

## 【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】	平成30年9月21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 信託受益証券に係るファンドの名称】	つみたて8資産均等バランス
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

つみたて8資産均等バランス（「ファンド」といいます。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌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/>

（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】

平成30年9月22日から平成31年9月24日まで

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

### （８）【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社によっては、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）

（ 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】

当ファンドは、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）の各対象インデックスを12.5%ずつ組み合わせた合成ベンチマーク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、5,000億円です。

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

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

## 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
	海外	債券		
追加型	内外	不動産投信	MRF	特殊型 ( )
		その他資産 ( )	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 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式	年1回	グローバル	ファミリー	あり	日経225	ブル・ベア型
一般	年2回	(日本を含む)	ファンド	( )	TOPIX	条件付運用型
大型株	年4回	日本	ファンド・	なし		
中小型株	年6回	北米			オブ・	
債券	(隔月)	欧州	ファンズ		その他	ロング・
一般	年12回	アジア			(合成ベンチ	ショート型/ 絶対収益
公債	(毎月)	オセアニア			マーク)	追求型
社債	日々	中南米				その他 ( )
その他債券	その他	アフリカ				
クレジット	( )	中近東				
属性		(中東)				
( )		エマージング				
不動産投信						

その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株 式、債券、不動 産投信））） 資産複合 （ ）						
---	--	--	--	--	--	--

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<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、対円で為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

#### 商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われのないファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「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（BB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。	
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。	
資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。		
決算頻度	年1回	信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年2回	信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年4回	信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年6回（隔月）	信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年12回（毎月）	信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。	
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。	
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。	
投資対象 地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。	
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。	
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。	
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。	

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

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

## [ ファンドの目的・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

各投資対象資産の指数を均等比率で組み合わせた合成ベンチマークに連動する成果をめざして運用を行います。

- ファンドの1口当たりの純資産額の変動率を合成ベンチマーク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。

■ 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)の各対象インデックス(以下「ベンチマーク」という場合があります。)を12.5%ずつ組み合わせた合成指数をいいます。

特色2

主として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(DR(預託証券)を含みます。)、公社債および不動産投資信託証券(リート)に投資を行います。

- 合成ベンチマーク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。

※実際の運用は各マザーファンドを通じて行います。

■ DR(預託証券)とは、Depositary Receiptの略で、ある国の企業の株式を当該国外の市場で流通させるため、現地法に従い発行した代替証券です。株式と同様に金融商品取引所等で取引されます。

### <基本投資割合>

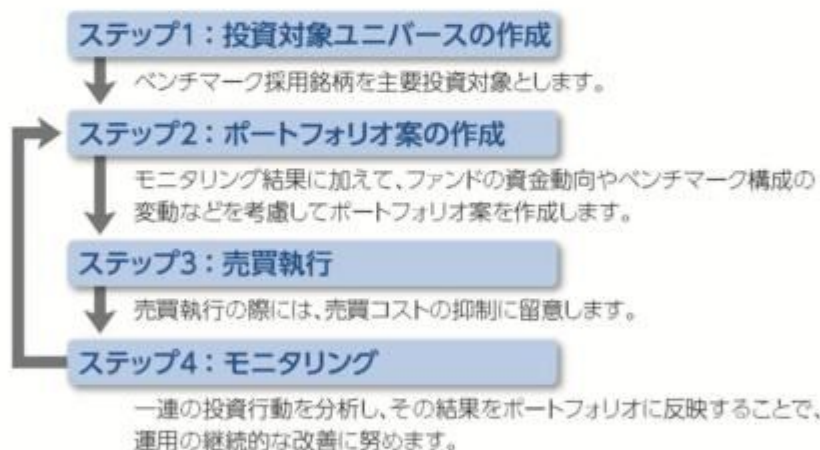




## &lt;各マザーファンドの主要投資対象と運用目標および基本投資割合&gt;

	主要投資対象	運用目標	基本投資割合
TOPIXマザーファンド	国内株式	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。	12.5%
外国株式インデックスマザーファンド	先進国株式	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。	12.5%
新興国株式インデックスマザーファンド	新興国株式	MSCI エマージング・マーケット・インデックス(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。	12.5%
日本債券インデックスマザーファンド	国内債券	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。	12.5%
外国債券インデックスマザーファンド	先進国債券	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。	12.5%
新興国債券インデックスマザーファンド	新興国債券	JPモルガン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。	12.5%
東証REIT指数マザーファンド	国内不動産投資信託証券	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。	12.5%
MUAM G-REITマザーファンド	先進国不動産投資信託証券	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。	12.5%

## &lt;各マザーファンドの運用プロセス&gt;



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

📄 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ(<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)をご覧ください。

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。

特色4

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

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

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## ■ファンドの仕組み

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、公社債および不動産投資信託証券へ投資するファミリーファンド方式により行います。



## ■主な投資制限

株式	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
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。

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

・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。

・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、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI総合は野村證券株式会社の知的財産であり、当ファンドの運用成果に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。

・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指数の商標に関する著作権、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。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<sup>®</sup>およびS&P<sup>®</sup>はStandard & Poor's Financial Services LLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones<sup>®</sup>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も負いません。

### (2) 【ファンドの沿革】

平成29年 8月16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

<b>受託会社（受託者）</b> <b>三菱UFJ信託銀行株式会社</b> （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）	<b>委託会社（委託者）</b> <b>三菱UFJ国際投信株式会社</b>
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 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。

## 委託会社の概況（平成30年6月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号  
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・設立年月日  
昭和60年8月1日
- ・資本金  
2,000百万円
- ・沿革  
平成9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  
平成16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  
平成17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  
平成27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】

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等への投資を通じて、主として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合成ベンチマーク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。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基本投資割合は、純資産総額に対してそれぞれ12.5%とします。

合成ベンチマーク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

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

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MUAM G - REITマザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

１．株券または新株引受権証書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。)
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)  
および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から12. の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16. において同じ。)で16. で定めるもの以外のもの
16. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16. において同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
18. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
19. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)

22. 外国の者に対する権利で21. の有価証券の性質を有するもの

23. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

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

#### 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

## 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 - BPI総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。

##### （運用方法）

投資対象

NOMURA - BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。

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。

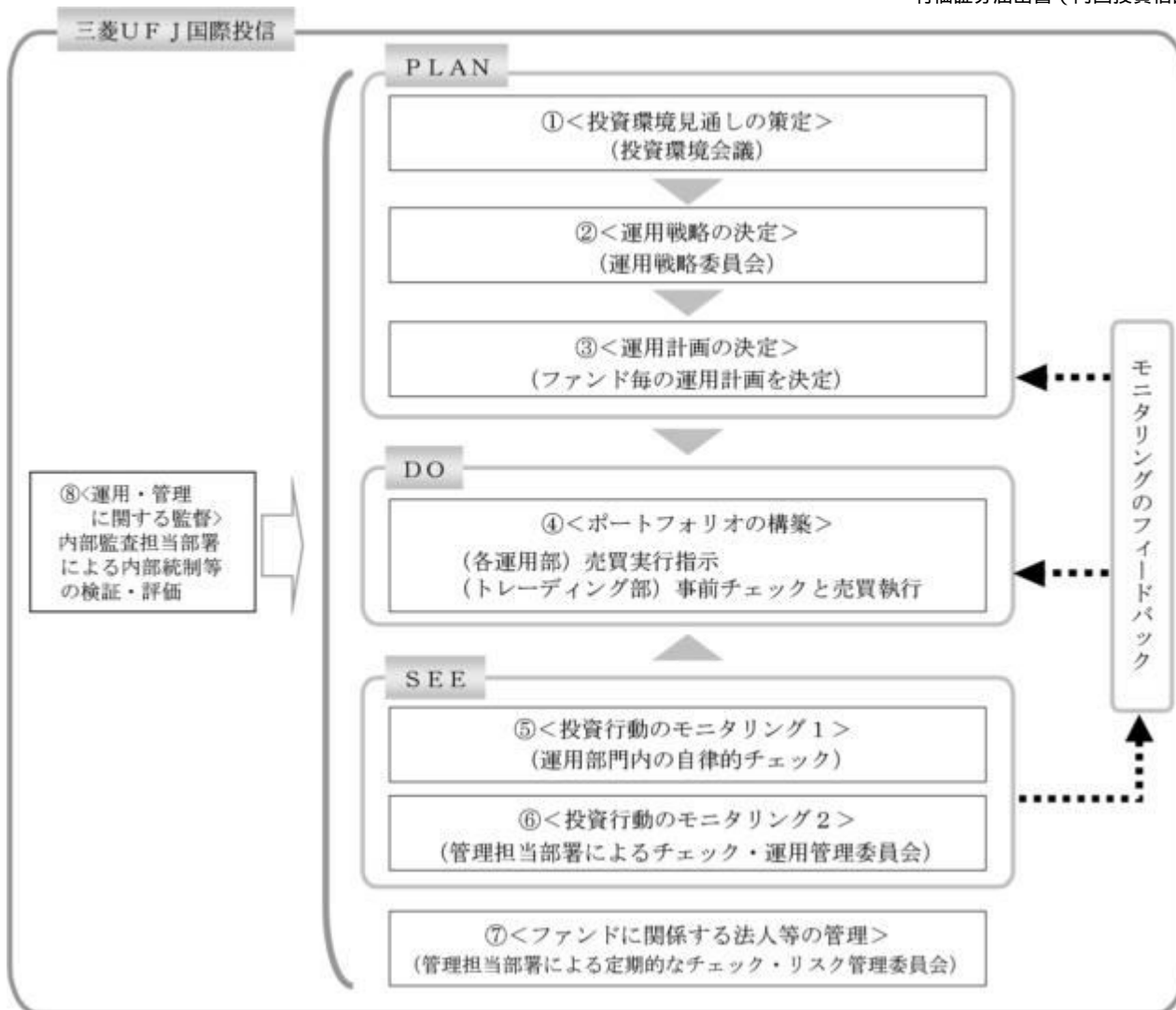
投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

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。

#### ファンドに関する法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に関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)【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

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

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

#### (5)【投資制限】

##### < 信託約款に定められた投資制限 >

###### 株式

a. 委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式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50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株式の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

###### 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

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

b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

###### 同一銘柄の転換社債等

a. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債(新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしま

せん。

- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

#### 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（ に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、 ）の行使により取得可能な株券
  6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（ 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。

#### 有価証券の借入れ

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

#### 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、為替先渡取引および直物為替先渡取引

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

#### 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ます。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

- 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。)

<b>価格変動 リスク</b>	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、ファンドはその影響を受け組入株式や組入公社債、組入不動産投資信託証券の価格の下落は基準価額の下落要因となります。
<b>為替変動 リスク</b>	組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。
<b>信用リスク</b>	組入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は、当該組入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・償還金の支払いが滞ることがあります。
<b>流動性 リスク</b>	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場合または取引が不可能となる場合、市場実勢から期待される価格より不利な価格での取引となる可能性があります。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、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。
<b>カントリー・ リスク</b>	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。



### 留意事項

- ・ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・ファンドは、合成ベンチマーク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の違いが生じること、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。



- 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。

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知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPI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、NOMURA-BPI(国債)はそのサブインデックスです。わが国の国債で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI(国債)は野村證券株式会社の知的財産であり、運用成果等に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。
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。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

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

## （２）【換金（解約）手数料】

かかりません。

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

## （３）【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年0.2376%（税抜0.2200%）の率を乗じて得た額とします。

1万口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額×信託報酬率×（保有日数／365）  
上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

- ・信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

- ・信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.10%	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等
販売会社	0.10%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	0.02%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

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いません。

## （４）【その他の手数料等】

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

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。

### 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。

上記は平成30年6月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## 5【運用状況】

## 【つみたて8資産均等バランス】

## (1)【投資状況】

平成30年 6月29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	1,784,650,163	99.01
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		17,915,884	0.99
純資産総額		1,802,566,047	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30年 6月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	MUAM G-REITマザーファンド	139,577,730	1.6153	225,471,253	1.6273	227,134,840	12.60
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	112,800,132	1.9972	225,293,917	2.0090	226,615,465	12.57
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	85,093,912	2.6788	227,955,758	2.6558	225,992,411	12.54
日本	親投資信託受益証券	TOPIXマザーファンド	122,598,077	1.8335	224,790,966	1.8383	225,372,044	12.50
日本	親投資信託受益証券	東証REIT指数マザーファンド	81,083,841	2.7421	222,340,383	2.7702	224,618,456	12.46
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	174,079,793	1.2936	225,195,787	1.2903	224,615,156	12.46

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	92,491,070	2.4722	228,657,133	2.4089	222,801,738	12.36
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	155,874,439	1.3311	207,497,073	1.3312	207,500,053	11.51

（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30年 6月29日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.01
合計	99.01

（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30年6月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末日 (平成30年 6月25日)	1,719,844,704	1,719,844,704	10,352	10,352
平成29年 8月末日	10,098,503		10,099	
9月末日	10,261,104		10,261	
10月末日	14,580,955		10,366	
11月末日	16,247,870		10,481	
12月末日	17,012,508		10,651	
平成30年 1月末日	155,089,571		10,666	
2月末日	352,471,989		10,339	
3月末日	635,408,531		10,229	
4月末日	928,789,541		10,422	
5月末日	1,368,235,852		10,320	
6月末日	1,802,566,047		10,336	

