560  | 271,256.00   |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES  | 23,503 | 1,049,879.01 |
| AMERICAN FINANCE TRUST INC   | 9,000  | 117,180.00   |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A     | 44,886 | 964,600.14   |
| AMERICOLD REALTY TRUST       | 10,671 | 298,041.03   |
| APARTMENT INVT & MGMT CO -A  | 26,784 | 1,286,703.36 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC   | 37,241 | 584,311.29   |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST    | 15,040 | 70,838.40    |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 24,031 | 4,485,386.15 |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH  | 3,512  | 36,103.36    |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 26,825 | 3,312,351.00 |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 4,550  | 46,501.00    |
| BRANDYWINE REALTY TRUST      | 31,073 | 462,366.24   |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC   | 51,125 | 843,562.50   |
| BRT APARTMENTS CORP          | 2,200  | 28,270.00    |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 16,163 | 1,511,563.76 |
| CARETRUST REIT INC           | 15,283 | 323,235.45   |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES  | 31,483 | 73,985.05    |
| CEDAR REALTY TRUST INC       | 17,360 | 59,024.00    |
| CHATHAM LODGING TRUST        | 7,900  | 155,314.00   |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST     | 10,510 | 286,923.00   |
| CITY OFFICE REIT INC         | 6,040  | 67,829.20    |
| CLIPPER REALTY INC           | 2,958  | 39,134.34    |
| COLONY CAPITAL INC           | 86,432 | 484,883.52   |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC  | 20,211 | 428,877.42   |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 2,800  | 89,152.00    |
| CORECIVIC INC                | 19,865 | 380,812.05   |
| CORESITE REALTY CORP         | 6,476  | 610,039.20   |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES  | 18,685 | 450,869.05   |
| COUSINS PROPERTIES INC       | 73,976 | 636,933.36   |
| CUBESMART                    | 32,619 | 961,608.12   |
| CYRUSONE INC                 | 18,575 | 928,192.75   |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO   | 35,128 | 347,064.64   |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 35,847 | 3,734,181.99 |
| DOUGLAS EMMETT INC           | 28,353 | 1,042,539.81 |
| DUKE REALTY CORP             | 62,135 | 1,799,429.60 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 10,924 | 191,060.76   |
| EASTGROUP PROPERTIES INC     | 6,202  | 618,215.36   |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A  | 25,151 | 375,252.92   |



|                              |         |              |
|------------------------------|---------|--------------|
| EPR PROPERTIES               | 12,962  | 923,931.36   |
| EQUITY COMMONWEALTH          | 21,571  | 677,976.53   |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 15,694  | 1,601,886.58 |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 64,052  | 4,526,554.84 |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY  | 5,700   | 87,039.00    |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 11,484  | 3,018,224.88 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 21,861  | 2,036,352.15 |
| FARMLAND PARTNERS INC        | 4,300   | 23,951.00    |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 12,918  | 1,659,446.28 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR   | 22,020  | 701,116.80   |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST  | 11,749  | 318,280.41   |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 19,570  | 139,925.50   |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP  | 8,600   | 88,838.00    |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 34,946  | 1,274,131.16 |
| GEO GROUP INC/THE            | 20,502  | 453,914.28   |
| GETTY REALTY CORP            | 5,857   | 181,625.57   |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP    | 4,490   | 88,183.60    |
| GLADSTONE LAND CORP          | 2,561   | 29,374.67    |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC      | 3,461   | 33,329.43    |
| GLOBAL NET LEASE INC         | 13,358  | 264,621.98   |
| HCP INC                      | 83,000  | 2,520,710.00 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC  | 22,093  | 693,499.27   |
| HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A | 36,264  | 996,897.36   |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST     | 5,987   | 108,484.44   |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC     | 18,099  | 792,374.22   |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 28,786  | 740,951.64   |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 129,697 | 2,268,400.53 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 26,907  | 842,189.10   |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 17,614  | 180,543.50   |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT | 11,695  | 238,227.15   |
| INFREIT INC                  | 6,453   | 135,706.59   |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 1,800   | 107,892.00   |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST  | 2,215   | 126,919.50   |
| INVITATION HOMES INC         | 52,126  | 1,126,442.86 |
| IRON MOUNTAIN INC            | 49,802  | 1,795,362.10 |
| JBG SMITH PROPERTIES         | 19,051  | 723,747.49   |
| KILROY REALTY CORP           | 17,549  | 1,203,159.44 |
| KIMCO REALTY CORP            | 73,469  | 1,226,932.30 |
| KITE REALTY GROUP TRUST      | 14,602  | 231,587.72   |
| LEXINGTON REALTY TRUST       | 37,741  | 349,104.25   |
| LIBERTY PROPERTY TRUST       | 25,751  | 1,174,760.62 |
| LIFE STORAGE INC             | 8,173   | 775,045.59   |
| LTC PROPERTIES INC           | 6,740   | 305,456.80   |

|                              |         |              |
|------------------------------|---------|--------------|
| MACERICH CO/THE              | 18,608  | 858,573.12   |
| MACK-CALI REALTY CORP        | 16,322  | 327,745.76   |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV  | 214,120 | 179,860.80   |
| MEDEQUITIES REALTY TRUST INC | 5,766   | 64,117.92    |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 63,035  | 1,105,633.90 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 19,707  | 1,991,786.49 |
| MONMOUTH REAL ESTATE INV COR | 15,576  | 207,005.04   |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | 27,582  | 1,402,268.88 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES  | 9,719   | 265,523.08   |
| NATL HEALTH INVESTORS INC    | 7,300   | 585,533.00   |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP  | 11,900  | 58,667.00    |
| NEXPOINT RESIDENTIAL         | 3,750   | 134,250.00   |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 8,757   | 142,301.25   |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRU | 8,787   | 278,811.51   |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   | 34,900  | 1,358,308.00 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC   | 2,310   | 63,247.80    |
| PARAMOUNT GROUP INC          | 34,266  | 478,353.36   |
| PARK HOTELS & RESORTS INC    | 35,420  | 1,019,741.80 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST      | 22,256  | 675,914.72   |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST  | 12,160  | 90,348.80    |
| PHYSICIANS REALTY TRUST      | 31,357  | 540,908.25   |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 23,004  | 432,245.16   |
| PREFERRED APARTMENT COMMUN-A | 6,800   | 108,732.00   |
| PROLOGIS INC                 | 109,472 | 7,226,246.72 |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA     | 3,372   | 473,496.24   |
| PUBLIC STORAGE               | 26,091  | 5,365,353.24 |
| QTS REALTY TRUST INC-CL A    | 9,069   | 359,223.09   |
| REALTY INCOME CORP           | 51,300  | 3,345,786.00 |
| REGENCY CENTERS CORP         | 29,569  | 1,855,454.75 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 20,701  | 357,506.27   |
| RETAIL PROPERTIES OF AME - A | 37,051  | 443,500.47   |
| RETAIL VALUE INC             | 2,393   | 72,914.71    |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 16,445  | 544,658.40   |
| RLJ LODGING TRUST            | 31,014  | 564,454.80   |
| RPT REALTY                   | 13,160  | 168,448.00   |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 9,062   | 694,874.16   |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC   | 31,633  | 631,711.01   |
| SAFETY INCOME & GROWTH INC   | 1,900   | 31,540.00    |
| SAUL CENTERS INC             | 2,060   | 108,768.00   |
| SENIOR HOUSING PROP TRUST    | 41,850  | 544,050.00   |
| SERITAGE GROWTH PROP- A REIT | 4,480   | 178,483.20   |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 53,808  | 9,529,934.88 |

|          |      |                              |           |                                    |
|----------|------|------------------------------|-----------|------------------------------------|
|          |      | SITE CENTERS CORP            | 26,268    | 336,755.76                         |
|          |      | SL GREEN REALTY CORP         | 14,725    | 1,313,911.75                       |
|          |      | SPIRIT MTA REIT              | 6,989     | 53,465.85                          |
|          |      | SPIRIT REALTY CAPITAL INC    | 14,578    | 557,608.50                         |
|          |      | STAG INDUSTRIAL INC          | 19,352    | 524,826.24                         |
|          |      | STORE CAPITAL CORP           | 32,996    | 1,010,007.56                       |
|          |      | SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC  | 18,050    | 194,037.50                         |
|          |      | SUN COMMUNITIES INC          | 15,000    | 1,584,750.00                       |
|          |      | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 38,857    | 541,666.58                         |
|          |      | TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 16,930    | 384,988.20                         |
|          |      | TAUBMAN CENTERS INC          | 10,406    | 516,449.78                         |
|          |      | TERRENO REALTY CORP          | 10,650    | 416,202.00                         |
|          |      | TIER REIT INC                | 9,665     | 215,142.90                         |
|          |      | UDR INC                      | 48,041    | 2,037,899.22                       |
|          |      | UMH PROPERTIES INC           | 6,024     | 77,408.40                          |
|          |      | UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 2,132     | 143,632.84                         |
|          |      | URBAN EDGE PROPERTIES        | 20,817    | 418,213.53                         |
|          |      | URSTADT BIDDLE - CLASS A     | 4,540     | 93,160.80                          |
|          |      | VENTAS INC                   | 62,003    | 3,870,847.29                       |
|          |      | VEREIT INC                   | 167,802   | 1,285,363.32                       |
|          |      | VICI PROPERTIES INC          | 62,534    | 1,341,354.30                       |
|          |      | VORNADO REALTY TRUST         | 30,206    | 1,999,637.20                       |
|          |      | WASHINGTON PRIME GROUP INC   | 34,596    | 189,932.04                         |
|          |      | WASHINGTON REIT              | 13,315    | 327,415.85                         |
|          |      | WEINGARTEN REALTY INVESTORS  | 20,504    | 561,809.60                         |
|          |      | WELLTOWER INC                | 65,331    | 4,895,905.14                       |
|          |      | WHITESTONE REIT              | 7,010     | 98,280.20                          |
|          |      | WP CAREY INC                 | 27,880    | 2,001,226.40                       |
|          |      | XENIA HOTELS & RESORTS INC   | 20,402    | 372,744.54                         |
| アメリカドル合計 |      |                              | 3,915,949 | 141,791,602.94<br>(15,504,911,781) |
| カナダドル    | 投資証券 | AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA | 2,100     | 29,904.00                          |
|          |      | ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 9,200     | 431,388.00                         |
|          |      | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 12,290    | 124,989.30                         |
|          |      | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 3,810     | 150,723.60                         |
|          |      | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 11,980    | 555,392.80                         |
|          |      | CHOICE PROPERTIES REIT       | 25,187    | 315,089.37                         |
|          |      | COMINAR REAL ESTATE INV-TR U | 14,470    | 172,048.30                         |
|          |      | CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 6,730     | 91,662.60                          |
|          |      | CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 8,500     | 106,165.00                         |
|          |      | DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV | 16,800    | 218,904.00                         |
|          |      | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 8,200     | 88,806.00                          |