## 【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	3.52

（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	1,686,339,471	24,944,050	1,661,395,421

## （参考）

## TOPIXマザーファンド

## 投資状況

平成30年 6月29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	267,118,439,590	99.39
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		1,626,359,013	0.61
純資産総額		268,744,798,603	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30年 6月29日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	2,440,005,000	0.91

(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30年 6月29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	1,312,500	6,769.89	8,885,491,341	7,170.00	9,410,625,000	3.50
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,454,700	687.64	5,126,189,430	631.10	4,704,661,170	1.75
日本	株式	ソニー	電気機器	722,800	5,130.39	3,708,247,910	5,664.00	4,093,939,200	1.52
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	760,300	4,938.04	3,754,395,343	5,036.00	3,828,870,800	1.42
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	479,600	8,080.91	3,875,605,514	7,973.00	3,823,850,800	1.42
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	806,000	4,459.59	3,594,433,784	4,306.00	3,470,636,000	1.29
日本	株式	キーエンス	電気機器	53,000	64,144.48	3,399,657,740	62,560.00	3,315,680,000	1.23
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	971,500	3,497.81	3,398,128,903	3,253.00	3,160,289,500	1.18
日本	株式	KDDI	情報・通信業	933,600	2,722.24	2,541,483,656	3,031.00	2,829,741,600	1.05
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	14,469,300	191.45	2,770,187,432	186.50	2,698,524,450	1.00
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	795,900	2,616.74	2,082,670,488	3,066.00	2,440,229,400	0.91
日本	株式	任天堂	その他製品	66,500	46,389.46	3,084,899,342	36,200.00	2,407,300,000	0.90
日本	株式	三菱商事	卸売業	746,200	2,863.04	2,136,405,501	3,078.00	2,296,803,600	0.85
日本	株式	ファナック	電気機器	102,600	25,752.04	2,642,159,656	22,005.00	2,257,713,000	0.84
日本	株式	花王	化学	265,500	7,603.25	2,018,664,770	8,450.00	2,243,475,000	0.83
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	96,700	19,979.66	1,932,033,546	22,960.00	2,220,232,000	0.83
日本	株式	日本電産	電気機器	129,900	16,080.29	2,088,830,342	16,625.00	2,159,587,500	0.80
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	445,700	4,460.28	1,987,947,702	4,831.00	2,153,176,700	0.80
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	760,700	2,707.49	2,059,587,891	2,822.50	2,147,075,750	0.80
日本	株式	キヤノン	電気機器	581,200	3,798.14	2,207,481,286	3,631.00	2,110,337,200	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	113,300	14,454.27	1,637,668,927	18,620.00	2,109,646,000	0.78
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	401,200	4,878.37	1,957,203,192	5,193.00	2,083,431,600	0.78
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	670,400	2,927.65	1,962,699,268	3,095.00	2,074,888,000	0.77
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	193,900	9,827.32	1,905,518,120	10,615.00	2,058,248,500	0.77
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,592,000	765.84	1,985,072,000	781.60	2,025,907,200	0.75
日本	株式	ダイキン工業	機械	147,400	11,786.79	1,737,373,550	13,270.00	1,955,998,000	0.73
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	397,800	5,343.01	2,125,452,104	4,678.00	1,860,908,400	0.69
日本	株式	パナソニック	電気機器	1,233,400	1,562.84	1,927,618,223	1,493.50	1,842,082,900	0.69
日本	株式	信越化学工業	化学	186,300	10,772.53	2,006,922,490	9,873.00	1,839,339,900	0.68
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,061,800	1,610.80	1,710,353,415	1,689.00	1,793,380,200	0.67



（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30年 6月29日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式	水産・農林業	0.11
	鉱業	0.29
	建設業	3.16
	食料品	4.47
	繊維製品	0.65
	パルプ・紙	0.27
	化学	7.37
	医薬品	4.71
	石油・石炭製品	0.76
	ゴム製品	0.81
	ガラス・土石製品	0.99
	鉄鋼	1.02
	非鉄金属	0.85
	金属製品	0.62
	機械	5.11
	電気機器	13.54
	輸送用機器	8.55
	精密機器	1.72
	その他製品	2.07
	電気・ガス業	1.75
	陸運業	4.35
	海運業	0.19
	空運業	0.58
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	7.47
	卸売業	4.76
	小売業	5.01
	銀行業	6.61
	証券、商品先物取引業	0.92
	保険業	2.25
	その他金融業	1.20
	不動産業	2.42
サービス業	4.66	
	小計	99.39
合計		99.39

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

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

平成30年 6月29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 18年09月限	買建	141	円	2,442,336,140	2,440,005,000	0.91

（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30年 6月29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	213,707,213,674	63.41
	イギリス	22,676,544,712	6.73
	フランス	12,493,304,304	3.71
	カナダ	12,286,159,803	3.65
	ドイツ	11,979,823,056	3.55
	スイス	9,869,914,662	2.93
	オーストラリア	8,386,286,938	2.49
	オランダ	5,348,403,641	1.59
	香港	4,114,257,723	1.22
	スペイン	3,903,449,945	1.16
	スウェーデン	3,243,106,814	0.96
	イタリア	2,517,023,650	0.75
	デンマーク	2,103,849,395	0.62
	シンガポール	1,511,946,248	0.45
	ベルギー	1,373,326,475	0.41
	フィンランド	1,301,843,535	0.39
	ノルウェー	950,696,289	0.28
	アイルランド	676,694,856	0.20
	ルクセンブルグ	395,695,928	0.12
	イスラエル	354,722,453	0.11
オーストリア	309,480,073	0.09	
ニュージーランド	276,886,879	0.08	

	ポルトガル	207,561,359	0.06
	小計	319,988,192,412	94.95
投資証券	アメリカ	6,091,333,875	1.81
	オーストラリア	560,198,191	0.17
	イギリス	290,054,288	0.09
	オランダ	269,856,792	0.08
	フランス	199,665,296	0.06
	香港	176,068,640	0.05
	シンガポール	119,393,804	0.04
	カナダ	62,819,771	0.02
	小計	7,769,390,657	2.31
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		9,254,191,729	2.74
純資産総額		337,011,774,798	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30年 6月29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	6,793,865,778	2.02
	買建	カナダ	366,984,379	0.11
	買建	ドイツ	1,500,192,435	0.45
	買建	オーストラリア	475,873,544	0.14
	買建	イギリス	698,751,417	0.21
	買建	スイス	290,209,550	0.09

（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30年 6月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	414,111	20,859.37	8,638,094,915	20,505.17	8,491,416,454	2.52
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	597,016	10,811.16	6,454,439,160	10,902.56	6,509,002,880	1.93

アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	33,586	177,412.90	5,958,589,799	188,078.28	6,316,797,213	1.87
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	195,475	20,681.42	4,042,700,620	21,691.26	4,240,099,870	1.26
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	280,070	12,577.83	3,522,673,879	11,598.96	3,248,521,343	0.96
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	25,682	121,486.21	3,120,008,931	123,165.87	3,163,146,099	0.94
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	345,963	8,986.42	3,108,969,528	9,060.96	3,134,758,219	0.93
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	24,363	122,065.59	2,973,884,047	124,554.26	3,034,515,466	0.90
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	218,999	14,054.38	3,077,896,004	13,485.87	2,953,394,234	0.88
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	794,090	3,415.82	2,712,471,526	3,169.18	2,516,615,576	0.75
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	381,828	6,021.39	2,299,135,815	5,928.26	2,263,575,736	0.67
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	155,915	14,335.02	2,235,045,160	13,890.45	2,165,730,510	0.64
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	147,093	14,582.40	2,144,970,121	14,673.07	2,158,307,298	0.64
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	104,203	22,014.69	2,293,997,333	20,680.92	2,155,014,803	0.64
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	253,822	8,596.86	2,182,072,247	8,460.14	2,147,370,670	0.64
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	78,981	26,365.91	2,082,406,241	27,071.24	2,138,114,080	0.63
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	592,632	3,496.39	2,072,072,776	3,558.28	2,108,752,134	0.63
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	381,965	6,048.33	2,310,251,847	5,444.09	2,079,453,747	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	95,357	21,044.17	2,006,709,055	21,578.51	2,057,662,302	0.61
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	486,033	3,926.51	1,908,416,405	4,019.23	1,953,480,553	0.58
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	337,036	5,373.97	1,811,224,614	5,622.06	1,894,838,097	0.56
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	393,392	5,072.86	1,995,624,350	4,746.58	1,867,269,589	0.55
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	205,504	8,112.64	1,667,180,856	8,627.64	1,773,015,969	0.53
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	45,636	37,925.20	1,730,754,793	36,992.21	1,688,176,541	0.50
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	1,631,785	1,063.78	1,735,868,870	1,026.29	1,674,700,652	0.50
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	76,170	21,397.71	1,629,863,940	21,787.43	1,659,548,848	0.49
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	330,702	4,661.21	1,541,473,283	4,805.17	1,589,080,586	0.47
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	209,782	8,042.77	1,687,229,016	7,392.91	1,550,900,536	0.46
アメリカ	株式	NETFLIX INC	小売	35,423	36,188.87	1,281,918,507	43,709.72	1,548,329,652	0.46
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	220,142	6,603.47	1,453,703,188	6,665.56	1,467,370,150	0.44

（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30年 6月29日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	エネルギー	7.08
	素材	4.68
	資本財	6.95
	商業・専門サービス	1.07
	運輸	1.92
	自動車・自動車部品	1.37
	耐久消費財・アパレル	1.81
	消費者サービス	1.77
	メディア	1.96
	小売	4.79
	食品・生活必需品小売り	1.46
	食品・飲料・タバコ	4.74
	家庭用品・パーソナル用品	1.83
	ヘルスケア機器・サービス	4.60
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.63
	銀行	8.69
	各種金融	4.33
	保険	3.68
	不動産	0.62
	ソフトウェア・サービス	11.38
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.24	
電気通信サービス	2.32	
公益事業	3.03	
半導体・半導体製造装置	3.01	
	小計	94.95
投資証券		2.31
合計		97.25

（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30年 6月29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 EMINI1809	買建	452	アメリカドル	62,681,006.5	6,928,758,459	61,460,700	6,793,865,778	2.02
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE601809	買建	23	カナダドル	4,412,216.25	367,934,712	4,400,820	366,984,379	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 1809	買建	350	ユーロ	12,049,382.5	1,541,236,516	11,728,500	1,500,192,435	0.45
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 1809	買建	38	オーストラリアドル	5,783,627	469,399,167	5,863,400	475,873,544	0.14
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 1809	買建	64	イギリスポンド	4,868,318.6	703,910,186	4,832,640	698,751,417	0.21
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX1809	買建	31	スイスフラン	2,652,621.6	294,122,683	2,617,330	290,209,550	0.09

（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30年 6月29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	15,583,635,263	22.83
	韓国	9,635,038,739	14.11
	アメリカ	8,347,572,867	12.23
	台湾	7,615,113,114	11.15
	インド	5,701,663,335	8.35
	南アフリカ	3,990,332,768	5.85
	ブラジル	3,831,039,206	5.61
	メキシコ	1,858,444,696	2.72
	マレーシア	1,538,242,130	2.25
	タイ	1,456,469,386	2.13
	インドネシア	1,228,890,008	1.80
	チリ	731,794,261	1.07
	ポーランド	728,417,747	1.07
	フィリピン	619,981,568	0.91
	カタール	549,524,146	0.80
	トルコ	490,544,970	0.72
	アラブ首長国連邦	375,888,811	0.55
	コロンビア	311,817,867	0.46
	ギリシャ	204,226,210	0.30
ハンガリー	174,574,590	0.26	

	チェコ	121,615,189	0.18
	小計	65,094,826,871	95.35
投資証券	南アフリカ	183,255,167	0.27
	メキシコ	60,056,505	0.09
	トルコ	13,046,427	0.02
	小計	256,358,099	0.38
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		2,917,098,098	4.27
純資産総額		68,268,283,068	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30年 6月29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	2,760,263,388	4.04
	買建	香港	257,857,567	0.38

（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30年 6月29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 (%)
香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	657,800	5,752.19	3,783,793,159	5,340.11	3,512,724,358	5.15
アメリカ	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ソフトウェア・サービス	133,435	21,480.10	2,866,197,324	20,823.52	2,778,587,085	4.07
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	555,502	5,051.52	2,806,131,111	4,623.84	2,568,552,368	3.76
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,843,000	838.55	2,384,006,896	765.32	2,175,804,760	3.19
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	50,570	25,640.52	1,296,641,547	26,239.99	1,326,956,618	1.94
香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	11,109,550	114.82	1,275,599,778	99.75	1,108,257,601	1.62
アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	31,866	29,801.08	949,641,324	26,773.89	853,176,887	1.25
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	710,500	1,038.37	737,768,559	974.32	692,256,847	1.01
香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	8,023,350	95.98	770,135,762	80.87	648,901,269	0.95

香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	602,000	1,095.93	659,751,034	1,003.91	604,355,325	0.89
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	182,410	3,109.07	567,126,775	3,042.36	554,956,888	0.81
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	67,221	8,502.93	571,575,736	8,249.80	554,559,806	0.81
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	1,896,840	306.13	580,694,423	290.60	551,231,188	0.81
ブラジル	株式	VALE SA	素材	365,130	1,504.56	549,362,614	1,403.89	512,603,342	0.75
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	328,326	1,601.22	525,722,872	1,530.81	502,607,679	0.74
香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	9,181,000	59.29	544,418,272	53.96	495,449,911	0.73
アメリカ	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	303,344	1,728.18	524,235,534	1,509.97	458,042,281	0.67
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	372,787	1,363.86	508,431,520	1,134.38	422,884,540	0.62
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	201,655	1,919.26	387,029,800	2,089.15	421,287,947	0.62
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	2,074,000	194.61	403,640,168	189.93	393,921,457	0.58
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	99,073	4,032.61	399,522,838	3,675.35	364,128,941	0.53
アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	48,480	7,837.26	379,950,535	7,417.23	359,587,504	0.53
アメリカ	株式	JD.COM INC-ADR	小売	83,458	4,081.44	340,629,344	4,303.32	359,146,664	0.53
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	3,880,200	94.28	365,838,096	92.17	357,661,315	0.52
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	107,059	2,805.25	300,327,934	2,985.17	319,589,743	0.47
アメリカ	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	608,964	529.00	322,144,813	478.63	291,473,433	0.43
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	382,728	929.45	355,729,213	755.59	289,185,488	0.42
香港	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	2,940,000	113.77	334,492,990	98.34	289,143,708	0.42
韓国	株式	POSCO	素材	9,017	35,282.68	318,143,930	31,813.59	286,863,231	0.42
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	544,300	620.23	337,591,532	515.26	280,459,338	0.41

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

#### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成30年 6月29日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	エネルギー	6.85
	素材	7.27
	資本財	3.33
	商業・専門サービス	0.15
	運輸	1.45
	自動車・自動車部品	2.61
	耐久消費財・アパレル	1.06
	消費者サービス	1.30
	メディア	2.32



小売	2.03
食品・生活必需品小売り	1.77
食品・飲料・タバコ	3.34
家庭用品・パーソナル用品	1.27
ヘルスケア機器・サービス	0.60
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.41
銀行	15.93
各種金融	2.45
保険	3.44
不動産	2.38
ソフトウェア・サービス	13.92
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.87
電気通信サービス	4.14
公益事業	2.31
半導体・半導体製造装置	5.16
小計	95.35
投資証券	0.38
合計	95.73

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

平成30年 6月29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 1809	買建	478	アメリカドル	26,443,728.96	2,923,089,798	24,970,720	2,760,263,388	4.04
	香港	香港先物取引所	HANG IDX1809	買建	13	香港ドル	18,781,335.5	264,629,017	18,300,750	257,857,567	0.38

（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30年 6月29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	464,391,869,880	83.73
地方債証券	日本	32,219,505,521	5.81
特殊債券	日本	39,725,689,119	7.16
社債券	日本	23,503,433,940	4.24
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		5,239,337,467	0.94
純資産総額		554,601,160,993	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30年 6月29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	1,960,920,000	0.35

（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30年 6月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第329回利付国債（10年）	7,060,000,000	104.58	7,383,348,000	104.51	7,378,970,800	0.800000	2023/6/20	1.33
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	103.28	7,085,008,000	1.200000	2020/12/20	1.28
日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	6,290,000,000	103.82	6,530,824,500	103.82	6,530,278,000	0.600000	2023/12/20	1.18
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	6,450,000,000	100.62	6,490,611,100	100.72	6,496,827,000	0.100000	2028/3/20	1.17
日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	6,010,000,000	100.94	6,066,914,700	100.96	6,067,996,500	0.100000	2022/12/20	1.09
日本	国債証券	第319回利付国債（10年）	5,519,000,000	104.39	5,761,394,480	104.24	5,753,502,310	1.100000	2021/12/20	1.04
日本	国債証券	第135回利付国債（5年）	5,580,000,000	101.03	5,637,655,000	101.01	5,636,860,200	0.100000	2023/3/20	1.02
日本	国債証券	第385回利付国債（2年）	5,350,000,000	100.42	5,372,560,000	100.38	5,370,437,000	0.100000	2020/2/15	0.97
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	5,090,000,000	100.81	5,131,534,400	101.01	5,141,765,300	0.100000	2026/12/20	0.93
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	4,870,000,000	103.59	5,044,890,300	103.62	5,046,537,500	0.500000	2024/9/20	0.91
日本	国債証券	第386回利付国債（2年）	4,950,000,000	100.44	4,971,813,500	100.40	4,969,800,000	0.100000	2020/3/15	0.90
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	4,680,000,000	104.07	4,870,730,800	104.10	4,872,254,400	0.600000	2024/6/20	0.88

日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	4,660,000,000	100.98	4,705,958,000	101.11	4,712,098,800	0.100000	2026/6/20	0.85
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	4,560,000,000	103.16	4,704,506,400	103.25	4,708,382,400	0.400000	2025/6/20	0.85
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	4,620,000,000	100.89	4,661,349,000	100.91	4,662,088,200	0.100000	2022/9/20	0.84
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	4,480,000,000	103.96	4,657,647,400	103.96	4,657,542,400	0.600000	2024/3/20	0.84
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	100.50	4,422,000,000	0.100000	2020/9/20	0.80
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	4,250,000,000	100.84	4,285,827,500	100.85	4,286,380,000	0.100000	2022/6/20	0.77
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	4,170,000,000	102.58	4,277,951,400	102.66	4,281,005,400	0.300000	2025/12/20	0.77
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	103.73	4,232,469,600	0.500000	2024/12/20	0.76
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	100.80	4,223,645,700	0.100000	2027/12/20	0.76
日本	国債証券	第383回利付国債(2年)	4,190,000,000	100.38	4,205,963,900	100.34	4,204,329,800	0.100000	2019/12/15	0.76
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	3,930,000,000	104.74	4,116,670,800	104.72	4,115,535,300	0.800000	2023/9/20	0.74
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	103.87	3,983,759,650	0.800000	2022/9/20	0.72
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	3,700,000,000	103.40	3,826,133,000	103.36	3,824,505,000	0.600000	2023/3/20	0.69
日本	国債証券	第309回利付国債(10年)	3,700,000,000	102.58	3,795,756,000	102.41	3,789,355,000	1.100000	2020/6/20	0.68
日本	国債証券	第306回利付国債(10年)	3,688,000,000	102.83	3,792,444,160	102.62	3,784,957,520	1.400000	2020/3/20	0.68
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	3,633,000,000	104.07	3,780,971,330	103.94	3,776,358,180	1.200000	2021/6/20	0.68
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	3,570,000,000	103.24	3,685,775,100	103.33	3,689,059,500	0.400000	2025/9/20	0.67
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	3,580,000,000	100.98	3,615,345,400	101.16	3,621,563,800	0.100000	2026/3/20	0.65

(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30年 6月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	83.73
地方債証券	5.81
特殊債券	7.16
社債券	4.24
合計	100.94

(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

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 18年09月限	買建	13	円	1,959,084,040	1,960,920,000	0.35

（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30年 6月29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	52,136,081,568	43.99
	フランス	11,893,760,347	10.03
	イタリア	10,746,971,886	9.07
	ドイツ	8,314,386,381	7.01
	イギリス	8,158,584,039	6.88
	スペイン	6,895,927,595	5.82
	ベルギー	2,987,314,914	2.52
	オランダ	2,547,984,896	2.15
	オーストラリア	2,480,249,391	2.09
	カナダ	2,444,185,383	2.06
	オーストリア	1,825,971,229	1.54
	アイルランド	1,005,544,396	0.85
	メキシコ	940,116,943	0.79
	フィンランド	734,256,853	0.62
	ポーランド	732,151,014	0.62
	デンマーク	704,816,630	0.59
	南アフリカ	660,690,692	0.56
	マレーシア	534,937,647	0.45
	シンガポール	483,374,707	0.41
	スウェーデン	445,233,150	0.38
ノルウェー	277,265,347	0.23	
スイス	154,693,785	0.13	
	小計	117,104,498,793	98.80
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		1,424,845,014	1.20
純資産総額		118,529,343,807	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30年 6月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 270215	5,750,000	10,435.66	600,050,845	10,548.79	606,555,865	2.250000	2027/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	1.75 T-NOTE 220630	5,450,000	10,606.31	578,044,058	10,660.20	580,980,968	1.750000	2022/6/30	0.49
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 220831	5,100,000	10,528.93	536,975,685	10,588.52	540,014,671	1.625000	2022/8/31	0.46
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 261115	5,150,000	10,245.95	527,666,559	10,361.39	533,611,987	2.000000	2026/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	2.125 T-NOTE 250515	4,900,000	10,485.75	513,802,010	10,579.88	518,414,464	2.125000	2025/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 241115	4,650,000	10,616.15	493,651,344	10,698.19	497,466,270	2.250000	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 280215	4,400,000	10,838.96	476,914,465	10,959.86	482,234,203	2.750000	2028/2/15	0.41
フランス	国債証券	4.5 O.A.T 410425	2,320,000	20,561.61	477,029,478	20,642.11	478,897,087	4.500000	2041/4/25	0.40
アメリカ	国債証券	2.5 T-NOTE 240515	4,350,000	10,813.92	470,405,560	10,884.73	473,485,999	2.500000	2024/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 190630	4,250,000	10,967.64	466,124,726	10,973.68	466,381,645	1.625000	2019/6/30	0.39
フランス	国債証券	4.25 O.A.T 231025	2,950,000	15,679.28	462,538,894	15,765.48	465,081,751	4.250000	2023/10/25	0.39
フランス	国債証券	5.75 O.A.T 321025	2,140,000	20,876.21	446,750,998	21,085.23	451,224,017	5.750000	2032/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	2.125 T-NOTE 211231	4,060,000	10,813.05	439,010,127	10,857.10	440,798,285	2.125000	2021/12/31	0.37
フランス	国債証券	3 O.A.T 220425	3,000,000	14,396.52	431,895,790	14,434.64	433,039,305	3.000000	2022/4/25	0.37
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 260815	4,250,000	9,869.01	419,432,976	9,984.00	424,320,312	1.500000	2026/8/15	0.36
フランス	国債証券	3.5 O.A.T 260425	2,650,000	15,839.86	419,756,363	15,999.28	423,981,179	3.500000	2026/4/25	0.36
イタリア	国債証券	4.75 ITALY GOVT 210901	3,000,000	14,703.89	441,116,822	14,130.47	423,914,206	4.750000	2021/9/1	0.36
フランス	国債証券	6 O.A.T 251025	2,300,000	18,104.91	416,413,130	18,210.54	418,842,575	6.000000	2025/10/25	0.35
アメリカ	国債証券	2.375 T-NOTE 240815	3,800,000	10,718.06	407,286,357	10,794.05	410,174,214	2.375000	2024/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	3 T-BOND 441115	3,550,000	10,846.73	385,059,181	11,106.67	394,287,111	3.000000	2044/11/15	0.33
フランス	国債証券	3.5 O.A.T 200425	2,800,000	13,790.67	386,138,878	13,741.32	384,757,000	3.500000	2020/4/25	0.32
アメリカ	国債証券	2.375 T-NOTE 210415	3,500,000	10,957.70	383,519,825	10,987.07	384,547,502	2.375000	2021/4/15	0.32
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 250215	3,600,000	10,423.57	375,248,756	10,515.11	378,544,230	2.000000	2025/2/15	0.32
フランス	国債証券	2.75 O.A.T 271025	2,450,000	15,219.14	372,868,957	15,389.03	377,031,264	2.750000	2027/10/25	0.32
アメリカ	国債証券	1.75 T-NOTE 211130	3,500,000	10,679.20	373,772,010	10,731.01	375,585,557	1.750000	2021/11/30	0.32
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 260215	3,700,000	10,035.82	371,325,449	10,144.63	375,351,523	1.625000	2026/2/15	0.32
フランス	国債証券	3.25 O.A.T 211025	2,600,000	14,342.54	372,906,256	14,359.73	373,353,225	3.250000	2021/10/25	0.31
アメリカ	国債証券	2.5 T-NOTE 230815	3,400,000	10,864.00	369,376,319	10,927.91	371,549,121	2.500000	2023/8/15	0.31
アメリカ	国債証券	1.75 T-NOTE 230515	3,500,000	10,501.40	367,549,175	10,561.75	369,661,303	1.750000	2023/5/15	0.31
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 271115	3,500,000	10,387.30	363,555,697	10,509.07	367,817,531	2.250000	2027/11/15	0.31

（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30年 6月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.80
合計	98.80

（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30年 6月29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	メキシコ	1,748,396,680	10.19
	ブラジル	1,655,598,950	9.65
	ポーランド	1,520,525,579	8.87
	インドネシア	1,466,182,409	8.55
	南アフリカ	1,340,825,144	7.82
	タイ	1,329,178,379	7.75
	コロンビア	1,293,687,245	7.54
	ロシア	1,277,111,116	7.45
	トルコ	969,166,298	5.65
	マレーシア	933,947,602	5.45
	ハンガリー	736,349,711	4.29
	チェコ	719,519,578	4.20
	ペルー	481,119,715	2.81
	チリ	438,021,320	2.55
	ルーマニア	419,338,817	2.45
	アルゼンチン	133,838,606	0.78
	フィリピン	42,838,650	0.25
ウルグアイ	32,769,607	0.19	