|                  |        |                              |         |                               |
|------------------|--------|------------------------------|---------|-------------------------------|
|                  |        | DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | 5,310   | 123,457.50                    |
|                  |        | GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 3,900   | 229,944.00                    |
|                  |        | H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 25,009  | 553,949.35                    |
|                  |        | INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 8,000   | 109,040.00                    |
|                  |        | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 6,500   | 111,020.00                    |
|                  |        | MINTO APARTMENT REAL ESTATE  | 1,200   | 22,704.00                     |
|                  |        | MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 2,600   | 43,342.00                     |
|                  |        | NORTHVIEW APARTMENT REAL EST | 4,750   | 127,680.00                    |
|                  |        | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 8,100   | 86,346.00                     |
|                  |        | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 26,270  | 653,860.30                    |
|                  |        | SLATE OFFICE REIT            | 5,600   | 36,568.00                     |
|                  |        | SLATE RETAIL REIT - U        | 5,100   | 63,648.00                     |
|                  |        | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 11,900  | 394,961.00                    |
|                  |        | SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI | 10,400  | 108,056.00                    |
|                  |        | TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | 6,200   | 39,246.00                     |
| カナダドル合計          |        |                              | 250,106 | 4,988,895.12<br>(412,731,293) |
| オーストラリアドル        | 投資証券   | ABACUS PROPERTY GROUP        | 50,911  | 179,206.72                    |
|                  |        | ARENA REIT                   | 45,017  | 116,143.86                    |
|                  |        | BWP TRUST                    | 85,400  | 318,542.00                    |
|                  |        | CHARTER HALL EDUCATION TRUST | 39,561  | 125,012.76                    |
|                  |        | CHARTER HALL GROUP           | 82,461  | 662,986.44                    |
|                  |        | CHARTER HALL LONG WALE REIT  | 33,703  | 146,608.05                    |
|                  |        | CHARTER HALL RETAIL REIT     | 55,836  | 257,962.32                    |
|                  |        | CROMWELL PROPERTY GROUP      | 294,196 | 314,789.72                    |
|                  |        | DEXUS                        | 176,971 | 2,065,251.57                  |
|                  |        | GDI PROPERTY GROUP           | 75,226  | 103,435.75                    |
|                  |        | GOODMAN GROUP                | 280,221 | 3,329,025.48                  |
|                  |        | GPT GROUP                    | 311,450 | 1,784,608.50                  |
|                  |        | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 48,141  | 184,380.03                    |
|                  |        | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS   | 24,700  | 77,064.00                     |
|                  |        | INDUSTRIA REIT               | 11,950  | 33,340.50                     |
|                  |        | INGENIA COMMUNITIES GROUP    | 38,871  | 117,001.71                    |
|                  |        | MIRVAC GROUP                 | 649,011 | 1,544,646.18                  |
|                  |        | NATIONAL STORAGE REIT        | 119,273 | 214,095.03                    |
|                  |        | PROPERTYLINK GROUP           | 87,700  | 101,732.00                    |
|                  |        | RURAL FUNDS GROUP            | 57,545  | 127,174.45                    |
|                  |        | SCENTRE GROUP                | 922,179 | 3,679,494.21                  |
|                  |        | SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 153,446 | 389,752.84                    |
|                  |        | STOCKLAND                    | 426,942 | 1,635,187.86                  |
|                  |        | VICINITY CENTRES             | 562,982 | 1,475,012.84                  |
| VIVA ENERGY REIT | 73,240 | 164,790.00                   |         |                               |

|                             |         |                              |           |                                  |
|-----------------------------|---------|------------------------------|-----------|----------------------------------|
| オーストラリアドル合計                 |         |                              | 4,706,933 | 19,147,244.82<br>(1,504,207,553) |
| イギリス<br>ポンド                 | 投資証券    | ASSURA PLC                   | 438,539   | 247,335.99                       |
|                             |         | BIG YELLOW GROUP PLC         | 26,550    | 249,702.75                       |
|                             |         | BRITISH LAND CO PLC          | 167,422   | 957,988.68                       |
|                             |         | CAPITAL & REGIONAL PLC       | 75,688    | 20,776.35                        |
|                             |         | CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC   | 108,000   | 108,540.00                       |
|                             |         | DERWENT LONDON PLC           | 19,543    | 600,556.39                       |
|                             |         | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 86,400    | 79,747.20                        |
|                             |         | GREAT PORTLAND ESTATES PLC   | 47,512    | 345,222.19                       |
|                             |         | HAMMERSON PLC                | 136,582   | 487,734.32                       |
|                             |         | HANSTEEN HOLDINGS PLC        | 76,900    | 70,132.80                        |
|                             |         | INTU PROPERTIES PLC          | 160,375   | 179,620.00                       |
|                             |         | LAND SECURITIES GROUP PLC    | 130,727   | 1,115,885.67                     |
|                             |         | LONDONMETRIC PROPERTY PLC    | 124,544   | 226,420.99                       |
|                             |         | LXI REIT PLC                 | 65,000    | 79,300.00                        |
|                             |         | NEWRIVER REIT PLC            | 47,483    | 101,613.62                       |
|                             |         | PRIMARY HEALTH PROPERTIES    | 130,020   | 146,662.56                       |
|                             |         | RDI REIT PLC                 | 225,076   | 66,960.11                        |
|                             |         | REGIONAL REIT LTD            | 51,527    | 50,547.98                        |
|                             |         | SAFESTORE HOLDINGS PLC       | 37,563    | 209,038.09                       |
|                             |         | SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 99,320    | 54,427.36                        |
|                             |         | SEGRE PLC                    | 174,563   | 1,120,694.46                     |
|                             |         | SHAFTESBURY PLC              | 39,947    | 337,751.88                       |
|                             |         | TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING  | 68,500    | 70,555.00                        |
|                             |         | TRITAX BIG BOX REIT PLC      | 261,708   | 354,090.92                       |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | 107,400 | 94,297.20                    |           |                                  |
| UNITE GROUP PLC             | 46,330  | 416,275.05                   |           |                                  |
| WORKSPACE GROUP PLC         | 21,281  | 195,040.36                   |           |                                  |
| イギリスポンド合計                   |         |                              | 2,974,500 | 7,986,917.92<br>(1,152,911,601)  |
| 香港ドル                        | 投資証券    | CHAMPION REIT                | 328,000   | 1,889,280.00                     |
|                             |         | FORTUNE REIT                 | 239,000   | 2,349,370.00                     |
|                             |         | LINK REIT                    | 370,500   | 30,788,550.00                    |
|                             |         | PROSPERITY REIT              | 249,000   | 779,370.00                       |
|                             |         | SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST  | 163,000   | 876,940.00                       |
|                             |         | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN | 231,000   | 1,231,230.00                     |
| 香港ドル合計                      |         |                              | 1,580,500 | 37,914,740.00<br>(528,531,475)   |
| シンガ<br>ポールド<br>ル            | 投資証券    | AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL  | 120,700   | 166,566.00                       |
|                             |         | ASCENDAS HOSPITALITY TRUST   | 121,000   | 100,430.00                       |
|                             |         | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 442,500   | 1,199,175.00                     |

|                       |      |                              |           |                               |  |
|-----------------------|------|------------------------------|-----------|-------------------------------|--|
|                       |      | ASCOTT RESIDENCE TRUST       | 214,400   | 248,704.00                    |  |
|                       |      | CACHE LOGISTICS TRUST        | 169,000   | 126,750.00                    |  |
|                       |      | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST  | 476,300   | 904,970.00                    |  |
|                       |      | CAPITALAND MALL TRUST        | 484,800   | 1,144,128.00                  |  |
|                       |      | CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS | 97,800    | 138,876.00                    |  |
|                       |      | CDL HOSPITALITY TRUSTS       | 128,300   | 201,431.00                    |  |
|                       |      | ESR-REIT                     | 346,500   | 178,447.50                    |  |
|                       |      | FAR EAST HOSPITALITY TRUST   | 143,000   | 89,375.00                     |  |
|                       |      | FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | 94,200    | 97,968.00                     |  |
|                       |      | FRASERS CENTREPOINT TRUST    | 96,000    | 219,840.00                    |  |
|                       |      | FRASERS COMMERCIAL TRUST     | 106,100   | 151,723.00                    |  |
|                       |      | FRASERS HOSPITALITY TRUST    | 139,600   | 99,814.00                     |  |
|                       |      | FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI | 279,600   | 296,376.00                    |  |
|                       |      | KEPPEL DC REIT               | 171,000   | 253,080.00                    |  |
|                       |      | KEPPEL REIT                  | 330,400   | 389,872.00                    |  |
|                       |      | LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL | 281,200   | 61,864.00                     |  |
|                       |      | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST   | 340,300   | 602,331.00                    |  |
|                       |      | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST   | 212,500   | 431,375.00                    |  |
|                       |      | MAPLETREE LOGISTICS TRUST    | 420,100   | 583,939.00                    |  |
|                       |      | MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC | 361,500   | 444,645.00                    |  |
|                       |      | QUE HOSPITALITY TRUST        | 249,600   | 172,224.00                    |  |
|                       |      | PARKWAYLIFE REAL ESTATE      | 66,000    | 180,840.00                    |  |
|                       |      | SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 133,000   | 55,195.00                     |  |
|                       |      | SOILBUILD BUSINESS SPACE REI | 105,000   | 65,100.00                     |  |
|                       |      | SPH REIT                     | 105,700   | 107,814.00                    |  |
|                       |      | STARHILL GLOBAL REIT         | 232,000   | 165,880.00                    |  |
|                       |      | SUNTEC REIT                  | 399,600   | 771,228.00                    |  |
| シンガポールドル合計            |      |                              | 6,867,700 | 9,649,960.50<br>(780,199,306) |  |
| ニュー<br>ジーラ<br>ンドル     | 投資証券 | ARGOSY PROPERTY LTD          | 160,318   | 190,778.42                    |  |
|                       |      | GOODMAN PROPERTY TRUST       | 180,490   | 286,076.65                    |  |
|                       |      | KIWI PROPERTY GROUP LTD      | 247,350   | 346,290.00                    |  |
|                       |      | PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | 164,190   | 243,822.15                    |  |
|                       |      | STRIDE PROPERTY GROUP        | 69,340    | 131,746.00                    |  |
|                       |      | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR | 49,034    | 103,706.91                    |  |
| ニュージーラントドル合計          |      |                              | 870,722   | 1,302,420.13<br>(97,460,098)  |  |
| イスラ<br>エル<br>シェケ<br>ル | 投資証券 | REIT 1 LTD                   | 28,880    | 409,518.40                    |  |
| イスラエルシェケル合計           |      |                              | 28,880    | 409,518.40<br>(12,215,933)    |  |
| ユーロ                   | 投資証券 | AEDIFICA                     | 3,080     | 241,780.00                    |  |