	ドミニカ共和国	18,217,940	0.11
	小計	16,556,633,346	96.54
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		593,162,434	3.46
純資産総額		17,149,795,780	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30年 6月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
チリ	国債証券	5.5 CHILE (GL) 200805	2,480,000,000	17.80	441,529,171	17.66	438,021,320	5.500000	2020/8/5	2.55
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 200701	18,000,000	2,352.58	423,466,079	2,417.57	435,163,247		2020/7/1	2.54
ブラジル	国債証券	10(IN)BRAZIL NTN- F210101	9,600,000	2,987.56	286,806,436	3,044.70	292,291,387	10.000000	2021/1/1	1.70
コロンビア	国債証券	10 TITULOS DE TES 240724	6,450,000,000	4.50	290,834,268	4.45	287,350,522	10.000000	2024/7/24	1.68
ブラジル	国債証券	10(IN)BRAZIL NTN- F230101	8,900,000	2,950.69	262,612,209	2,937.65	261,451,021	10.000000	2023/1/1	1.52
南アフリカ	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	27,400,000	903.76	247,632,293	874.26	239,547,295	10.500000	2026/12/21	1.40
メキシコ	国債証券	8 MEXICAN BONOS 200611	42,000,000	566.46	237,913,674	563.05	236,481,840	8.000000	2020/6/11	1.38
メキシコ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	35,400,000	637.55	225,694,258	627.50	222,137,832	10.000000	2024/12/5	1.30
コロンビア	国債証券	7.5 TITULOS DE TE 260826	5,520,000,000	4.02	222,273,555	3.97	219,478,585	7.500000	2026/8/26	1.28
タイ	国債証券	3.65 THAILAND 211217	62,200,000	357.88	222,602,166	352.73	219,403,684	3.650000	2021/12/17	1.28
メキシコ	国債証券	6.5 MEXICAN BONOS 210610	36,900,000	544.97	201,095,111	541.81	199,930,399	6.500000	2021/6/10	1.17
ブラジル	国債証券	10 (IN)BRAZIL NTN 250101	6,750,000	2,913.90	196,688,847	2,839.45	191,663,132	10.000000	2025/1/1	1.12
南アフリカ	国債証券	8.75 SOUTH AFRICA 480228	25,200,000	745.65	187,906,271	724.28	182,520,122	8.750000	2048/2/28	1.06
ブラジル	国債証券	10 (IN)BRAZIL NT 270101	6,270,000	2,953.76	185,201,316	2,761.72	173,159,872	10.000000	2027/1/1	1.01
コロンビア	国債証券	7 TITULOS DE TESO 220504	4,410,000,000	3.94	173,993,654	3.91	172,443,445	7.000000	2022/5/4	1.01
インドネシア	国債証券	8.375 INDONESIA 240315	22,000,000,000	0.86	190,989,614	0.77	171,517,500	8.375000	2024/3/15	1.00
タイ	国債証券	3.85 THAILAND 251212	46,500,000	372.76	173,334,827	364.03	169,277,824	3.850000	2025/12/12	0.99
コロンビア	国債証券	11 TITULOS DE TES 200724	4,020,000,000	4.25	170,984,082	4.16	167,584,496	11.000000	2020/7/24	0.98
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 200101	6,600,000	2,492.31	164,492,850	2,538.02	167,509,811		2020/1/1	0.98
ポーランド	国債証券	1.75 POLAND 210725	5,700,000	2,891.03	164,789,203	2,916.93	166,265,079	1.750000	2021/7/25	0.97
メキシコ	国債証券	6.5 MEXICAN BONOS 220609	30,700,000	539.98	165,774,587	536.14	164,597,927	6.500000	2022/6/9	0.96

ポーランド	国債証券	1.5 POLAND 200425	5,300,000	2,920.68	154,796,309	2,929.53	155,265,328	1.500000	2020/4/25	0.91
タイ	国債証券	4.875 THAILAND 290622	38,200,000	411.69	157,266,941	397.26	151,756,911	4.875000	2029/6/22	0.88
タイ	国債証券	3.625 THAILAND 230616	42,400,000	363.14	153,974,253	357.01	151,372,649	3.625000	2023/6/16	0.88
インドネシア	国債証券	8.375 INDONESIA 260915	18,130,000,000	0.87	159,108,951	0.77	141,136,611	8.375000	2026/9/15	0.82
ポーランド	国債証券	2.5 POLAND 260725	5,000,000	2,767.09	138,354,894	2,805.69	140,284,987	2.500000	2026/7/25	0.82
インドネシア	国債証券	8.25 INDONESIA 210715	17,700,000,000	0.83	148,214,957	0.77	137,891,406	8.250000	2021/7/15	0.80
チェコ	国債証券	5.7 CZECH REPUBLI 240525	22,500,000	625.28	140,688,450	609.00	137,026,761	5.700000	2024/5/25	0.80
ポーランド	国債証券	2.5 POLAND 270725	4,900,000	2,743.59	134,436,054	2,776.64	136,055,450	2.500000	2027/7/25	0.79
ロシア	国債証券	8.15 RUSSIA GOVT 270203	74,500,000	185.15	137,939,550	181.16	134,971,371	8.150000	2027/2/3	0.79

（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30年 6月29日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	96.54
合計	96.54

（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。

#### 東証REIT指数マザーファンド

#### 投資状況

平成30年 6月29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	22,362,906,360	98.66
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		302,757,369	1.34
純資産総額		22,665,663,729	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30年 6月29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	302,404,000	1.33

（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30年 6月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	2,615	582,907	1,524,301,805	639,000	1,670,985,000	7.37
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,687	561,494.81	1,508,736,554	586,000	1,574,582,000	6.95
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	7,993	150,818.35	1,205,491,071	156,300	1,249,305,900	5.51
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,957	170,240.15	1,014,120,573	171,900	1,024,008,300	4.52
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	5,100	214,765.86	1,095,305,886	199,600	1,017,960,000	4.49
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	5,359	171,082.51	916,831,171	176,900	948,007,100	4.18
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	3,600	249,627.98	898,660,728	229,800	827,280,000	3.65
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3,143	266,835.47	838,663,882	262,900	826,294,700	3.65
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,501	285,419.33	713,833,744	283,800	709,783,800	3.13
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,705	384,773.57	656,038,936	402,500	686,262,500	3.03
日本	投資証券	GLP投資法人	5,607	125,151.27	701,723,170	117,600	659,383,200	2.91
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	7,795	81,658.72	636,529,722	83,000	646,985,000	2.85
日本	投資証券	アクティブア・プロパティーズ投資法人	1,222	484,173.56	591,660,090	508,000	620,776,000	2.74
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	833	689,493.83	574,348,360	688,000	573,104,000	2.53
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	6,767	73,352.48	496,376,232	72,600	491,284,200	2.17
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	897	497,942.79	446,654,682	504,000	452,088,000	1.99
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	2,901	142,050.84	412,089,486	142,100	412,232,100	1.82
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	919	459,090.75	421,904,399	445,000	408,955,000	1.80
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,799	213,489.47	384,067,556	225,700	406,034,300	1.79
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,137	125,959.42	395,134,700	123,400	387,105,800	1.71
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	7,407	50,426.51	373,509,159	49,900	369,609,300	1.63
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	576	616,658.87	355,195,509	636,000	366,336,000	1.62
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	2,419	139,069.51	336,409,144	142,700	345,191,300	1.52
日本	投資証券	イオンリート投資法人	2,565	123,344.38	316,378,334	127,700	327,550,500	1.45
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	1,834	170,663.37	312,996,620	171,600	314,714,400	1.39
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	1,930	164,297.95	317,095,043	158,700	306,291,000	1.35

日本	投資証券	プレミアム投資法人	2,439	115,684.26	282,153,910	112,400	274,143,600	1.21
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	3,038	86,097.81	261,565,146	89,100	270,685,800	1.19
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	1,811	144,922.8	262,455,190	149,000	269,839,000	1.19
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,024	249,130.42	255,109,550	261,000	267,264,000	1.18

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

#### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成30年 6月29日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.66
合計	98.66

(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30年 6月29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 18年09月限	買建	173	円	298,615,756	302,404,000	1.33

(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30年 6月29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	14,079,007,154	71.21
	オーストラリア	1,316,160,805	6.66
	イギリス	1,105,195,926	5.59
	シンガポール	626,984,569	3.17
	オランダ	585,768,560	2.96
	フランス	465,679,480	2.36
	香港	427,820,728	2.16
	カナダ	345,481,331	1.75
	スペイン	202,489,497	1.02

	ベルギー	145,834,118	0.74
	ニュージーランド	81,530,800	0.41
	ドイツ	50,225,771	0.25
	アイルランド	49,403,625	0.25
	イタリア	21,642,270	0.11
	イスラエル	12,650,739	0.06
	小計	19,515,875,373	98.71
	コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	255,927,139	1.29
	純資産総額	19,771,802,512	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30年 6月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	47,877	18,341.90	878,155,251	18,925.55	906,098,720	4.58
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	82,685	6,913.94	571,679,669	7,201.68	595,470,993	3.01
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	23,246	22,374.37	520,114,808	25,305.92	588,261,467	2.98
オランダ	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	20,887	26,000.39	543,070,334	23,931.96	499,866,869	2.53
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,441	19,185.80	411,362,892	18,947.66	406,256,808	2.05
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	57,202	6,903.14	394,873,647	6,997.18	400,252,805	2.02
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	57,542	6,869.62	395,291,913	6,893.27	396,652,796	2.01
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	31,905	12,330.85	393,416,049	12,202.51	389,321,101	1.97
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	54,875	6,422.82	352,452,450	6,349.41	348,424,291	1.76
香港	投資証券	LINK REIT	334,000	1,028.61	343,556,722	1,000.39	334,130,260	1.69
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	23,969	13,925.22	333,773,659	13,810.86	331,032,686	1.67
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	828,425	336.31	278,615,555	356.29	295,161,531	1.49
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,269	26,282.99	269,900,113	26,042.11	267,426,516	1.35
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	43,820	6,071.48	266,052,619	6,002.32	263,021,750	1.33
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	113,146	2,189.75	247,762,396	2,305.86	260,899,333	1.32
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	15,921	13,977.52	222,536,231	13,965.62	222,346,693	1.12
アメリカ	投資証券	GGP INC	97,446	2,556.11	249,082,702	2,264.96	220,711,740	1.12
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	26,885	8,207.20	220,650,795	8,144.58	218,967,227	1.11
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	19,651	9,332.52	183,393,417	11,065.05	217,439,376	1.10
アメリカ	投資証券	HCP INC	71,796	2,769.33	198,827,304	2,840.87	203,963,677	1.03
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	249,905	685.85	171,398,418	782.38	195,521,274	0.99
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,405	10,604.50	184,571,346	11,192.17	194,799,806	0.99
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	55,560	2,904.87	161,394,890	3,203.44	177,983,638	0.90
アメリカ	投資証券	UDR INC	41,444	4,127.34	171,053,616	4,150.77	172,024,802	0.87
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	43,081	4,049.96	174,476,419	3,830.21	165,009,320	0.83

イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	116,033	1,403.77	162,884,736	1,386.61	160,893,458	0.81
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	23,209	7,308.14	169,614,847	6,904.32	160,242,558	0.81
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,324	14,092.31	159,581,380	13,946.83	157,933,923	0.80
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	13,675	10,906.98	149,152,976	11,142.43	152,372,758	0.77
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	155,022	960.79	148,943,974	968.75	150,178,028	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30年 6月29日現在