|                              |         |                                    |  |
|------------------------------|---------|------------------------------------|--|
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG       | 27,872  | 360,942.40                         |  |
| ALTAREA                      | 575     | 103,500.00                         |  |
| BEFIMMO                      | 4,334   | 216,700.00                         |  |
| COFINIMMO                    | 3,800   | 429,020.00                         |  |
| COVIVIO                      | 10,981  | 963,582.75                         |  |
| EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV   | 7,712   | 215,010.56                         |  |
| GECINA SA                    | 9,512   | 1,161,415.20                       |  |
| GREEN REIT PLC               | 115,137 | 169,251.39                         |  |
| HAMBORNER REIT AG            | 13,230  | 121,716.00                         |  |
| HIBERNIA REIT PLC            | 128,423 | 168,234.13                         |  |
| ICADE                        | 7,681   | 555,336.30                         |  |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 8,678   | 53,361.02                          |  |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI | 48,083  | 426,255.79                         |  |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 3,406   | 71,526.00                          |  |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 67,300  | 98,931.00                          |  |
| KLEPIERRE                    | 35,676  | 1,021,760.64                       |  |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 14,680  | 119,054.80                         |  |
| MERCIALYS                    | 9,365   | 121,557.70                         |  |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA  | 62,348  | 723,548.54                         |  |
| MONTEA                       | 1,077   | 66,343.20                          |  |
| NSI NV                       | 3,168   | 116,740.80                         |  |
| RETAIL ESTATES               | 1,280   | 96,640.00                          |  |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    | 23,910  | 3,650,100.60                       |  |
| VASTNED RETAIL NV            | 2,476   | 79,727.20                          |  |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA       | 3,108   | 390,364.80                         |  |
| WERELDHAVE NV                | 6,941   | 200,941.95                         |  |
| ユーロ合計                        | 623,833 | 11,943,342.77<br>(1,490,051,443)   |  |
| 合計                           |         | 21,483,220,483<br>(21,483,220,483) |  |

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

| 種類        | 銘柄数        | 組入投資証券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|-----------|------------|----------------|-------------------------|
| アメリカドル    | 投資証券 157銘柄 | 100.00%        | 72.17%                  |
| カナダドル     | 投資証券 26銘柄  | 100.00%        | 1.92%                   |
| オーストラリアドル | 投資証券 25銘柄  | 100.00%        | 7.00%                   |
| イギリスポンド   | 投資証券 27銘柄  | 100.00%        | 5.37%                   |

|            |      |      |         |       |
|------------|------|------|---------|-------|
| 香港ドル       | 投資証券 | 6銘柄  | 100.00% | 2.46% |
| シンガポールドル   | 投資証券 | 30銘柄 | 100.00% | 3.63% |
| ニュージーランドドル | 投資証券 | 6銘柄  | 100.00% | 0.45% |
| イスラエルシェケル  | 投資証券 | 1銘柄  | 100.00% | 0.06% |
| ユーロ        | 投資証券 | 27銘柄 | 100.00% | 6.94% |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。



## 2【ファンドの現況】

## 【eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）】

## 【純資産額計算書】

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

|                 |              |
|-----------------|--------------|
| 資産総額            | 920,994,830  |
| 負債総額            | 568,115      |
| 純資産総額（ - ）      | 920,426,715  |
| 発行済口数           | 893,448,506口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 1.0302       |
| （10,000口当たり）    | （10,302）     |

## 【eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）】

## 【純資産額計算書】

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

|                 |              |
|-----------------|--------------|
| 資産総額            | 825,905,517  |
| 負債総額            | 2,935,107    |
| 純資産総額（ - ）      | 822,970,410  |
| 発行済口数           | 766,794,736口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 1.0733       |
| （10,000口当たり）    | （10,733）     |

## 【eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）】

## 【純資産額計算書】

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産総額            | 2,592,441,232  |
| 負債総額            | 3,566,345      |
| 純資産総額（ - ）      | 2,588,874,887  |
| 発行済口数           | 2,314,878,833口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 1.1184         |
| （10,000口当たり）    | （11,184）       |

## 【eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）】

## 【純資産額計算書】

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産総額            | 1,481,804,954  |
| 負債総額            | 3,626,269      |
| 純資産総額（ - ）      | 1,478,178,685  |
| 発行済口数           | 1,272,599,919口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 1.1615         |
| （10,000口当たり）    | （11,615）       |

## 【eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）】

## 【純資産額計算書】

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産総額            | 3,040,429,031  |
| 負債総額            | 4,640,939      |
| 純資産総額（ - ）      | 3,035,788,092  |
| 発行済口数           | 2,509,118,151口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 1.2099         |
| （10,000口当たり）    | （12,099）       |

（参考）

## TOPIXマザーファンド

## 純資産額計算書

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

|                 |                  |
|-----------------|------------------|
| 資産総額            | 260,185,949,255  |
| 負債総額            | 38,372,838,121   |
| 純資産総額（ - ）      | 221,813,111,134  |
| 発行済口数           | 131,828,494,894口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 1.6826           |
| （10,000口当たり）    | （16,826）         |

## 外国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

|                 |                  |
|-----------------|------------------|
| 資産総額            | 325,769,294,877  |
| 負債総額            | 37,681,468       |
| 純資産総額（ - ）      | 325,731,613,409  |
| 発行済口数           | 126,558,504,282口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 2.5738           |
| （10,000口当たり）    | （25,738）         |

## 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

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額            | 79,702,792,431  |
| 負債総額            | 15,315,277      |
| 純資産総額（ - ）      | 79,687,477,154  |
| 発行済口数           | 33,389,025,345口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 2.3866          |
| （10,000口当たり）    | （23,866）        |

## 日本債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

|                 |                  |
|-----------------|------------------|
| 資産総額            | 591,841,688,378  |
| 負債総額            | 4,367,991,812    |
| 純資産総額（ - ）      | 587,473,696,566  |
| 発行済口数           | 437,918,842,948口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 1.3415           |
| （10,000口当たり）    | （13,415）         |

## 外国債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額            | 131,506,845,547 |
| 負債総額            | 207,168,829     |
| 純資産総額（ - ）      | 131,299,676,718 |
| 発行済口数           | 65,249,427,524口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 2.0123          |
| （10,000口当たり）    | （20,123）        |

## 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

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額            | 20,708,415,955  |
| 負債総額            | 89,262,029      |
| 純資産総額（ - ）      | 20,619,153,926  |
| 発行済口数           | 15,504,767,632口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 1.3299          |
| （10,000口当たり）    | （13,299）        |

## 東証REIT指数マザーファンド

## 純資産額計算書

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産総額            | 24,062,521,709 |
| 負債総額            | 72,313,413     |
| 純資産総額（ - ）      | 23,990,208,296 |
| 発行済口数           | 8,052,879,939口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 2.9791         |
| （10,000口当たり）    | （29,791）       |

## MUAM G-REITマザーファンド

## 純資産額計算書

平成31年 1月31日現在

（単位：円）

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額            | 22,279,172,834  |
| 負債総額            | 7,851,068       |
| 純資産総額（ - ）      | 22,271,321,766  |
| 発行済口数           | 13,321,735,919口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 1.6718          |
| （10,000口当たり）    | （16,718）        |

#### 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

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

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

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたとときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

##### （5）受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に

対抗することができません。

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### （1）資本金の額等

2019年1月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

###### （2）委託会社の機構

###### ・会社の意思決定機構

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

###### ・投資運用の意思決定機構

###### 投資環境見通しの策定

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

###### 運用戦略の決定

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

###### 運用計画の決定

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

###### ポートフォリオの構築

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

###### 投資行動のモニタリング1

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、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

###### 投資行動のモニタリング2

運用部から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、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、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、必要に応じて是正を指示します。

###### 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、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

###### 運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

##### 2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信

託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

2019年1月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

| 商品分類       | 本数<br>(本) | 純資産総額<br>(百万円) |
|------------|-----------|----------------|
| 追加型株式投資信託  | 896       | 12,440,420     |
| 追加型公社債投資信託 | 16        | 1,154,844      |
| 単位型株式投資信託  | 52        | 255,351        |
| 単位型公社債投資信託 | 1         | 5,938          |
| 合計         | 965       | 13,856,554     |

なお、純資産総額の金額については、百万円未満の端数を四捨五入して記載しておりますので、表中の個々の数字の合計と合計欄の数字とは一致しないことがあります。

### 3【委託会社等の経理状況】

#### (1) 財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJ国際投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52号）」に基づき作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和52年大蔵省令第38号）」（以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表に掲載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

#### (2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期事業年度（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第34期事業年度に係る中間会計期間（自平成30年4月1日至平成30年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