種類	投資比率 (%)
投資証券	98.71
合計	98.71

(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

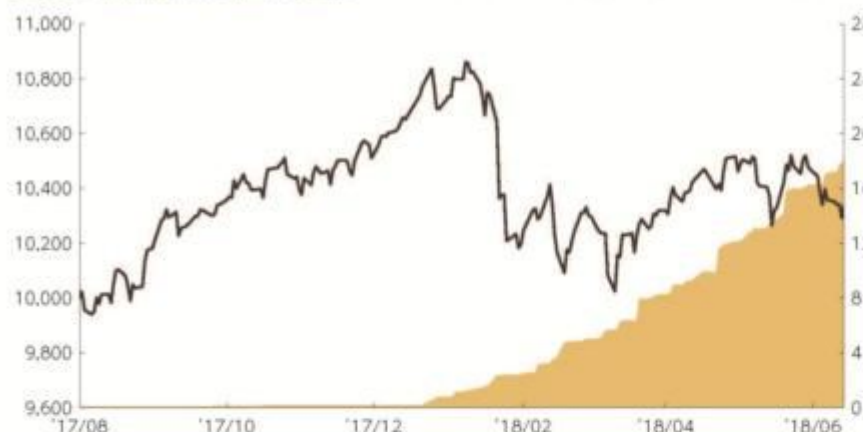
該当事項はありません。

#### 参考情報



2018年6月29日現在

## ■基準価額・純資産の推移 2017年8月16日(設定日)～2018年6月29日



■純資産総額(億円)【右目盛】

■基準価額【左目盛】

- 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	10,336円
純資産総額	18.0億円

## ■分配の推移

2018年6月	0円
設定来累計	0円

\*分配金は1万口当たり、税引前

## ■主要な資産の状況

資産別構成	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄	種類	業種/種別	国・地域	比率
国内株式	12.4%	円	37.1%	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ソフトウェア・サービス	香港	0.6%
国内債券	11.6%	アメリカドル	25.0%	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	株式	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.5%
国内リート	12.3%	ユーロ	7.6%	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	0.5%
外国株式	23.7%	香港ドル	3.3%	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	日本	0.4%
外国債券	24.5%	イギリスポンド	2.5%	5.5 CHILE (GL) 200805	債券	国債	チリ	0.3%
外国リート	12.8%	ブラジルレアル	1.9%	BRAZIL-LTN 200701	債券	国債	ブラジル	0.3%
コールローン他 (負債控除後)	2.7%	南アフリカランド	1.8%	10(IN)BRAZIL NTN-F210101	債券	国債	ブラジル	0.2%
合計	100.0%	韓国ウォン	1.8%	日本ビルファンド投資法人	リート	-	日本	0.9%
		その他	19.0%	ジャパンリアルエステイト投資法人	リート	-	日本	0.9%
		合計	100.0%	野村不動産マスターファンド投資法人	リート	-	日本	0.7%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	1.0%
債券先物取引 (買建)	0.0%
不動産投信指数先物取引 (買建)	0.2%

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

## ■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2017年は設定日から年末までの、2018年は年初から6月29日までの収益率を表示
- 2016年以前はベンチマークの年間収益率を表示

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

## 1【申込（販売）手続等】

### 申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。  
ただし、以下の日は申込みができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

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

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/>

### 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

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、ファンドの運用規模・運用効率等を勘案し、市況動向や資金流入の動向等に応じて、取得申込みの受付を中止することがあります。

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

## 2【換金（解約）手続等】

### 解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

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

### 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

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

### 信託財産留保額

ありません。

### 解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

### 解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ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/>

### 支払開始日

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

### 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

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/>

#### （２）【保管】

該当事項はありません。

#### （３）【信託期間】

無期限（平成29年8月16日設定）

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

#### （４）【計算期間】

毎年6月26日から翌年6月25日まで

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

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

#### （５）【その他】

##### ファンドの償還条件等

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

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

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

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

##### 信託約款の変更等

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

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

### ファンドの償還等に関する開示方法

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

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

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

### 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 当ファンドの第1計算期間は、約款の規定に従い、平成29年8月16日から平成30年6月25日までとしております。
- 3 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29年8月16日から平成30年6月25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】

## 【つみたて8資産均等バランス】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期
		[平成30年6月25日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		19,752,202
親投資信託受益証券		1,702,719,404
流動資産合計		1,722,471,606
資産合計		1,722,471,606
負債の部		
流動負債		
未払解約金		1,834,490
未払受託者報酬		70,887
未払委託者報酬		708,768
未払利息		41
その他未払費用		12,716
流動負債合計		2,626,902
負債合計		2,626,902
純資産の部		
元本等		
元本		1,661,395,421
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		58,449,283
(分配準備積立金)		10,162,754
元本等合計		1,719,844,704
純資産合計		1,719,844,704
負債純資産合計		1,722,471,606

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 平成29年 8月16日 至 平成30年 6月25日
営業収益	
受取利息	11
有価証券売買等損益	5,738,357
営業収益合計	5,738,346
営業費用	
支払利息	2,539
受託者報酬	75,284
委託者報酬	752,692
その他費用	13,456
営業費用合計	843,971
営業利益又は営業損失（ ）	6,582,317
経常利益又は経常損失（ ）	6,582,317
当期純利益又は当期純損失（ ）	6,582,317
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（ ）	346,961
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	65,788,208
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	65,788,208
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,103,569
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,103,569
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	58,449,283

## (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。
--------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 [平成30年 6月25日現在]
1. 期首元本額	10,000,000円
期中追加設定元本額	1,676,339,471円
期中一部解約元本額	24,944,050円
2. 受益権の総数	1,661,395,421口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成29年 8月16日 至 平成30年 6月25日		
1. 分配金の計算過程		
項目		
費用控除後の配当等収益額	A	10,162,754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	48,286,529円
分配準備積立金額	D	円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	58,449,283円
当ファンドの期末残存口数	F	1,661,395,421口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	351円
1万口当たり分配金額	H	円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	円

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第1期 自 平成29年 8月16日 至 平成30年 6月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、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。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第1期 [ 平成30年 6月25日現在 ]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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1期 [ 平成30年 6月25日現在 ]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	5,489,720
合計	5,489,720



（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1期 [平成30年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	1.0352円
(1万口当たり純資産額)	(10,352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	134,649,863	217,526,853	
	新興国株式インデックスマザーファンド	86,181,558	213,282,119	
	東証REIT指数マザーファンド	78,730,828	215,761,834	
	新興国債券インデックスマザーファンド	166,454,704	215,342,450	
	TOPIXマザーファンド	116,175,601	212,996,346	
	外国株式インデックスマザーファンド	79,919,918	214,273,292	
	日本債券インデックスマザーファンド	149,143,886	198,540,341	
	外国債券インデックスマザーファンド	107,648,793	214,996,169	
	合計	918,905,151	1,702,719,404	

## 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30年 6月25日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	38,523,363,896
株式	264,707,379,160
未収入金	1,260,000
未収配当金	1,196,520,083
前払金	60,920,000
その他未収収益	58,469,364
差入委託証拠金	113,925,000
流動資産合計	304,661,837,503
資産合計	304,661,837,503
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	100,582,700
未払金	687,180,347
未払解約金	624,236,953
未払利息	81,574
受入担保金	34,131,342,378
流動負債合計	35,543,423,952
負債合計	35,543,423,952
純資産の部	
元本等	
元本	146,789,768,943
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	122,328,644,608
元本等合計	269,118,413,551
純資産合計	269,118,413,551
負債純資産合計	304,661,837,503

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## (貸借対照表に関する注記)

	[平成30年 6月25日現在]
1. 期首	平成29年 8月16日
期首元本額	166,528,688,787円
期中追加設定元本額	108,931,790,680円
期中一部解約元本額	128,670,710,524円
元本の内訳	
ファンド・マネジャー（国内株式）	2,824,827,351円
eMAXIS TOPIXインデックス	11,303,103,759円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,787,437,061円
eMAXIS バランス（波乗り型）	88,349,980円
コアバランス	734,421円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	21,748,830円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	34,687,835円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	30,917,017円
eMAXIS Slim 国内株式（TOPIX）	1,523,864,325円
国内株式セレクション（ラップ向け）	1,003,584,734円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	864,969,759円
つみたて日本株式（TOPIX）	1,319,585,571円
つみたて8資産均等バランス	116,175,601円
つみたて4資産均等バランス	24,836,700円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,268,961円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,524,366円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	1,989,418円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	2,018,172円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	2,367,172円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	2,661,457円
eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）	49,965,776円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	2,565,008,871円

[平成30年 6月25日現在]

三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	4,885,396,128円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	522,494,125円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	270,764,336円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	1,354,792,722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)	220,437,107円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	132,340,901円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	36,177,963円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	48,978,458円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	199,842,315円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	140,674,314円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	428,656,438円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	55,109,264円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	9,627,779,803円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)	269,987,436円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	2,733,310,367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)	24,828,446,388円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)	492,303,874円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投資家限定)	31,280,587円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	7,154,423円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定)	110,166,220円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	45,562,870円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	415,536,558円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	871,415,990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)	2,336,286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)	238,751,514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 バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	3,440,332,774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)	971,910,223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)	206,574,164円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	34,068,818円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	1,851,730,538円

	[平成30年 6月25日現在]
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）	39,519,722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）	1,038,312,640円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	8,830,241,628円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	6,214,459円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	19,390,329円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	22,057,565円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	24,122,310円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	1,886,128,198円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	379,322,434円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	48,469,342円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	318,920,996円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	33,193,430円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	234,515,723円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,898,362,532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）	473,566,057円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	1,877,319,400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）	1,586,723,151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）	1,296,450,629円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	48,685,296,281円
合計	146,789,768,943円
2. 貸付有価証券 貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っております。 株式	32,069,199,540円
3. 受益権の総数	146,789,768,943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29年 8月16日 至 平成30年 6月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

区分	自 平成29年 8月16日 至 平成30年 6月25日
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>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30年 6月25日現在 ]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券          売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引          デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品          上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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30年 6月25日現在 ]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	5,940,639,585
合計	5,940,639,585

(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30年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,503,020,000		4,402,575,000	100,445,000
合計		4,503,020,000		4,402,575,000	100,445,000

(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30年 6月25日現在]
1口当たり純資産額		1.8334円
(1万口当たり純資産額)		(18,334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	4,700	3,590.00	16,873,000	貸付有価証券 3,700株(3,700株)

1332	日本水産	135,000	540.00	72,900,000	貸付有価証券 85,900株(85,900株)
1333	マルハニチロ	22,700	4,265.00	96,815,500	貸付有価証券 15,500株(15,500株)
1376	カネコ種苗	4,100	1,645.00	6,744,500	
1377	サカタのタネ	17,700	4,045.00	71,596,500	
1379	ホクト	12,200	1,926.00	23,497,200	
1384	ホクリヨウ	2,000	845.00	1,690,000	
1514	住石ホールディングス	31,300	147.00	4,601,100	貸付有価証券 23,400株(23,400株)
1515	日鉄鉱業	3,300	5,140.00	16,962,000	
1518	三井松島産業	6,100	1,549.00	9,448,900	
1605	国際石油開発帝石	583,200	1,129.50	658,724,400	
1606	日本海洋掘削	2,800	979.00	2,741,200	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
1662	石油資源開発	19,000	2,676.00	50,844,000	貸付有価証券 8,800株(8,800株)
1663	K & Oエナジーグループ	7,100	1,849.00	13,127,900	
1413	ヒノキヤグループ	3,000	2,907.00	8,721,000	
1414	ショーボンドホールディングス	11,300	7,540.00	85,202,000	貸付有価証券 8,500株(8,500株)
1417	ミライト・ホールディングス	36,900	1,711.00	63,135,900	貸付有価証券 17,500株(17,500株)
1419	タマホーム	9,000	1,015.00	9,135,000	貸付有価証券 3,800株(3,800株)
1420	サンヨーホームズ	2,100	1,338.00	2,809,800	
1429	日本アクア	3,500	352.00	1,232,000	
1430	ファーストコーポレーション	4,000	1,082.00	4,328,000	
1433	ペステラ	2,200	1,266.00	2,785,200	
1435	TATERU	11,500	1,970.00	22,655,000	
1712	ダイセキ環境ソリューション	2,800	1,107.00	3,099,600	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
1716	第一カッター興業	1,600	2,743.00	4,388,800	
1719	安藤・間	93,300	972.00	90,687,600	貸付有価証券 59,100株(59,100株)
1720	東急建設	46,100	1,030.00	47,483,000	
1721	コムシスホールディングス	42,200	2,955.00	124,701,000	
1722	ミサワホーム	10,000	931.00	9,310,000	
1726	ピーアールホールディングス	11,900	488.00	5,807,200	
1762	高松コンストラクショングループ	7,800	3,150.00	24,570,000	
1766	東建コーポレーション	4,500	9,770.00	43,965,000	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
1768	ソネック	1,500	890.00	1,335,000	
1780	ヤマウラ	5,600	894.00	5,006,400	貸付有価証券 4,100株(4,100株)
1801	大成建設	119,400	6,000.00	716,400,000	
1802	大林組	359,700	1,133.00	407,540,100	



1803	清水建設	366,900	1,106.00	405,791,400	
1805	飛鳥建設	109,100	192.00	20,947,200	
1808	長谷工コーポレーション	139,900	1,494.00	209,010,600	
1810	松井建設	13,200	931.00	12,289,200	
1811	銭高組	1,700	5,660.00	9,622,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
1812	鹿島建設	527,000	851.00	448,477,000	
1813	不動テトラ	90,700	204.00	18,502,800	
1814	大木建設	3,900	1,393.00	5,432,700	
1815	鉄建建設	7,300	2,950.00	21,535,000	
1820	西松建設	27,700	3,125.00	86,562,500	
1821	三井住友建設	86,500	765.00	66,172,500	
1822	大豊建設	43,000	644.00	27,692,000	
1824	前田建設工業	85,500	1,283.00	109,696,500	
1826	佐田建設	7,700	480.00	3,696,000	
1827	ナカノフドー建設	9,200	642.00	5,906,400	
1833	奥村組	19,700	3,600.00	70,920,000	貸付有価証券 11,000株(11,000株)
1835	東鉄工業	14,400	3,420.00	49,248,000	貸付有価証券 10,600株(10,600株)
1847	イチケン	2,200	2,554.00	5,618,800	
1848	富士ピー・エス	3,400	775.00	2,635,000	
1852	浅沼組	42,000	373.00	15,666,000	
1860	戸田建設	139,000	950.00	132,050,000	
1861	熊谷組	18,800	3,850.00	72,380,000	
1865	青木あすなろ建設	7,900	972.00	7,678,800	
1866	北野建設	25,000	428.00	10,700,000	
1867	植木組	1,500	2,628.00	3,942,000	
1868	三井ホーム	15,000	691.00	10,365,000	
1870	矢作建設工業	16,300	878.00	14,311,400	
1871	ピーエス三菱	14,200	583.00	8,278,600	
1873	日本ハウスホールディングス	22,900	541.00	12,388,900	貸付有価証券 8,400株(8,400株)
1878	大東建託	42,700	18,095.00	772,656,500	貸付有価証券 23,400株(23,400株)
1879	新日本建設	14,300	1,271.00	18,175,300	
1881	N I P P O	27,800	1,990.00	55,322,000	
1882	東亜道路工業	2,400	3,790.00	9,096,000	
1883	前田道路	37,600	2,089.00	78,546,400	
1884	日本道路	3,200	5,620.00	17,984,000	
1885	東亜建設工業	9,700	2,870.00	27,839,000	貸付有価証券 7,700株(7,700株)
1888	若築建設	6,500	1,643.00	10,679,500	
1890	東洋建設	37,600	471.00	17,709,600	
1893	五洋建設	142,600	718.00	102,386,800	

1898	世紀東急工業	16,100	713.00	11,479,300	
1899	福田組	3,900	6,670.00	26,013,000	
1911	住友林業	76,600	1,627.00	124,628,200	
1914	日本基礎技術	13,300	376.00	5,000,800	
1916	日成ビルド工業	17,700	1,125.00	19,912,500	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
1919	ヤマダ・エスバイエルホーム	54,000	70.00	3,780,000	貸付有価証券 42,000株(42,000株)
1921	巴コーポレーション	14,900	453.00	6,749,700	貸付有価証券 11,000株(11,000株)
1925	大和ハウス工業	354,300	3,694.00	1,308,784,200	
1926	ライト工業	23,100	1,137.00	26,264,700	
1928	積水ハウス	390,200	1,911.50	745,867,300	
1929	日特建設	10,200	663.00	6,762,600	
1930	北陸電気工事	6,600	1,169.00	7,715,400	
1934	ユアテック	16,800	917.00	15,405,600	
1937	西部電気工業	2,000	3,815.00	7,630,000	
1939	四電工	1,800	2,661.00	4,789,800	
1941	中電工	15,500	2,784.00	43,152,000	貸付有価証券 12,800株(12,800株)
1942	関電工	47,800	1,197.00	57,216,600	
1944	きんでん	79,700	1,773.00	141,308,100	
1945	東京エネシス	13,600	1,246.00	16,945,600	
1946	トーエネック	3,400	3,285.00	11,169,000	
1949	住友電設	9,500	2,010.00	19,095,000	
1950	日本電設工業	18,400	2,426.00	44,638,400	貸付有価証券 12,600株(12,600株)
1951	協和エクシオ	43,100	2,999.00	129,256,900	
1952	新日本空調	9,200	1,713.00	15,759,600	
1956	N D S	1,900	6,030.00	11,457,000	
1959	九電工	23,600	5,370.00	126,732,000	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
1961	三機工業	25,400	1,054.00	26,771,600	
1963	日揮	103,300	2,172.00	224,367,600	貸付有価証券 62,000株(62,000株)
1964	中外炉工業	3,600	2,632.00	9,475,200	貸付有価証券 100株(100株)
1967	ヤマト	9,800	688.00	6,742,400	
1968	太平電業	8,100	2,778.00	22,501,800	
1969	高砂熱学工業	33,000	2,080.00	68,640,000	
1972	三晃金属工業	1,300	3,455.00	4,491,500	
1975	朝日工業社	2,500	3,430.00	8,575,000	
1976	明星工業	21,700	815.00	17,685,500	
1979	大気社	15,200	3,390.00	51,528,000	
1980	ダイダン	8,000	2,448.00	19,584,000	

1982	日比谷総合設備	13,400	2,188.00	29,319,200	
1983	東芝プラントシステム	26,000	2,539.00	66,014,000	
5912	OSJBホールディングス	52,900	272.00	14,388,800	
6330	東洋エンジニアリング	14,100	755.00	10,645,500	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
6366	千代田化工建設	77,900	945.00	73,615,500	
6379	新興プランテック	23,100	1,036.00	23,931,600	
2001	日本製粉	35,700	1,918.00	68,472,600	
2002	日清製粉グループ本社	131,500	2,342.00	307,973,000	
2003	日東富士製粉	800	5,060.00	4,048,000	
2004	昭和産業	9,900	2,925.00	28,957,500	
2009	鳥越製粉	9,500	995.00	9,452,500	
2053	中部飼料	13,100	2,004.00	26,252,400	
2060	フィード・ワン	72,200	213.00	15,378,600	
2107	東洋精糖	1,800	1,224.00	2,203,200	
2108	日本甜菜製糖	6,100	2,286.00	13,944,600	
2109	三井製糖	8,500	3,410.00	28,985,000	
2112	塩水港精糖	12,800	260.00	3,328,000	
2117	日新製糖	5,100	2,154.00	10,985,400	
2201	森永製菓	25,200	5,260.00	132,552,000	
2204	中村屋	2,800	4,785.00	13,398,000	
2206	江崎グリコ	30,000	5,260.00	157,800,000	貸付有価証券 20,400株(20,400株)
2207	名糖産業	5,200	1,773.00	9,219,600	
2209	井村屋グループ	4,200	3,330.00	13,986,000	
2211	不二家	6,900	2,493.00	17,201,700	
2212	山崎製パン	87,800	2,774.00	243,557,200	
2215	第一屋製パン	1,800	1,167.00	2,100,600	
2217	モロゾフ	1,800	6,730.00	12,114,000	
2220	亀田製菓	6,700	6,020.00	40,334,000	貸付有価証券 4,900株(4,900株)
2222	寿スピリッツ	10,300	5,740.00	59,122,000	
2229	カルビー	48,900	4,110.00	200,979,000	貸付有価証券 22,600株(22,600株)
2264	森永乳業	21,500	4,075.00	87,612,500	
2266	六甲バター	7,100	2,314.00	16,429,400	
2267	ヤクルト本社	62,500	7,230.00	451,875,000	
2269	明治ホールディングス	71,000	9,310.00	661,010,000	
2270	雪印メグミルク	25,900	2,900.00	75,110,000	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
2281	プリマハム	76,000	618.00	46,968,000	貸付有価証券 19,000株(19,000株)
2282	日本ハム	46,400	4,395.00	203,928,000	
2286	林兼産業	3,800	787.00	2,990,600	貸付有価証券 100株(100株)

2288	丸大食品	57,000	495.00	28,215,000	
2292	S Foods	7,500	4,300.00	32,250,000	貸付有価証券 5,500株(5,500株)
2296	伊藤ハム米久ホールディングス	69,200	937.00	64,840,400	
2501	サッポロホールディングス	39,300	2,771.00	108,900,300	貸付有価証券 18,900株(18,900株)
2502	アサヒグループホールディングス	225,000	5,546.00	1,247,850,000	
2503	キリンホールディングス	516,400	2,938.50	1,517,441,400	
2531	宝ホールディングス	80,400	1,470.00	118,188,000	
2533	オエノンホールディングス	30,500	410.00	12,505,000	
2540	養命酒製造	3,300	2,470.00	8,151,000	
2579	コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	75,400	4,230.00	318,942,000	
2587	サントリー食品インターナショナル	82,200	4,685.00	385,107,000	
2590	ダイトーグループホールディングス	5,500	6,370.00	35,035,000	貸付有価証券 4,400株(4,400株)
2593	伊藤園	35,600	5,190.00	184,764,000	貸付有価証券 16,800株(16,800株)
2594	キーコーヒー	10,600	2,184.00	23,150,400	貸付有価証券 7,800株(7,800株)
2597	ユニカフェ	3,200	1,195.00	3,824,000	
2599	ジャパンフーズ	1,500	1,471.00	2,206,500	
2602	日清オイリオグループ	12,700	3,140.00	39,878,000	
2607	不二製油グループ本社	29,100	3,820.00	111,162,000	
2612	かどや製油	1,200	6,100.00	7,320,000	
2613	J-オイルミルズ	5,600	3,945.00	22,092,000	
2801	キッコーマン	83,900	5,660.00	474,874,000	貸付有価証券 50,000株(50,000株)
2802	味の素	247,100	2,062.50	509,643,750	
2809	キューピー	59,800	2,805.00	167,739,000	
2810	ハウス食品グループ本社	41,000	3,810.00	156,210,000	貸付有価証券 21,700株(21,700株)
2811	カゴメ	43,000	3,705.00	159,315,000	貸付有価証券 31,800株(31,800株)
2812	焼津水産化学工業	5,200	1,246.00	6,479,200	
2815	アリアケジャパン	9,800	9,310.00	91,238,000	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
2818	ピエトロ	1,400	1,646.00	2,304,400	
2819	エバラ食品工業	2,300	2,220.00	5,106,000	
2871	ニチレイ	51,200	2,786.00	142,643,200	
2875	東洋水産	59,000	3,875.00	228,625,000	貸付有価証券 30,000株(30,000株)
2882	イトアアンド	2,900	2,092.00	6,066,800	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
2883	大冷	1,200	1,994.00	2,392,800	
2884	ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,200	1,192.00	2,622,400	貸付有価証券 1,000株(1,000株)

2897	日清食品ホールディングス	46,800	8,130.00	380,484,000	貸付有価証券 24,100株(24,100株)
2899	永谷園ホールディングス	11,000	1,496.00	16,456,000	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
2904	一正蒲鉾	4,200	1,331.00	5,590,200	
2908	フジッコ	11,600	2,882.00	33,431,200	
2910	ロック・フィールド	11,600	1,917.00	22,237,200	
2914	日本たばこ産業	664,700	3,211.00	2,134,351,700	
2915	ケンコーマヨネーズ	7,100	4,090.00	29,039,000	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
2918	わらべや日洋ホールディングス	7,000	2,510.00	17,570,000	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
2922	なとり	6,000	1,888.00	11,328,000	
2924	イフジ産業	1,900	779.00	1,480,100	
2925	ビックルスコーポレーション	2,100	2,210.00	4,641,000	
2930	北の達人コーポレーション	32,800	790.00	25,912,000	貸付有価証券 15,500株(15,500株)
2931	ユーグレナ	42,800	848.00	36,294,400	貸付有価証券 33,200株(33,200株)
4404	ミヨシ油脂	4,100	1,370.00	5,617,000	
4526	理研ビタミン	4,100	4,505.00	18,470,500	
3001	片倉工業	12,900	1,295.00	16,705,500	貸付有価証券 10,000株(10,000株)
3002	ゲンゼ	8,400	6,810.00	57,204,000	
3101	東洋紡	41,400	1,813.00	75,058,200	
3103	ユニチカ	32,600	620.00	20,212,000	
3104	富士紡ホールディングス	6,200	3,545.00	21,979,000	
3106	倉敷紡績	113,000	356.00	40,228,000	
3109	シキボウ	5,500	1,273.00	7,001,500	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
3201	日本毛織	31,600	1,021.00	32,263,600	
3202	ダイトウボウ	16,900	98.00	1,656,200	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
3204	トーア紡コーポレーション	4,800	561.00	2,692,800	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
3205	ダイドーリミテッド	12,500	447.00	5,587,500	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
3302	帝国繊維	11,700	2,296.00	26,863,200	貸付有価証券 8,600株(8,600株)
3401	帝人	92,100	1,998.00	184,015,800	貸付有価証券 47,200株(47,200株)
3402	東レ	813,300	861.20	700,413,960	貸付有価証券 418,000株(418,000株)
3408	サカイオーベックス	2,800	2,245.00	6,286,000	
3501	住江織物	2,800	2,703.00	7,568,400	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
3512	日本フェルト	5,900	516.00	3,044,400	