#### (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

|        | 第32期<br>(平成29年3月31日現在) |            | 第33期<br>(平成30年3月31日現在) |            |
|--------|------------------------|------------|------------------------|------------|
| (資産の部) |                        |            |                        |            |
| 流動資産   |                        |            |                        |            |
| 現金及び預金 | 2                      | 69,212,680 | 2                      | 54,140,307 |
| 有価証券   |                        | 36,210     |                        | 19,967     |



|            |   |             |   |             |
|------------|---|-------------|---|-------------|
| 前払費用       |   | 337,699     |   | 362,886     |
| 未収入金       |   | 35,896      |   | 2,109       |
| 未収委託者報酬    |   | 10,076,022  |   | 9,770,529   |
| 未収収益       | 2 | 659,405     | 2 | 674,156     |
| 繰延税金資産     |   | 446,374     |   | 490,903     |
| 金銭の信託      | 2 | 30,000      | 2 | 30,000      |
| その他        |   | 113,754     |   | 224,645     |
| 流動資産合計     |   | 80,948,042  |   | 65,715,506  |
| 固定資産       |   |             |   |             |
| 有形固定資産     |   |             |   |             |
| 建物         | 1 | 806,798     | 1 | 760,010     |
| 器具備品       | 1 | 759,446     | 1 | 724,852     |
| 土地         |   | 1,356,000   |   | 1,356,000   |
| 有形固定資産合計   |   | 2,922,245   |   | 2,840,863   |
| 無形固定資産     |   |             |   |             |
| 電話加入権      |   | 15,822      |   | 15,822      |
| ソフトウェア     |   | 1,844,549   |   | 2,654,296   |
| ソフトウェア仮勘定  |   | 608,066     |   | 1,097,970   |
| その他        |   | 10          |   |             |
| 無形固定資産合計   |   | 2,468,448   |   | 3,768,090   |
| 投資その他の資産   |   |             |   |             |
| 投資有価証券     |   | 24,327,081  |   | 26,361,327  |
| 関係会社株式     |   | 320,136     |   | 320,136     |
| 長期差入保証金    |   | 654,402     |   | 627,141     |
| 前払年金費用     |   | 463,105     |   | 434,700     |
| 繰延税金資産     |   | 711,230     |   | 747,085     |
| その他        |   | 50,235      |   | 45,230      |
| 貸倒引当金      |   | 23,600      |   | 23,600      |
| 投資その他の資産合計 |   | 26,502,592  |   | 28,512,021  |
| 固定資産合計     |   | 31,893,286  |   | 35,120,975  |
| 資産合計       |   | 112,841,328 |   | 100,836,481 |

(単位：千円)

|         | 第32期<br>(平成29年3月31日現在) | 第33期<br>(平成30年3月31日現在) |
|---------|------------------------|------------------------|
| (負債の部)  |                        |                        |
| 流動負債    |                        |                        |
| 預り金     | 166,493                | 359,176                |
| 未払金     |                        |                        |
| 未払収益分配金 | 108,024                | 174,333                |
| 未払償還金   | 547,707                | 456,159                |
| 未払手数料   | 2 4,225,009            | 2 3,905,670            |
| その他未払金  | 2 2,355,815            | 2 4,330,584            |
| 未払費用    | 2 3,061,479            | 2 4,388,803            |

|           |            |            |
|-----------|------------|------------|
| 未払消費税等    | 351,670    | 99,010     |
| 未払法人税等    | 756,668    | 736,829    |
| 賞与引当金     | 843,729    | 906,167    |
| 役員賞与引当金   | 100,680    | 125,343    |
| その他       | 711,633    | 842,194    |
| 流動負債合計    | 13,228,909 | 16,324,272 |
| 固定負債      |            |            |
| 退職給付引当金   | 590,154    | 720,536    |
| 役員退職慰労引当金 | 166,458    | 187,562    |
| 時効後支払損引当金 | 253,070    | 254,851    |
| 固定負債合計    | 1,009,684  | 1,162,951  |
| 負債合計      | 14,238,594 | 17,487,223 |
| (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   | 43,034,713 | 27,790,911 |
| 利益剰余金合計   | 50,375,303 | 35,131,500 |
| 株主資本合計    | 97,108,147 | 81,864,344 |

(単位：千円)

|                  | 第32期<br>(平成29年3月31日現在) | 第33期<br>(平成30年3月31日現在) |
|------------------|------------------------|------------------------|
| 評価・換算差額等         |                        |                        |
| その他有価証券<br>評価差額金 | 1,494,586              | 1,484,913              |
| 評価・換算差額等合計       | 1,494,586              | 1,484,913              |
| 純資産合計            | 98,602,734             | 83,349,257             |
| 負債純資産合計          | 112,841,328            | 100,836,481            |

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

|             | 第32期<br>(自 平成28年4月1日<br>至 平成29年3月31日) |            | 第33期<br>(自 平成29年4月1日<br>至 平成30年3月31日) |            |
|-------------|---------------------------------------|------------|---------------------------------------|------------|
| 営業収益        |                                       |            |                                       |            |
| 委託者報酬       |                                       | 81,709,776 |                                       | 75,423,596 |
| 投資顧問料       |                                       | 2,396,020  |                                       | 2,723,458  |
| その他営業収益     |                                       | 25,763     |                                       | 48,215     |
| 営業収益合計      |                                       | 84,131,560 |                                       | 78,195,269 |
| 営業費用        |                                       |            |                                       |            |
| 支払手数料       | 2                                     | 33,975,255 | 2                                     | 30,906,879 |
| 広告宣伝費       |                                       | 731,771    |                                       | 730,784    |
| 公告費         |                                       | 482        |                                       | 1,000      |
| 調査費         |                                       |            |                                       |            |
| 調査費         |                                       | 1,713,892  |                                       | 1,723,057  |
| 委託調査費       |                                       | 13,961,993 |                                       | 13,467,029 |
| 事務委託費       |                                       | 984,749    |                                       | 864,916    |
| 営業雑経費       |                                       |            |                                       |            |
| 通信費         |                                       | 158,915    |                                       | 178,652    |
| 印刷費         |                                       | 699,940    |                                       | 467,973    |
| 協会費         |                                       | 51,995     |                                       | 50,251     |
| 諸会費         |                                       | 9,887      |                                       | 15,328     |
| 事務機器関連費     |                                       | 1,611,608  |                                       | 1,635,079  |
| その他営業雑経費    |                                       | 11,925     |                                       | 23,250     |
| 営業費用合計      |                                       | 53,912,419 |                                       | 50,064,204 |
| 一般管理費       |                                       |            |                                       |            |
| 給料          |                                       |            |                                       |            |
| 役員報酬        |                                       | 331,997    |                                       | 349,359    |
| 給料・手当       |                                       | 6,496,165  |                                       | 6,421,837  |
| 賞与引当金繰入     |                                       | 843,729    |                                       | 906,167    |
| 役員賞与引当金繰入   |                                       | 100,680    |                                       | 125,343    |
| 福利厚生費       |                                       | 1,196,210  |                                       | 1,231,033  |
| 交際費         |                                       | 14,843     |                                       | 13,012     |
| 旅費交通費       |                                       | 233,159    |                                       | 192,192    |
| 租税公課        |                                       | 422,030    |                                       | 410,229    |
| 不動産賃借料      |                                       | 706,571    |                                       | 678,182    |
| 退職給付費用      |                                       | 441,736    |                                       | 423,171    |
| 役員退職慰労引当金繰入 |                                       | 48,393     |                                       | 47,889     |
| 固定資産減価償却費   |                                       | 1,030,040  |                                       | 1,115,719  |
| 諸経費         |                                       | 474,521    |                                       | 450,299    |
| 一般管理費合計     |                                       | 12,340,079 |                                       | 12,364,437 |
| 営業利益        |                                       | 17,879,061 |                                       | 15,766,627 |

(単位：千円)

|  | 第32期<br>(自 平成28年4月1日<br>至 平成29年3月31日) |  | 第33期<br>(自 平成29年4月1日<br>至 平成30年3月31日) |  |
|--|---------------------------------------|--|---------------------------------------|--|
|--|---------------------------------------|--|---------------------------------------|--|

営業外収益

|              |   |            |   |            |
|--------------|---|------------|---|------------|
| 受取配当金        |   | 243,048    |   | 349,402    |
| 有価証券利息       |   | 0          |   |            |
| 受取利息         | 2 | 4,601      | 2 | 483        |
| 投資有価証券償還益    |   | 260,190    |   | 81,580     |
| 収益分配金等時効完成分  |   | 278,148    |   | 91,672     |
| その他          |   | 4,383      |   | 9,989      |
| 営業外収益合計      |   | 790,372    |   | 533,128    |
| 営業外費用        |   |            |   |            |
| 投資有価証券償還損    |   | 11,552     |   | 30,114     |
| 時効後支払損引当金繰入  |   |            |   | 43,182     |
| 事務過誤費        |   | 218        |   | 10,402     |
| その他          |   | 4,357      |   | 3,829      |
| 営業外費用合計      |   | 16,128     |   | 87,529     |
| 経常利益         |   | 18,653,304 |   | 16,212,226 |
| 特別利益         |   |            |   |            |
| 投資有価証券売却益    |   | 259,137    |   | 516,394    |
| ゴルフ会員権売却益    |   |            |   | 7,495      |
| 特別利益合計       |   | 259,137    |   | 523,889    |
| 特別損失         |   |            |   |            |
| 投資有価証券売却損    |   | 42,248     |   | 105,903    |
| デリバティブ解約損    |   | 126,228    |   |            |
| 投資有価証券評価損    |   | 157,482    |   | 102,096    |
| 固定資産除却損      | 1 | 13,540     | 1 | 54         |
| 減損損失         | 3 | 48,575     |   |            |
| 特別損失合計       |   | 388,075    |   | 208,054    |
| 税引前当期純利益     |   | 18,524,367 |   | 16,528,061 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 2 | 5,658,953  | 2 | 5,252,224  |
| 法人税等調整額      |   | 103,169    |   | 76,092     |
| 法人税等合計       |   | 5,762,122  |   | 5,176,132  |
| 当期純利益        |   | 12,762,244 |   | 11,351,928 |

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

(単位:千円)

|        | 株主資本      |           |            |            |         |                   |            |            | 株主資本合計      |
|--------|-----------|-----------|------------|------------|---------|-------------------|------------|------------|-------------|
|        | 資本金       | 資本剰余金     |            |            | 利益剰余金   |                   |            | 利益剰余金合計    |             |
|        |           | 資本準備金     | その他資本剰余金   | 資本剰余金合計    | 利益準備金   | その他利益剰余金<br>別途積立金 | 繰越利益剰余金    |            |             |
| 当期首残高  | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616 | 44,732,712 | 342,589 | 6,998,000         | 57,079,782 | 64,420,372 | 111,153,216 |
| 当期変動額  |           |           |            |            |         |                   |            |            |             |
| 剰余金の配当 |           |           |            |            |         |                   | 26,807,312 | 26,807,312 | 26,807,312  |
| 当期純利益  |           |           |            |            |         |                   | 12,762,244 | 12,762,244 | 12,762,244  |

|                             |           |           |            |            |         |           |            |            |            |
|-----------------------------|-----------|-----------|------------|------------|---------|-----------|------------|------------|------------|
| 株主資本以外の<br>項目の当期変動額<br>(純額) |           |           |            |            |         |           |            |            |            |
| 当期変動額合計                     |           |           |            |            |         |           | 14,045,068 | 14,045,068 | 14,045,068 |
| 当期末残高                       | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616 | 44,732,712 | 342,589 | 6,998,000 | 43,034,713 | 50,375,303 | 97,108,147 |

|                             | 評価・換算差額等             |             |                | 純資産合計       |
|-----------------------------|----------------------|-------------|----------------|-------------|
|                             | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 繰延ヘッジ<br>損益 | 評価・換算<br>差額等合計 |             |
| 当期首残高                       | 1,446,576            | 6,546       | 1,453,123      | 112,606,339 |
| 当期変動額                       |                      |             |                |             |
| 剰余金の配当                      |                      |             |                | 26,807,312  |
| 当期純利益                       |                      |             |                | 12,762,244  |
| 株主資本以外の<br>項目の当期変動額<br>(純額) | 48,009               | 6,546       | 41,462         | 41,462      |
| 当期変動額合計                     | 48,009               | 6,546       | 41,462         | 14,003,605  |
| 当期末残高                       | 1,494,586            |             | 1,494,586      | 98,602,734  |

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

(単位：千円)

|                             | 株主資本      |           |              |             |           |           |             |             | 株主資本合計     |
|-----------------------------|-----------|-----------|--------------|-------------|-----------|-----------|-------------|-------------|------------|
|                             | 資本金       | 資本剰余金     |              |             | 利益<br>準備金 | その他利益剰余金  |             | 利益剰余金<br>合計 |            |
|                             |           | 資本<br>準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本<br>剰余金合計 |           | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>剰余金 |             |            |
| 当期首残高                       | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616   | 44,732,712  | 342,589   | 6,998,000 | 43,034,713  | 50,375,303  | 97,108,147 |
| 当期変動額                       |           |           |              |             |           |           |             |             |            |
| 剰余金の配当                      |           |           |              |             |           |           | 26,595,731  | 26,595,731  | 26,595,731 |
| 当期純利益                       |           |           |              |             |           |           | 11,351,928  | 11,351,928  | 11,351,928 |
| 株主資本以外の<br>項目の当期変動額<br>(純額) |           |           |              |             |           |           |             |             |            |
| 当期変動額合計                     |           |           |              |             |           |           | 15,243,802  | 15,243,802  | 15,243,802 |
| 当期末残高                       | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616   | 44,732,712  | 342,589   | 6,998,000 | 27,790,911  | 35,131,500  | 81,864,344 |

|                             | 評価・換算差額等             |                | 純資産合計      |
|-----------------------------|----------------------|----------------|------------|
|                             | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>差額等合計 |            |
| 当期首残高                       | 1,494,586            | 1,494,586      | 98,602,734 |
| 当期変動額                       |                      |                |            |
| 剰余金の配当                      |                      |                | 26,595,731 |
| 当期純利益                       |                      |                | 11,351,928 |
| 株主資本以外の<br>項目の当期変動額<br>(純額) | 9,673                | 9,673          | 9,673      |
| 当期変動額合計                     | 9,673                | 9,673          | 15,253,476 |
| 当期末残高                       | 1,484,913            | 1,484,913      | 83,349,257 |

## [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

## 時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

|      |        |
|------|--------|
| 建物   | 5年～50年 |
| 器具備品 | 2年～20年 |

## (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。

## 3. 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。

## 4. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

## (2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (4) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

## 退職給付見込額の期間帰属方法

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

## 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

## (5) 役員退職慰労引当金

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

## (6) 時効後支払損引当金

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

## 5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

### (1) 消費税等の会計処理

税抜方式を採用しており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

### (2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

### (未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日 企業会計基準委員会）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日 企業会計基準委員会）

### (1) 概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、平成26年5月に「顧客との契約から生じる収益」（IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic606）を公表しており、IFRS第15号は平成30年1月1日以後開始する事業年度から、Topic606は平成29年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

### (2) 適用予定日

平成34年3月期の期首から適用します。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

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

## (貸借対照表関係)

### 1. 有形固定資産の減価償却累計額

|      | 第32期<br>(平成29年3月31日現在) | 第33期<br>(平成30年3月31日現在) |
|------|------------------------|------------------------|
| 建物   | 539,649千円              | 604,123千円              |
| 器具備品 | 1,029,950千円            | 1,215,234千円            |

### 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32期<br>(平成29年3月31日現在) | 第33期<br>(平成30年3月31日現在) |
|--------|------------------------|------------------------|
| 預金     | 47,798,472千円           | 41,809,118千円           |
| 未収収益   | 46,963千円               | 40,621千円               |
| 金銭の信託  | 30,000千円               | 30,000千円               |
| 未払手数料  | 1,993,055千円            | 1,577,059千円            |
| その他未払金 | 2,071,256千円            | 3,850,734千円            |

未払費用

456,748千円

430,491千円

## (損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

|        | 第32期<br>(自平成28年4月1日<br>至平成29年3月31日) | 第33期<br>(自平成29年4月1日<br>至平成30年3月31日) |
|--------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 建物     | 2,392千円                             |                                     |
| 器具備品   | 7,791千円                             | 54千円                                |
| ソフトウェア | 3,356千円                             |                                     |
| 計      | 13,540千円                            | 54千円                                |

## 2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

|              | 第32期<br>(自平成28年4月1日<br>至平成29年3月31日) | 第33期<br>(自平成29年4月1日<br>至平成30年3月31日) |
|--------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 支払手数料        | 13,862,465千円                        | 11,380,244千円                        |
| 受取利息         | 4,375千円                             | 380千円                               |
| 法人税、住民税及び事業税 | 4,204,969千円                         | 3,851,536千円                         |

## 3. 減損損失

当社は、以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

| 場所          | 用途                   | 種類            | 減損損失     |
|-------------|----------------------|---------------|----------|
| 東京都千代田区（本社） | 自社利用ソフトウェア<br>（遊休資産） | ソフトウェア<br>仮勘定 | 48,575千円 |

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグループングとしております。遊休資産については個別資産ごとにグループングを行っております。

当事業年度において、将来の使用見込みがなくなった自社利用ソフトウェアについて、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、将来の使用見込みがないため、使用価値は零としております。

第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

該当事項はありません。

## (株主資本等変動計算書関係)

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成28年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。



|          |              |
|----------|--------------|
| 配当金の総額   | 26,807,312千円 |
| 1株当たり配当額 | 126,700円     |
| 基準日      | 平成28年3月31日   |
| 効力発生日    | 平成28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  
平成29年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|          |              |
|----------|--------------|
| 配当金の総額   | 26,595,731千円 |
| 配当の原資    | 利益剰余金        |
| 1株当たり配当額 | 125,700円     |
| 基準日      | 平成29年3月31日   |
| 効力発生日    | 平成29年6月29日   |

第33期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項

(1)配当金支払額

平成29年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|          |              |
|----------|--------------|
| 配当金の総額   | 26,595,731千円 |
| 1株当たり配当額 | 125,700円     |
| 基準日      | 平成29年3月31日   |
| 効力発生日    | 平成29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  
平成30年6月27日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|          |              |
|----------|--------------|
| 配当金の総額   | 11,363,380千円 |
| 配当の原資    | 利益剰余金        |
| 1株当たり配当額 | 53,707円      |
| 基準日      | 平成30年3月31日   |
| 効力発生日    | 平成30年6月28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32期<br>(平成29年3月31日現在) | 第33期<br>(平成30年3月31日現在) |
|-----|------------------------|------------------------|
| 1年内 | 678,116千円              | 678,116千円              |
| 1年超 | 2,030,029千円            | 1,351,912千円            |
| 合計  | 2,708,145千円            | 2,030,029千円            |

(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、譲渡性預金または投資信託に限定しており、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。

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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があります。

## 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、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

## 第32期(平成29年3月31日現在)

|             | 貸借対照表<br>計上額(千円) | 時価(千円)      | 差額(千円) |
|-------------|------------------|-------------|--------|
| (1) 現金及び預金  | 69,212,680       | 69,212,680  | -      |
| (2) 有価証券    | 36,210           | 36,210      | -      |
| (3) 未収委託者報酬 | 10,076,022       | 10,076,022  | -      |
| (4) 投資有価証券  | 24,189,921       | 24,189,921  | -      |
| 資産計         | 103,514,834      | 103,514,834 | -      |
| (1) 未払手数料   | 4,225,009        | 4,225,009   | -      |
| 負債計         | 4,225,009        | 4,225,009   | -      |

## 第33期(平成30年3月31日現在)

|             | 貸借対照表<br>計上額(千円) | 時価(千円)     | 差額(千円) |
|-------------|------------------|------------|--------|
| (1) 現金及び預金  | 54,140,307       | 54,140,307 | -      |
| (2) 有価証券    | 19,967           | 19,967     | -      |
| (3) 未収委託者報酬 | 9,770,529        | 9,770,529  | -      |
| (4) 投資有価証券  | 26,224,167       | 26,224,167 | -      |
| 資産計         | 90,154,972       | 90,154,972 | -      |
| (1) 未払手数料   | 3,905,670        | 3,905,670  | -      |
| 負債計         | 3,905,670        | 3,905,670  | -      |

## (注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

## (1) 現金及び預金、(3) 未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (2) 有価証券、(4) 投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

負 債

## (1) 未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

| 区分    | 第32期<br>(平成29年3月31日現在) | 第33期<br>(平成30年3月31日現在) |
|-------|------------------------|------------------------|
| 非上場株式 | 137,160                | 137,160                |

|        |         |         |
|--------|---------|---------|
| 子会社株式  | 160,600 | 160,600 |
| 関連会社株式 | 159,536 | 159,536 |

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 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32期(平成29年3月31日現在)

(単位：千円)

|                   | 1年以内       | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超   |
|-------------------|------------|-------------|--------------|--------|
| 現金及び預金            | 69,212,680 | -           | -            | -      |
| 未収委託者報酬           | 10,076,022 | -           | -            | -      |
| 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              | 36,210     | 10,703,761  | 8,324,138    | 45,606 |
| 合計                | 79,324,912 | 10,703,761  | 8,324,138    | 45,606 |

第33期(平成30年3月31日現在)

(単位：千円)

|                   | 1年以内       | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超   |
|-------------------|------------|-------------|--------------|--------|
| 現金及び預金            | 54,140,307 | -           | -            | -      |
| 未収委託者報酬           | 9,770,529  | -           | -            | -      |
| 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              | 19,967     | 13,110,758  | 8,593,680    | 68,714 |
| 合計                | 63,930,804 | 13,110,758  | 8,593,680    | 68,714 |