3513	イチカワ	7,000	351.00	2,457,000	
3524	日東製網	1,200	1,820.00	2,184,000	
3529	アツギ	7,500	1,169.00	8,767,500	
3551	ダイニック	4,200	1,019.00	4,279,800	貸付有価証券 2,900株(2,900株)
3569	セーレン	25,800	1,722.00	44,427,600	貸付有価証券 20,600株(20,600株)
3571	ソトー	4,200	1,028.00	4,317,600	貸付有価証券 900株(900株)
3577	東海染工	1,600	1,429.00	2,286,400	
3580	小松精練	17,200	950.00	16,340,000	貸付有価証券 12,700株(12,700株)
3591	ワコールホールディングス	31,000	3,145.00	97,495,000	
3593	ホギメディカル	14,100	4,765.00	67,186,500	
3606	レナウン	30,300	147.00	4,454,100	貸付有価証券 22,300株(22,300株)
3607	クラウディアホールディングス	2,600	591.00	1,536,600	
3608	T S Iホールディングス	38,700	784.00	30,340,800	貸付有価証券 27,700株(27,700株)
3611	マツオカコーポレーション	2,600	3,755.00	9,763,000	
8011	三陽商会	5,900	2,266.00	13,369,400	貸付有価証券 4,600株(4,600株)
8013	ナイガイ	4,100	551.00	2,259,100	
8016	オンワードホールディングス	65,000	830.00	53,950,000	
8029	ルックホールディングス	19,000	283.00	5,377,000	貸付有価証券 15,000株(15,000株)
8107	キムラタン	51,200	38.00	1,945,600	貸付有価証券 28,100株(28,100株)
8111	ゴールドウイン	6,300	9,750.00	61,425,000	貸付有価証券 5,200株(5,200株)
8114	デサント	25,600	1,952.00	49,971,200	
8118	キング	5,600	516.00	2,889,600	
8127	ヤマトインターナショナル	6,900	609.00	4,202,100	
3708	特種東海製紙	6,100	4,380.00	26,718,000	
3861	王子ホールディングス	472,000	662.00	312,464,000	
3863	日本製紙	50,200	1,760.00	88,352,000	貸付有価証券 35,500株(35,500株)
3864	三菱製紙	15,900	630.00	10,017,000	
3865	北越紀州製紙	62,600	557.00	34,868,200	
3877	中越パルプ工業	4,400	1,657.00	7,290,800	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
3878	巴川製紙所	17,000	253.00	4,301,000	
3880	大王製紙	44,700	1,559.00	69,687,300	貸付有価証券 36,700株(36,700株)
3896	阿波製紙	2,700	641.00	1,730,700	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
3941	レンゴー	108,100	953.00	103,019,300	
3946	トーモク	6,400	2,061.00	13,190,400	

3950	ザ・パック	7,900	3,595.00	28,400,500	
3405	クラレ	188,700	1,539.00	290,409,300	
3407	旭化成	699,200	1,396.50	976,432,800	
3553	共和レザー	6,500	1,009.00	6,558,500	
4004	昭和電工	74,600	4,730.00	352,858,000	
4005	住友化学	825,000	616.00	508,200,000	
4008	住友精化	4,600	5,590.00	25,714,000	
4021	日産化学工業	65,200	5,220.00	340,344,000	
4022	ラサ工業	4,000	2,837.00	11,348,000	
4023	クレハ	9,700	7,620.00	73,914,000	貸付有価証券 6,200株(6,200株)
4025	多木化学	1,500	4,915.00	7,372,500	
4027	テイカ	8,500	2,219.00	18,861,500	貸付有価証券 6,500株(6,500株)
4028	石原産業	20,100	1,002.00	20,140,200	
4031	片倉コープアグリ	2,700	1,201.00	3,242,700	
4033	日東エフシー	6,600	748.00	4,936,800	
4041	日本曹達	78,000	592.00	46,176,000	
4042	東ソー	162,100	1,690.00	273,949,000	
4043	トクヤマ	32,500	3,415.00	110,987,500	
4044	セントラル硝子	22,900	2,267.00	51,914,300	
4045	東亜合成	65,800	1,323.00	87,053,400	
4046	大阪ソーダ	10,800	3,150.00	34,020,000	貸付有価証券 7,200株(7,200株)
4047	関東電化工業	26,800	953.00	25,540,400	貸付有価証券 20,000株(20,000株)
4061	デンカ	41,200	3,660.00	150,792,000	
4063	信越化学工業	186,700	9,800.00	1,829,660,000	
4064	日本カーバイド工業	3,500	1,890.00	6,615,000	
4078	堺化学工業	7,700	2,909.00	22,399,300	貸付有価証券 200株(200株)
4082	第一稀元素化学工業	11,300	1,148.00	12,972,400	
4088	エア・ウォーター	92,500	1,967.00	181,947,500	
4091	大陽日酸	86,400	1,591.00	137,462,400	
4092	日本化学工業	4,200	4,735.00	19,887,000	
4093	東邦アセチレン	1,600	1,513.00	2,420,800	
4095	日本パーカライジング	57,300	1,572.00	90,075,600	
4097	高压ガス工業	16,600	1,009.00	16,749,400	
4098	チタン工業	1,200	2,443.00	2,931,600	貸付有価証券 900株(900株)
4099	四国化成工業	16,200	1,525.00	24,705,000	
4100	戸田工業	2,200	2,771.00	6,096,200	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
4109	ステラ ケミファ	5,700	3,730.00	21,261,000	貸付有価証券 4,200株(4,200株)

4112	保土谷化学工業	3,600	3,315.00	11,934,000	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
4114	日本触媒	17,600	7,860.00	138,336,000	
4116	大日精化工業	8,700	3,375.00	29,362,500	
4118	カネカ	151,000	1,001.00	151,151,000	
4182	三菱瓦斯化学	92,400	2,468.00	228,043,200	
4183	三井化学	101,900	2,877.00	293,166,300	
4185	J S R	112,700	1,831.00	206,353,700	
4186	東京応化工業	19,500	4,130.00	80,535,000	
4187	大阪有機化学工業	9,700	1,497.00	14,520,900	
4188	三菱ケミカルホールディングス	750,900	904.20	678,963,780	
4189	K Hネオケム	17,100	3,365.00	57,541,500	貸付有価証券 10,100株(10,100株)
4202	ダイセル	151,200	1,179.00	178,264,800	
4203	住友ベークライト	91,000	1,028.00	93,548,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
4204	積水化学工業	232,900	1,798.00	418,754,200	
4205	日本ゼオン	94,500	1,288.00	121,716,000	
4206	アイカ工業	31,400	3,840.00	120,576,000	
4208	宇部興産	56,500	2,840.00	160,460,000	
4212	積水樹脂	17,300	2,333.00	40,360,900	
4215	タキロンシーアイ	22,700	597.00	13,551,900	
4216	旭有機材	6,600	2,292.00	15,127,200	
4217	日立化成	55,400	2,162.00	119,774,800	
4218	ニチバン	5,500	3,050.00	16,775,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
4220	リケンテクノス	24,200	550.00	13,310,000	
4221	大倉工業	27,000	522.00	14,094,000	
4228	積水化成品工業	14,100	1,142.00	16,102,200	
4229	群栄化学工業	2,700	3,505.00	9,463,500	
4231	タイガースポリマー	5,500	770.00	4,235,000	
4238	ミライアル	3,700	1,245.00	4,606,500	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
4245	ダイキアクシス	3,700	1,323.00	4,895,100	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
4246	ダイキョーニシカワ	22,100	1,643.00	36,310,300	
4248	竹本容器	1,700	3,000.00	5,100,000	
4249	森六ホールディングス	5,600	3,060.00	17,136,000	
4272	日本化薬	72,800	1,212.00	88,233,600	
4275	カーリットホールディングス	10,400	971.00	10,098,400	貸付有価証券 7,600株(7,600株)
4362	日本精化	9,300	1,244.00	11,569,200	
4368	扶桑化学工業	10,600	2,819.00	29,881,400	貸付有価証券 4,500株(4,500株)
4369	トリケミカル研究所	2,600	4,340.00	11,284,000	



4401	A D E K A	48,200	1,776.00	85,603,200	
4403	日油	43,300	3,610.00	156,313,000	
4406	新日本理化	17,700	243.00	4,301,100	貸付有価証券 9,900株(9,900株)
4410	ハリマ化成グループ	8,700	865.00	7,525,500	
4452	花王	263,200	8,514.00	2,240,884,800	
4461	第一工業製薬	21,000	730.00	15,330,000	貸付有価証券 18,000株(18,000株)
4462	石原ケミカル	2,600	2,181.00	5,670,600	
4463	日華化学	3,500	1,178.00	4,123,000	
4465	ニイタカ	1,600	1,721.00	2,753,600	
4471	三洋化成工業	7,000	4,795.00	33,565,000	
4531	有機合成薬品工業	7,300	277.00	2,022,100	
4611	大日本塗料	12,800	1,453.00	18,598,400	
4612	日本ペイントホールディングス	86,500	4,575.00	395,737,500	貸付有価証券 18,400株(18,400株)
4613	関西ペイント	117,800	2,253.00	265,403,400	貸付有価証券 70,000株(70,000株)
4615	神東塗料	8,200	227.00	1,861,400	
4617	中国塗料	32,100	1,065.00	34,186,500	貸付有価証券 24,000株(24,000株)
4619	日本特殊塗料	7,100	2,400.00	17,040,000	貸付有価証券 5,800株(5,800株)
4620	藤倉化成	14,100	640.00	9,024,000	
4626	太陽ホールディングス	8,600	4,490.00	38,614,000	
4631	D I C	44,300	3,455.00	153,056,500	
4633	サカタインクス	22,900	1,450.00	33,205,000	
4634	東洋インキS Cホールディングス	111,000	574.00	63,714,000	
4636	T & K T O K A	7,500	1,187.00	8,902,500	
4901	富士フイルムホールディングス	222,300	4,222.00	938,550,600	
4911	資生堂	199,400	8,774.00	1,749,535,600	
4912	ライオン	149,100	1,998.00	297,901,800	
4914	高砂香料工業	6,700	3,565.00	23,885,500	
4917	マンダム	20,900	3,255.00	68,029,500	
4919	ミルボン	14,300	4,920.00	70,356,000	
4921	ファンケル	26,000	5,390.00	140,140,000	貸付有価証券 13,700株(13,700株)
4922	コーセー	18,100	24,660.00	446,346,000	貸付有価証券 6,900株(6,900株)
4923	コタ	5,100	1,501.00	7,655,100	
4924	シーズ・ホールディングス	12,900	5,100.00	65,790,000	
4926	シーボン	1,300	3,000.00	3,900,000	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	45,700	4,870.00	222,559,000	
4928	ノエビアホールディングス	6,800	7,780.00	52,904,000	
4929	アジュバンコスメジャパン	2,400	1,050.00	2,520,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)

4951	エステー	7,600	3,135.00	23,826,000	
4955	アグロ カネショウ	4,300	2,743.00	11,794,900	
4956	コニシ	17,600	1,819.00	32,014,400	
4958	長谷川香料	12,800	2,188.00	28,006,400	貸付有価証券 10,400株(10,400株)
4963	星光P M C	6,100	1,033.00	6,301,300	
4967	小林製薬	30,000	9,520.00	285,600,000	
4968	荒川化学工業	9,600	1,818.00	17,452,800	
4971	メック	7,300	2,057.00	15,016,100	
4973	日本高純度化学	2,900	2,439.00	7,073,100	
4974	タカラバイオ	28,000	2,330.00	65,240,000	
4975	J C U	12,900	2,686.00	34,649,400	
4977	新田ゼラチン	7,300	815.00	5,949,500	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
4979	O A T アグリオ	1,700	3,295.00	5,601,500	
4980	デクセリアルズ	27,500	1,047.00	28,792,500	貸付有価証券 11,600株(11,600株)
4985	アース製薬	8,100	5,730.00	46,413,000	貸付有価証券 5,900株(5,900株)
4992	北興化学工業	11,000	617.00	6,787,000	
4994	大成ラミック	3,300	3,130.00	10,329,000	
4996	クミアイ化学工業	48,700	813.00	39,593,100	貸付有価証券 37,000株(37,000株)
4997	日本農薬	25,600	648.00	16,588,800	貸付有価証券 18,900株(18,900株)
5142	アキレス	8,100	2,196.00	17,787,600	
5208	有沢製作所	18,000	1,120.00	20,160,000	
6988	日東電工	80,800	8,221.00	664,256,800	
7874	レック	6,300	4,575.00	28,822,500	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
7908	きもと	18,200	299.00	5,441,800	
7917	藤森工業	9,000	3,570.00	32,130,000	
7925	前澤化成工業	7,300	1,210.00	8,833,000	
7940	ウェーブロックホールディングス	2,800	1,077.00	3,015,600	
7942	J S P	6,300	3,340.00	21,042,000	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
7947	エフピコ	8,800	6,040.00	53,152,000	貸付有価証券 5,600株(5,600株)
7958	天馬	8,300	1,939.00	16,093,700	
7970	信越ポリマー	22,000	1,037.00	22,814,000	
7971	東リ	26,700	338.00	9,024,600	
7988	ニフコ	39,300	3,485.00	136,960,500	貸付有価証券 23,600株(23,600株)
7995	日本バルカー工業	8,700	3,125.00	27,187,500	
8113	ユニ・チャーム	227,000	3,303.00	749,781,000	
4151	協和発酵キリン	134,100	2,274.00	304,943,400	