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

2. その他有価証券

第32期(平成29年3月31日現在)

|                              | 種類  | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額(千円)    |
|------------------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額<br>が取得原価を超え<br>るもの  | 株式  | -                | -            | -         |
|                              | 債券  | -                | -            | -         |
|                              | その他 | 17,778,798       | 15,302,336   | 2,476,461 |
|                              | 小計  | 17,778,798       | 15,302,336   | 2,476,461 |
| 貸借対照表計上額<br>が取得原価を超え<br>ないもの | 株式  | -                | -            | -         |
|                              | 債券  | -                | -            | -         |
|                              | その他 | 6,447,333        | 6,769,569    | 322,236   |
|                              | 小計  | 6,447,333        | 6,769,569    | 322,236   |
| 合計                           |     | 24,226,131       | 22,071,906   | 2,154,225 |

## 第33期(平成30年3月31日現在)

|                              | 種類  | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額(千円)    |
|------------------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額<br>が取得原価を超え<br>るもの  | 株式  | -                | -            | -         |
|                              | 債券  | -                | -            | -         |
|                              | その他 | 18,599,111       | 16,040,884   | 2,558,227 |
|                              | 小計  | 18,599,111       | 16,040,884   | 2,558,227 |
| 貸借対照表計上額<br>が取得原価を超え<br>ないもの | 株式  | -                | -            | -         |
|                              | 債券  | -                | -            | -         |
|                              | その他 | 7,645,023        | 8,062,990    | 417,966   |
|                              | 小計  | 7,645,023        | 8,062,990    | 417,966   |
| 合計                           |     | 26,244,135       | 24,103,874   | 2,140,260 |

## 3.売却したその他有価証券

第32期(自平成28年4月1日至平成29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  | 122,688   | 82,146      | 21,570      |
| 債券  | -         | -           | -           |
| その他 | 3,439,009 | 176,991     | 20,678      |
| 合計  | 3,561,698 | 259,137     | 42,248      |

第33期(自平成29年4月1日至平成30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 | 8,169,769 | 516,394     | 105,903     |
| 合計  | 8,169,769 | 516,394     | 105,903     |

## 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157,482千円（その他有価証券のその他157,482千円）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102,096千円（その他有価証券のその他102,096千円）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32期<br>(自平成28年4月1日<br>至平成29年3月31日) | 第33期<br>(自平成29年4月1日<br>至平成30年3月31日) |
|-------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 退職給付債務の期首残高 | 2,997,931 千円                        | 3,649,089 千円                        |

|              |           |           |
|--------------|-----------|-----------|
| 勤務費用         | 199,166   | 184,120   |
| 利息費用         | 22,711    | 27,829    |
| 数理計算上の差異の発生額 | 40,934    | 56,895    |
| 退職給付の支払額     | 183,403   | 188,683   |
| 過去勤務費用の発生額   | 653,618   | -         |
| 退職給付債務の期末残高  | 3,649,089 | 3,729,252 |

## (2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

|              | 第32期<br>(自平成28年4月1日<br>至平成29年3月31日) | 第33期<br>(自平成29年4月1日<br>至平成30年3月31日) |
|--------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 年金資産の期首残高    | 2,678,827 千円                        | 2,698,738 千円                        |
| 期待運用収益       | 47,553                              | 48,080                              |
| 数理計算上の差異の発生額 | 7,066                               | 47,759                              |
| 事業主からの拠出額    | 107,823                             | 102,564                             |
| 退職給付の支払額     | 142,532                             | 173,748                             |
| 年金資産の期末残高    | 2,698,738                           | 2,723,393                           |

## (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32期<br>(平成29年3月31日現在) | 第33期<br>(平成30年3月31日現在) |
|---------------------|------------------------|------------------------|
| 積立型制度の退職給付債務        | 3,471,120 千円           | 3,374,562 千円           |
| 年金資産                | 2,698,738              | 2,723,393              |
|                     | 772,381                | 651,168                |
| 非積立型制度の退職給付債務       | 177,969                | 354,690                |
| 未積立退職給付債務           | 950,350                | 1,005,858              |
| 未認識数理計算上の差異         | 207,810                | 169,893                |
| 未認識過去勤務費用           | 615,490                | 550,128                |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 127,049                | 285,836                |
| 退職給付引当金             | 590,154                | 720,536                |
| 前払年金費用              | 463,105                | 434,700                |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 127,049                | 285,836                |

## (4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

|                 | 第32期<br>(自平成28年4月1日<br>至平成29年3月31日) | 第33期<br>(自平成29年4月1日<br>至平成30年3月31日) |
|-----------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 勤務費用            | 199,166 千円                          | 184,120 千円                          |
| 利息費用            | 22,711                              | 27,829                              |
| 期待運用収益          | 47,553                              | 48,080                              |
| 数理計算上の差異の費用処理額  | 54,327                              | 47,053                              |
| 過去勤務費用の費用処理額    | 38,127                              | 65,361                              |
| その他             | 28,533                              | 4,780                               |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 295,314                             | 281,066                             |

(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等です。

## (5)年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

|     | 第32期<br>(平成29年3月31日現在) | 第33期<br>(平成30年3月31日現在) |
|-----|------------------------|------------------------|
| 債券  | 62.9 %                 | 62.2 %                 |
| 株式  | 33.3                   | 34.7                   |
| その他 | 3.7                    | 3.1                    |
| 合計  | 100                    | 100                    |

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6)数理計算上の計算基礎に関する事項

## 主要な数理計算上の計算基礎

|           | 第32期<br>(平成29年3月31日現在) | 第33期<br>(平成30年3月31日現在) |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 割引率       | 0.061～0.90%            | 0.069～0.67%            |
| 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146,421千円、当事業年度142,105千円であります。

## (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32期<br>(平成29年3月31日現在) | 第33期<br>(平成30年3月31日現在) |
|---------------|------------------------|------------------------|
| 繰延税金資産        |                        |                        |
| 減損損失          | 455,165千円              | 445,379千円              |
| 投資有価証券評価損     | 242,551                | 223,512                |
| ゴルフ会員権評価損     | 295                    | -                      |
| 未払事業税         | 124,367                | 135,805                |
| 賞与引当金         | 260,374                | 277,468                |
| 役員賞与引当金       | 11,509                 | 12,235                 |
| 役員退職慰労引当金     | 50,969                 | 57,431                 |
| 退職給付引当金       | 180,726                | 220,628                |
| 減価償却超過額       | 19,277                 | 13,690                 |
| 委託者報酬         | 217,902                | 257,879                |
| 長期差入保証金       | 14,803                 | 23,262                 |
| 時効後支払損引当金     | 77,490                 | 78,035                 |
| 連結納税適用による時価評価 | 236,450                | 200,331                |
| その他           | 68,614                 | 82,168                 |
| 繰延税金資産 小計     | 1,960,499              | 2,027,829              |
| 評価性引当額        | -                      | -                      |
| 繰延税金資産 合計     | 1,960,499              | 2,027,829              |
| 繰延税金負債        |                        |                        |
| 前払年金費用        | 141,802                | 133,105                |

|               |           |           |
|---------------|-----------|-----------|
| 連結納税適用による時価評価 | 1,447     | 1,382     |
| その他有価証券評価差額金  | 659,638   | 655,348   |
| その他           | 3         | 4         |
| 繰延税金負債 合計     | 802,893   | 789,840   |
| 繰延税金資産の純額     | 1,157,605 | 1,237,989 |

## 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32期（平成29年3月31日現在）及び第33期（平成30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。

（セグメント情報等）

### [セグメント情報]

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）及び第33期（自平成29年4月1日至平成30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32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）及び第33期（自平成29年4月1日至平成30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32期（自平成28年4月1日至平成29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 | 科目 | 期末残高 |
|----|--------|-----|-----|-------|----------------|-----------|-------|------|----|------|
|    |        |     |     |       |                |           |       |      |    |      |

|      |                      |         |                  |             |                     |                               |                   |                 |        |                 |
|------|----------------------|---------|------------------|-------------|---------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------|--------|-----------------|
| 親会社  | (株)三菱UFJフィナンシャル・グループ | 東京都千代田区 | 2,141,513<br>百万円 | 銀行持株<br>会社業 | 被所有<br>間接<br>100.0% | 連結納税<br>役員の兼任                 | 連結納税に伴う支払         | 4,204,969<br>千円 | その他未払金 | 2,071,256<br>千円 |
| 親会社  | 三菱UFJ信託銀行(株)         | 東京都千代田区 | 324,279<br>百万円   | 信託業、<br>銀行業 | 被所有<br>直接<br>51.0%  | 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 | 5,983,874<br>千円 | 未払手数料  | 716,117<br>千円   |
|      |                      |         |                  |             |                     | 投資の助言<br>役員の兼任                | 投資助言料             | 662,992<br>千円   | 未払費用   | 352,297<br>千円   |
| 主要株主 | (株)三菱東京UFJ銀行         | 東京都千代田区 | 1,711,958<br>百万円 | 銀行業         | 被所有<br>直接<br>15.0%  | 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 | 7,878,591<br>千円 | 未払手数料  | 1,276,937<br>千円 |

## 第33期(自平成29年4月1日至平成30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            | 科目     | 期末残高            |
|-----|----------------------|---------|------------------|-------------|---------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------|--------|-----------------|
| 親会社 | (株)三菱UFJフィナンシャル・グループ | 東京都千代田区 | 2,141,513<br>百万円 | 銀行持株<br>会社業 | 被所有<br>間接<br>100.0% | 連結納税                          | 連結納税に伴う支払         | 3,851,587<br>千円 | その他未払金 | 3,850,734<br>千円 |
| 親会社 | 三菱UFJ信託銀行(株)         | 東京都千代田区 | 324,279<br>百万円   | 信託業、<br>銀行業 | 被所有<br>直接<br>51.0%  | 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 | 5,528,131<br>千円 | 未払手数料  | 665,262<br>千円   |
|     |                      |         |                  |             |                     | 投資の助言<br>役員の兼任                | 投資助言料             | 664,152<br>千円   | 未払費用   | 348,142<br>千円   |



|      |              |         |                  |     |                    |                               |                   |                 |       |               |
|------|--------------|---------|------------------|-----|--------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------|-------|---------------|
| 主要株主 | (株)三菱東京UFJ銀行 | 東京都千代田区 | 1,711,958<br>百万円 | 銀行業 | 被所有<br>直接<br>15.0% | 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 | 5,852,112<br>千円 | 未払手数料 | 921,796<br>千円 |
|------|--------------|---------|------------------|-----|--------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------|-------|---------------|

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

連結納税については、連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

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。

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。

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いません。

## (2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

| 種類          | 会社等の名称                   | 所在地     | 資本金           | 事業の内容 | 議決権等の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者との関係                     | 取引の内容             | 取引金額            | 科目    | 期末残高          |
|-------------|--------------------------|---------|---------------|-------|------------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------|-------|---------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ<br>モルガン・スタンレー証券(株) | 東京都千代田区 | 40,500<br>百万円 | 証券業   | なし                     | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払 | 6,532,238<br>千円 | 未払手数料 | 933,908<br>千円 |

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 |
|----|--------|-----|-----|-------|------------------------|-----------|-------|------|----|------|
|----|--------|-----|-----|-------|------------------------|-----------|-------|------|----|------|

|             |                                |                 |               |     |    |   |                               |                 |       |               |
|-------------|--------------------------------|-----------------|---------------|-----|----|---|-------------------------------|-----------------|-------|---------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ<br>モルガン・<br>スタンレー<br>証券㈱ | 東京都<br>千代田<br>区 | 40,500<br>百万円 | 証券業 | なし | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料の<br>支払 | 6,263,571<br>千円 | 未払手数料 | 907,290<br>千円 |
|-------------|--------------------------------|-----------------|---------------|-----|----|---|-------------------------------|-----------------|-------|---------------|

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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。

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いません。

## 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32期<br>(自平成28年4月1日<br>至平成29年3月31日) | 第33期<br>(自平成29年4月1日<br>至平成30年3月31日) |
|--------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 1株当たり純資産額    | 466,028.30円                         | 393,935.45円                         |
| 1株当たり当期純利益金額 | 60,318.47円                          | 53,652.87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32期<br>(自平成28年4月1日<br>至平成29年3月31日) | 第33期<br>(自平成29年4月1日<br>至平成30年3月31日) |
|------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 当期純利益金額（千円）            | 12,762,244                          | 11,351,928                          |
| 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<br>（千円） | 12,762,244                          | 11,351,928                          |
| 普通株式の期中平均株式数（株）        | 211,581                             | 211,581                             |

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第34期中間会計期間  
(平成30年9月30日現在)

## (資産の部)

## 流動資産

|        |            |
|--------|------------|
| 現金及び預金 | 46,097,117 |
| 有価証券   | 3,465,878  |

|            |   |            |
|------------|---|------------|
| 前払費用       |   | 508,670    |
| 未収入金       |   | 114,195    |
| 未収委託者報酬    |   | 10,467,520 |
| 未収収益       |   | 631,208    |
| 金銭の信託      |   | 30,000     |
| その他        |   | 160,228    |
| 流動資産合計     |   | 61,474,819 |
| 固定資産       |   |            |
| 有形固定資産     |   |            |
| 建物         | 1 | 639,152    |
| 器具備品       | 1 | 656,022    |
| 土地         |   | 628,433    |
| 有形固定資産合計   |   | 1,923,608  |
| 無形固定資産     |   |            |
| 電話加入権      |   | 15,822     |
| ソフトウェア     |   | 2,634,028  |
| ソフトウェア仮勘定  |   | 1,536,952  |
| 無形固定資産合計   |   | 4,186,802  |
| 投資その他の資産   |   |            |
| 投資有価証券     |   | 21,198,707 |
| 関係会社株式     |   | 320,136    |
| 投資不動産      | 1 | 826,671    |
| 長期差入保証金    |   | 613,037    |
| 前払年金費用     |   | 424,967    |
| 繰延税金資産     |   | 1,265,831  |
| その他        |   | 45,230     |
| 貸倒引当金      |   | 23,600     |
| 投資その他の資産合計 |   | 24,670,982 |
| 固定資産合計     |   | 30,781,393 |
| 資産合計       |   | 92,256,213 |

(単位：千円)

第34期中間会計期間  
(平成30年9月30日現在)

## (負債の部)

## 流動負債

|         |   |           |
|---------|---|-----------|
| 預り金     |   | 224,194   |
| 未払金     |   |           |
| 未払収益分配金 |   | 155,174   |
| 未払償還金   |   | 454,125   |
| 未払手数料   |   | 4,195,495 |
| その他未払金  |   | 2,309,988 |
| 未払費用    |   | 3,556,319 |
| 未払消費税等  | 2 | 333,072   |
| 未払法人税等  |   | 723,164   |
| 賞与引当金   |   | 881,975   |

|           |            |
|-----------|------------|
| 役員賞与引当金   | 70,050     |
| その他       | 931,859    |
| 流動負債合計    | 13,835,420 |
| 固定負債      |            |
| 長期未払金     | 43,200     |
| 退職給付引当金   | 787,034    |
| 役員退職慰労引当金 | 118,643    |
| 時効後支払損引当金 | 250,090    |
| 固定負債合計    | 1,198,968  |
| 負債合計      | 15,034,389 |
| (純資産の部)   |            |
| 株主資本      |            |
| 資本金       | 2,000,131  |
| 資本剰余金     |            |
| 資本準備金     | 3,572,096  |
| その他資本剰余金  | 41,160,616 |
| 資本剰余金合計   | 44,732,712 |
| 利益剰余金     |            |
| 利益準備金     | 342,589    |
| その他利益剰余金  |            |
| 別途積立金     | 6,998,000  |
| 繰越利益剰余金   | 21,681,136 |
| 利益剰余金合計   | 29,021,726 |
| 株主資本合計    | 75,754,570 |

(単位：千円)

第34期中間会計期間  
(平成30年9月30日現在)

|            |            |
|------------|------------|
| 評価・換算差額等   |            |
| その他有価証券    | 1,467,253  |
| 評価差額金      |            |
| 評価・換算差額等合計 | 1,467,253  |
| 純資産合計      | 77,221,823 |
| 負債純資産合計    | 92,256,213 |

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

第34期中間会計期間  
(自平成30年4月1日  
至平成30年9月30日)

|         |            |
|---------|------------|
| 営業収益    |            |
| 委託者報酬   | 36,137,201 |
| 投資顧問料   | 1,348,173  |
| その他営業収益 | 10,117     |
| 営業収益合計  | 37,495,493 |

|             |   |            |
|-------------|---|------------|
| 営業費用        |   |            |
| 支払手数料       |   | 14,727,452 |
| 広告宣伝費       |   | 341,268    |
| 公告費         |   | 250        |
| 調査費         |   |            |
| 調査費         |   | 894,565    |
| 委託調査費       |   | 6,331,927  |
| 事務委託費       |   | 477,661    |
| 営業雑経費       |   |            |
| 通信費         |   | 88,950     |
| 印刷費         |   | 221,937    |
| 協会費         |   | 24,807     |
| 諸会費         |   | 8,174      |
| 事務機器関連費     |   | 861,234    |
| 営業費用合計      |   | 23,978,229 |
| 一般管理費       |   |            |
| 給料          |   |            |
| 役員報酬        |   | 172,324    |
| 給料・手当       |   | 2,826,697  |
| 賞与引当金繰入     |   | 881,975    |
| 役員賞与引当金繰入   |   | 70,050     |
| 福利厚生費       |   | 614,206    |
| 交際費         |   | 6,039      |
| 旅費交通費       |   | 98,159     |
| 租税公課        |   | 208,364    |
| 不動産賃借料      |   | 330,556    |
| 退職給付費用      |   | 215,629    |
| 役員退職慰労引当金繰入 |   | 25,499     |
| 固定資産減価償却費   | 1 | 595,226    |
| 諸経費         |   | 232,738    |
| 一般管理費合計     |   | 6,277,466  |
| 営業利益        |   | 7,239,797  |

(単位：千円)

第34期中間会計期間  
(自 平成30年4月1日  
至 平成30年9月30日)

|             |   |         |
|-------------|---|---------|
| 営業外収益       |   |         |
| 受取配当金       |   | 135,921 |
| 受取利息        |   | 205     |
| 投資有価証券償還益   |   | 8,893   |
| 収益分配金等時効完成分 |   | 39,613  |
| 受取賃貸料       |   | 5,484   |
| その他         |   | 10,239  |
| 営業外収益合計     |   | 200,357 |
| 営業外費用       |   |         |
| 投資有価証券償還損   |   | 16,309  |
| 賃貸関連費用      | 1 | 25,983  |

|              |           |
|--------------|-----------|
| その他          | 528       |
| 営業外費用合計      | 42,820    |
| 経常利益         | 7,397,334 |
| 特別利益         |           |
| 投資有価証券売却益    | 420,066   |
| 特別利益合計       | 420,066   |
| 特別損失         |           |
| 投資有価証券売却損    | 80,356    |
| 投資有価証券評価損    | 62,310    |
| 固定資産除却損      | 3,345     |
| 商標使用料        | 90,000    |
| 特別損失合計       | 236,012   |
| 税引前中間純利益     | 7,581,388 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 2,347,830 |
| 法人税等調整額      | 20,048    |
| 法人税等合計       | 2,327,781 |
| 中間純利益        | 5,253,606 |

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

(単位：千円)

|                       | 株主資本      |           |            |            |         |           |            |            | 株主資本合計     |
|-----------------------|-----------|-----------|------------|------------|---------|-----------|------------|------------|------------|
|                       | 資本金       | 資本剰余金     |            |            | 利益準備金   | その他利益剰余金  |            | 利益剰余金合計    |            |
|                       |           | 資本準備金     | その他資本剰余金   | 資本剰余金合計    |         | 別途積立金     | 繰越利益剰余金    |            |            |
| 当期首残高                 | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616 | 44,732,712 | 342,589 | 6,998,000 | 27,790,911 | 35,131,500 | 81,864,344 |
| 当中間期変動額               |           |           |            |            |         |           |            |            |            |
| 剰余金の配当                |           |           |            |            |         |           | 11,363,380 | 11,363,380 | 11,363,380 |
| 中間純利益                 |           |           |            |            |         |           | 5,253,606  | 5,253,606  | 5,253,606  |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額) |           |           |            |            |         |           |            |            |            |
| 当中間期変動額合計             |           |           |            |            |         |           | 6,109,774  | 6,109,774  | 6,109,774  |
| 当中間期末残高               | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616 | 44,732,712 | 342,589 | 6,998,000 | 21,681,136 | 29,021,726 | 75,754,570 |

|                       | 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                 | 1,484,913    | 1,484,913  | 83,349,257 |
| 当中間期変動額               |              |            |            |
| 剰余金の配当                |              |            | 11,363,380 |
| 中間純利益                 |              |            | 5,253,606  |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額) | 17,659       | 17,659     | 17,659     |
| 当中間期変動額合計             | 17,659       | 17,659     | 6,127,434  |
| 当中間期末残高               | 1,467,253    | 1,467,253  | 77,221,823 |

**[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

時価のあるもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5年～50年

器具備品 2年～20年

投資不動産 3年～47年

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

## (2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (4) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

## (5) 役員退職慰労引当金

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

## (6) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に

備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

#### 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、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

#### 5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

##### (2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

### [表示方法の変更]

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示する方法に変更しております。

### [注記事項]

（中間貸借対照表関係）

#### 1 減価償却累計額

|       | 第34期中間会計期間<br>(平成30年9月30日現在) |
|-------|------------------------------|
| 建物    | 524,318千円                    |
| 器具備品  | 1,274,989千円                  |
| 投資不動産 | 133,640千円                    |

#### 2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

（中間損益計算書関係）

#### 1 減価償却実施額

|        | 第34期中間会計期間<br>(自平成30年4月1日<br>至平成30年9月30日) |
|--------|---|
| 有形固定資産 | 111,368千円                                 |
| 無形固定資産 | 483,858千円                                 |
| 投資不動産  | 724千円                                     |

（中間株主資本等変動計算書関係）

第34期中間会計期間（自平成30年4月1日 至平成30年9月30日）

#### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

|       | 当事業年度期首<br>株式数（株） | 当中間会計期間<br>増加株式数（株） | 当中間会計期間<br>減少株式数（株） | 当中間会計期間末<br>株式数（株） |
|-------|-------------------|---------------------|---------------------|--------------------|
| 発行済株式 |                   |                     |                     |                    |
| 普通株式  | 211,581           | -                   | -                   | 211,581            |



|    |         |   |   |         |
|----|---------|---|---|---------|
| 合計 | 211,581 | - | - | 211,581 |
|----|---------|---|---|---------|

## 2. 配当に関する事項

平成30年6月27日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|          |              |
|----------|--------------|
| 配当金の総額   | 11,363,380千円 |
| 配当の原資    | 利益剰余金        |
| 1株当たり配当額 | 53,707円      |
| 基準日      | 平成30年3月31日   |
| 効力発生日    | 平成30年6月28日   |

## （リース取引関係）

第34期中間会計期間(平成30年9月30日現在)

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

|     |             |
|-----|-------------|
| 1年内 | 677,036千円   |
| 1年超 | 1,013,934千円 |
| 合 計 | 1,690,971千円 |

## （金融商品関係）

第34期中間会計期間(平成30年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成30年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

|             | 中間貸借対照表<br>計上額（千円） | 時価（千円）     | 差額（千円） |
|-------------|--------------------|------------|--------|
| (1) 現金及び預金  | 46,097,117         | 46,097,117 | -      |
| (2) 有価証券    | 3,465,878          | 3,465,878  | -      |
| (3) 未収委託者報酬 | 10,467,520         | 10,467,520 | -      |
| (4) 投資有価証券  | 21,061,547         | 21,061,547 | -      |
| 資産計         | 81,092,063         | 81,092,063 | -      |
| (1) 未払手数料   | 4,195,495          | 4,195,495  | -      |
| 負債計         | 4,195,495          | 4,195,495  | -      |

## （注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

## 資 産

## (1)現金及び預金、(3)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (2)有価証券、(4)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

## 負 債

## (1)未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## （注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額137,160千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## （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

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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があります。

## （有価証券関係）

第34期中間会計期間（平成30年9月30日現在）

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

|                                | 種類  | 中間貸借対照表<br>計上額（千円） | 取得原価<br>（千円） | 差額（千円）    |
|--------------------------------|-----|--------------------|--------------|-----------|
| 中間貸借対照表計<br>上額が取得原価を<br>超えるもの  | 株式  | -                  | -            | -         |
|                                | 債券  | -                  | -            | -         |
|                                | その他 | 17,134,450         | 14,614,710   | 2,519,740 |
|                                | 小計  | 17,134,450         | 14,614,710   | 2,519,740 |
| 中間貸借対照表計<br>上額が取得原価を<br>超えないもの | 株式  | -                  | -            | -         |
|                                | 債券  | -                  | -            | -         |
|                                | その他 | 7,392,975          | 7,797,908    | 404,933   |
|                                | 小計  | 7,392,975          | 7,797,908    | 404,933   |
| 合計                             |     | 24,527,425         | 22,412,618   | 2,114,807 |

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額137,160千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難であると認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## （セグメント情報等）

## [セグメント情報]

第34期中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## [関連情報]

第34期中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

### 3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[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]

該当事項はありません。

[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]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

|                                      | 第34期中間会計期間<br>(平成30年9月30日現在) |
|--------------------------------------|------------------------------|
| 1株当たり純資産額                            | 364,975.22円                  |
| (算定上の基礎)                             |                              |
| 純資産の部の合計額(千円)                        | 77,221,823                   |
| 普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)                 | 77,221,823                   |
| 1株当たり純資産額の算定に用いられた<br>中間期末の普通株式の数(株) | 211,581                      |

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

|                    | 第34期中間会計期間<br>(自平成30年4月1日<br>至平成30年9月30日) |
|--------------------|---|
| 1株当たり中間純利益金額       | 24,830.23円                                |
| (算定上の基礎)           |   |
| 中間純利益金額(千円)        | 5,253,606                                 |
| 普通株主に帰属しない金額(千円)   | -   |
| 普通株式に係る中間純利益金額(千円) | 5,253,606                                 |
| 普通株式の期中平均株式数(株)    | 211,581                                   |

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業

者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

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

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

## 5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円(2018年9月末現在)

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

| 名称          | 資本金の額<br>(2018年9月末現在) | 事業の内容        |
|-------------|-----------------------|--------------|
| 株式会社三菱UFJ銀行 | 1,711,958 百万円         | 銀行業務を営んでいます。 |
| ソニー銀行株式会社   | 31,000 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社北海道銀行   | 93,524 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社青森銀行    | 19,562 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社山形銀行    | 12,008 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社東邦銀行    | 23,519 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社足利銀行    | 135,000 百万円           | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社常陽銀行    | 85,113 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社武蔵野銀行   | 45,743 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社千葉銀行    | 145,069 百万円           | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社きらぼし銀行  | 43,734 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社横浜銀行    | 215,628 百万円           | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社第四銀行    | 32,776 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社山梨中央銀行  | 15,400 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社北陸銀行    | 140,409 百万円           | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社静岡銀行    | 90,845 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社三重銀行    | 15,295 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社百五銀行    | 20,000 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社滋賀銀行    | 33,076 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社南都銀行    | 37,924 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社山陰合同銀行  | 20,705 百万円            | 銀行業務を営んでいます。 |

|                       |         |     |                               |
|-----------------------|---------|-----|-------------------------------|
| 株式会社広島銀行              | 54,573  | 百万円 | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社山口銀行              | 10,005  | 百万円 | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社阿波銀行              | 23,452  | 百万円 | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社四国銀行              | 25,000  | 百万円 | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社福岡銀行              | 82,329  | 百万円 | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社佐賀銀行              | 16,062  | 百万円 | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社親和銀行              | 36,878  | 百万円 | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社大分銀行              | 19,598  | 百万円 | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社宮崎銀行              | 14,697  | 百万円 | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社琉球銀行              | 54,127  | 百万円 | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社北九州銀行             | 10,000  | 百万円 | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 三菱UFJ信託銀行株式会社         | 324,279 | 百万円 | 銀行業務および信託業務を営んでいます。           |
| 株式会社愛知銀行              | 18,000  | 百万円 | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社もみじ銀行             | 10,000  | 百万円 | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 株式会社熊本銀行              | 33,847  | 百万円 | 銀行業務を営んでいます。                  |
| 労働金庫連合会               | 120,000 | 百万円 | 金融業務を営んでいます。                  |
| カブドットコム証券株式会社         | 7,196   | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 株式会社SBI証券             | 48,323  | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| ぐんぎん証券株式会社            | 3,000   | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| ちばぎん証券株式会社            | 4,374   | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 中銀証券株式会社              | 2,000   | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 楽天証券株式会社              | 7,495   | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 東海東京証券株式会社            | 6,000   | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 東洋証券株式会社              | 13,494  | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 西日本シティTT証券株式会社        | 3,000   | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| マネックス証券株式会社           | 12,200  | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 浜銀TT証券株式会社            | 3,307   | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| ひろぎん証券株式会社            | 5,000   | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 松井証券株式会社              | 11,945  | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 丸三証券株式会社              | 10,000  | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 水戸証券株式会社              | 12,272  | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社 | 40,500  | 百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 三菱UFJ国際投信株式会社         | 2,000   | 百万円 | 金融商品取引法に定める第二種金融商品取引業を営んでいます。 |

労働金庫連合会の資本金の額は「出資金」を記載しております。

## 2【関係業務の概要】

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

## 3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2019年1月末現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%（211,581株）を所有しています。

（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

## 第3【その他】

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

# 独立監査人の監査報告書

平成30年6月27日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

|                    |       |        |   |
|--------------------|-------|--------|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 弥永 めぐみ | 印 |
|--------------------|-------|--------|---|

|                    |       |       |   |
|--------------------|-------|-------|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 青木 裕晃 | 印 |
|--------------------|-------|-------|---|

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33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。

## 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。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の平成30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すべ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。

## 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) 上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成31年3月6日

三菱UFJ国際投信株式会社  
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 印

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）の平成30年1月27日から平成31年1月28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。

**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。

**監査人の責任**

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

**監査意見**

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）の平成31年1月28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すべ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。

**利害関係**

三菱UFJ国際投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。



独立監査人の監査報告書

平成31年3月6日

三菱UFJ国際投信株式会社  
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 印

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）の平成30年1月27日から平成31年1月28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。

**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。

**監査人の責任**

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

**監査意見**

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）の平成31年1月28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すべ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。

**利害関係**

三菱UFJ国際投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成31年3月6日

三菱UFJ国際投信株式会社  
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 印

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）の平成30年1月27日から平成31年1月28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。

**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。

**監査人の責任**

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

**監査意見**

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）の平成31年1月28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すべ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。

**利害関係**

三菱UFJ国際投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成31年3月6日

三菱UFJ国際投信株式会社  
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 印

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）の平成30年1月27日から平成31年1月28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。

**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。

**監査人の責任**

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

**監査意見**

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）の平成31年1月28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すべ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。

**利害関係**

三菱UFJ国際投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成31年3月6日

三菱UFJ国際投信株式会社  
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 印

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）の平成30年1月27日から平成31年1月28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。

**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。

**監査人の責任**

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

**監査意見**

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）の平成31年1月28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すべ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。

**利害関係**

三菱UFJ国際投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成30年12月3日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

## 有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員  
公認会計士 青木 裕 晃 印

業務執行社員

指定有限責任社員  
公認会計士 伊藤 鉄 也 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

### 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。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の平成30年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 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）上記は、委託会社が、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは中間監査の対象に含まれていません。