4502	武田薬品工業	394,400	4,526.00	1,785,054,400	貸付有価証券 114,800株(114,800株)
4503	アステラス製薬	1,100,100	1,740.00	1,914,174,000	
4506	大日本住友製薬	79,300	2,313.00	183,420,900	貸付有価証券 40,800株(40,800株)
4507	塩野義製薬	150,800	5,610.00	845,988,000	
4508	田辺三菱製薬	130,600	1,898.00	247,878,800	
4512	わかもと製薬	12,700	294.00	3,733,800	
4514	あすか製薬	12,200	1,386.00	16,909,200	
4516	日本新薬	28,000	6,360.00	178,080,000	
4517	ビオフェルミン製薬	1,800	2,869.00	5,164,200	
4519	中外製薬	111,600	5,900.00	658,440,000	
4521	科研製薬	19,300	5,810.00	112,133,000	
4523	エーザイ	128,100	7,856.00	1,006,353,600	
4527	ロート製薬	58,800	3,440.00	202,272,000	
4528	小野薬品工業	252,800	2,688.00	679,526,400	
4530	久光製薬	31,600	9,800.00	309,680,000	貸付有価証券 17,300株(17,300株)
4534	持田製薬	7,400	8,050.00	59,570,000	貸付有価証券 200株(200株)
4536	参天製薬	202,800	1,930.00	391,404,000	
4538	扶桑薬品工業	3,800	2,934.00	11,149,200	
4539	日本ケミファ	1,400	4,765.00	6,671,000	
4540	ツムラ	38,300	3,665.00	140,369,500	貸付有価証券 16,900株(16,900株)
4541	日医工	28,200	1,679.00	47,347,800	貸付有価証券 9,100株(9,100株)
4547	キッセイ薬品工業	18,900	3,020.00	57,078,000	
4548	生化学工業	20,800	1,490.00	30,992,000	貸付有価証券 15,800株(15,800株)
4549	栄研化学	17,400	2,480.00	43,152,000	
4550	日水製薬	4,500	1,386.00	6,237,000	
4551	鳥居薬品	6,700	2,716.00	18,197,200	
4552	JCRファーマ	7,500	7,040.00	52,800,000	
4553	東和薬品	5,100	5,900.00	30,090,000	
4554	富士製薬工業	3,600	4,015.00	14,454,000	
4555	沢井製薬	21,500	4,980.00	107,070,000	
4559	ゼリア新薬工業	22,900	2,330.00	53,357,000	貸付有価証券 16,900株(16,900株)
4568	第一三共	306,300	4,270.00	1,307,901,000	
4569	キョーリン製薬ホールディングス	29,900	2,339.00	69,936,100	
4574	大幸薬品	5,700	2,046.00	11,662,200	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
4577	ダイト	6,200	3,455.00	21,421,000	
4578	大塚ホールディングス	222,500	5,527.00	1,229,757,500	

4581	大正製薬ホールディングス	24,000	12,950.00	310,800,000	
4587	ペプチドリーム	48,900	4,665.00	228,118,500	貸付有価証券 32,800株(32,800株)
3315	日本コークス工業	90,400	119.00	10,757,600	
5002	昭和シェル石油	100,200	1,633.00	163,626,600	
5011	ニチレキ	13,700	1,276.00	17,481,200	
5013	ユシロ化学工業	6,000	1,726.00	10,356,000	
5015	ビーピー・カストロール	4,600	1,618.00	7,442,800	貸付有価証券 3,300株(3,300株)
5017	富士石油	26,000	378.00	9,828,000	
5018	MORESCO	3,900	1,749.00	6,821,100	
5019	出光興産	89,900	3,565.00	320,493,500	
5020	JXTGホールディングス	1,708,300	748.30	1,278,320,890	
5021	コスモエネルギーホールディングス	31,000	3,680.00	114,080,000	
5101	横浜ゴム	62,000	2,343.00	145,266,000	
5105	東洋ゴム工業	63,400	1,643.00	104,166,200	
5108	ブリヂストン	354,300	4,377.00	1,550,771,100	
5110	住友ゴム工業	110,200	1,790.00	197,258,000	
5121	藤倉ゴム工業	9,400	624.00	5,865,600	貸付有価証券 5,600株(5,600株)
5122	オカモト	37,000	1,285.00	47,545,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
5185	フコク	4,700	968.00	4,549,600	
5186	ニッタ	11,100	4,370.00	48,507,000	貸付有価証券 8,900株(8,900株)
5191	住友理工	20,700	1,127.00	23,328,900	貸付有価証券 14,600株(14,600株)
5192	三ツ星ベルト	26,000	1,350.00	35,100,000	
5195	パンドー化学	20,400	1,241.00	25,316,400	
3110	日東紡績	15,900	2,617.00	41,610,300	貸付有価証券 10,700株(10,700株)
5201	旭硝子	107,900	4,295.00	463,430,500	
5202	日本板硝子	54,100	1,081.00	58,482,100	貸付有価証券 40,000株(40,000株)
5204	石塚硝子	1,400	2,383.00	3,336,200	
5210	日本山村硝子	44,000	183.00	8,052,000	
5214	日本電気硝子	46,300	2,994.00	138,622,200	
5218	オハラ	4,200	3,085.00	12,957,000	貸付有価証券 3,100株(3,100株)
5232	住友大阪セメント	208,000	509.00	105,872,000	貸付有価証券 109,000株(109,000株)
5233	太平洋セメント	67,600	3,755.00	253,838,000	
5262	日本ヒューム	10,700	895.00	9,576,500	
5269	日本コンクリート工業	23,000	331.00	7,613,000	
5273	三谷セキサン	5,600	2,614.00	14,638,400	貸付有価証券 3,500株(3,500株)

5288	アジアパイルホールディングス	13,800	708.00	9,770,400	
5301	東海カーボン	97,200	1,924.00	187,012,800	
5302	日本カーボン	5,500	6,130.00	33,715,000	
5310	東洋炭素	7,000	3,175.00	22,225,000	貸付有価証券 2,300株（2,300株）
5331	ノリタケカンパニーリミテド	5,900	6,010.00	35,459,000	
5332	TOTO	82,300	5,320.00	437,836,000	貸付有価証券 42,500株（42,500株）
5333	日本碍子	130,600	1,949.00	254,539,400	貸付有価証券 70,300株（70,300株）
5334	日本特殊陶業	91,800	3,060.00	280,908,000	
5337	ダントーホールディングス	8,000	134.00	1,072,000	
5344	MARUWA	3,700	8,560.00	31,672,000	
5351	品川リフラクトリーズ	2,800	3,520.00	9,856,000	
5352	黒崎播磨	2,100	6,230.00	13,083,000	
5357	ヨータイ	8,500	675.00	5,737,500	貸付有価証券 4,000株（4,000株）
5358	イソライト工業	5,500	640.00	3,520,000	
5363	東京窯業	13,600	372.00	5,059,200	貸付有価証券 10,000株（10,000株）
5367	ニッカトー	4,800	1,299.00	6,235,200	
5384	フジインコーポレーテッド	9,500	2,440.00	23,180,000	
5388	クニミネ工業	2,900	1,074.00	3,114,600	
5391	エーアンドエーマテリアル	2,300	1,204.00	2,769,200	
5393	ニチアス	59,000	1,410.00	83,190,000	
7943	ニチハ	16,100	4,085.00	65,768,500	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
5401	新日鐵住金	473,700	2,174.50	1,030,060,650	貸付有価証券 247,900株（247,900株）
5406	神戸製鋼所	193,700	1,026.00	198,736,200	
5408	中山製鋼所	14,700	698.00	10,260,600	貸付有価証券 6,700株（6,700株）
5410	合同製鐵	5,700	2,173.00	12,386,100	貸付有価証券 4,600株（4,600株）
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	285,900	2,118.00	605,536,200	
5413	日新製鋼	29,200	1,528.00	44,617,600	
5423	東京製鐵	56,700	998.00	56,586,600	貸付有価証券 31,800株（31,800株）
5440	共英製鋼	11,900	2,132.00	25,370,800	貸付有価証券 8,800株（8,800株）
5444	大和工業	22,500	3,325.00	74,812,500	貸付有価証券 9,300株（9,300株）
5445	東京鐵鋼	4,400	1,611.00	7,088,400	
5449	大阪製鐵	7,000	2,031.00	14,217,000	貸付有価証券 5,200株（5,200株）

5451	淀川製鋼所	15,500	2,780.00	43,090,000	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
5453	東洋鋼鋳	23,700	717.00	16,992,900	
5463	丸一鋼管	37,500	3,760.00	141,000,000	貸付有価証券 19,300株(19,300株)
5464	モリ工業	3,400	3,030.00	10,302,000	
5471	大同特殊鋼	18,800	5,210.00	97,948,000	貸付有価証券 9,600株(9,600株)
5476	日本高周波鋼業	3,900	824.00	3,213,600	
5480	日本冶金工業	87,600	319.00	27,944,400	
5481	山陽特殊製鋼	12,200	2,608.00	31,817,600	
5482	愛知製鋼	5,900	4,265.00	25,163,500	
5486	日立金属	114,000	1,122.00	127,908,000	貸付有価証券 51,000株(51,000株)
5491	日本金属	2,700	1,883.00	5,084,100	
5541	大平洋金属	6,500	3,895.00	25,317,500	貸付有価証券 4,500株(4,500株)
5563	新日本電工	63,400	317.00	20,097,800	貸付有価証券 46,800株(46,800株)
5602	栗本鐵工所	5,300	1,968.00	10,430,400	
5603	虹技	1,600	1,899.00	3,038,400	
5612	日本鑄鉄管	11,000	164.00	1,804,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
5632	三菱製鋼	7,800	2,155.00	16,809,000	貸付有価証券 5,600株(5,600株)
5658	日亜鋼業	15,500	346.00	5,363,000	
5659	日本精線	1,700	4,245.00	7,216,500	
5698	エンビプロ・ホールディングス	2,300	810.00	1,863,000	
6319	シンニッタン	16,500	450.00	7,425,000	
7305	新家工業	2,400	2,080.00	4,992,000	
5702	大紀アルミニウム工業所	17,400	699.00	12,162,600	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
5703	日本軽金属ホールディングス	309,000	245.00	75,705,000	
5706	三井金属鉱業	28,600	4,625.00	132,275,000	貸付有価証券 14,700株(14,700株)
5707	東邦亜鉛	5,900	4,080.00	24,072,000	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
5711	三菱マテリアル	69,900	3,040.00	212,496,000	貸付有価証券 36,000株(36,000株)
5713	住友金属鉱山	135,300	4,238.00	573,401,400	
5714	DOWAホールディングス	26,800	3,430.00	91,924,000	貸付有価証券 12,800株(12,800株)
5715	古河機械金属	17,500	1,574.00	27,545,000	貸付有価証券 12,800株(12,800株)
5721	エス・サイエンス	50,100	72.00	3,607,200	貸付有価証券 28,700株(28,700株)
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	11,000	1,595.00	17,545,000	貸付有価証券 8,100株(8,100株)

5727	東邦チタニウム	18,900	958.00	18,106,200	貸付有価証券 14,000株(14,000株)
5741	U A C J	16,100	2,407.00	38,752,700	貸付有価証券 11,500株(11,500株)
5757	C K サンエツ	2,000	3,585.00	7,170,000	
5801	古河電気工業	35,200	3,800.00	133,760,000	貸付有価証券 17,900株(17,900株)
5802	住友電気工業	395,800	1,626.00	643,570,800	
5803	フジクラ	127,800	688.00	87,926,400	貸付有価証券 91,200株(91,200株)
5805	昭和電線ホールディングス	13,300	720.00	9,576,000	
5807	東京特殊電線	1,400	2,567.00	3,593,800	
5809	タツタ電線	21,000	558.00	11,718,000	
5819	カナレ電気	1,800	2,378.00	4,280,400	
5821	平河ヒューテック	5,300	1,450.00	7,685,000	
5851	リョービ	13,000	3,555.00	46,215,000	
5852	アーレスティ	13,000	1,018.00	13,234,000	
5857	アサヒホールディングス	18,100	2,164.00	39,168,400	貸付有価証券 12,400株(12,400株)
3421	稲葉製作所	6,000	1,447.00	8,682,000	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
3431	宮地エンジニアリンググループ	3,000	1,992.00	5,976,000	
3433	トーカロ	29,400	1,182.00	34,750,800	
3434	アルファC o	3,700	1,558.00	5,764,600	
3436	S U M C O	97,500	2,160.00	210,600,000	
3443	川田テクノロジーズ	2,100	7,520.00	15,792,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
3445	R S T e c h n o l o g i e s	1,600	5,440.00	8,704,000	貸付有価証券 900株(900株)
5901	東洋製罐グループホールディングス	72,400	1,875.00	135,750,000	貸付有価証券 7,700株(7,700株)
5902	ホッカホホールディングス	27,000	372.00	10,044,000	
5909	コロナ	5,900	1,208.00	7,127,200	
5911	横河ブリッジホールディングス	19,700	2,583.00	50,885,100	
5915	駒井ハルテック	2,300	2,258.00	5,193,400	
5923	高田機工	1,000	3,140.00	3,140,000	
5929	三和ホールディングス	101,500	1,170.00	118,755,000	
5930	文化シャッター	31,200	937.00	29,234,400	
5932	三協立山	14,700	1,487.00	21,858,900	貸付有価証券 10,800株(10,800株)
5933	アルインコ	7,700	1,070.00	8,239,000	
5936	東洋シャッター	2,800	667.00	1,867,600	貸付有価証券 300株(300株)
5938	L I X I L グループ	156,100	2,150.00	335,615,000	
5942	日本フィルコン	8,100	613.00	4,965,300	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
5943	ノーリツ	23,600	1,809.00	42,692,400	

5946	長府製作所	12,000	2,383.00	28,596,000	貸付有価証券 8,800株(8,800株)
5947	リンナイ	18,900	9,900.00	187,110,000	
5951	ダイニチ工業	5,700	793.00	4,520,100	
5957	日東精工	14,600	712.00	10,395,200	
5958	三洋工業	1,300	2,166.00	2,815,800	
5959	岡部	21,500	1,004.00	21,586,000	貸付有価証券 14,900株(14,900株)
5970	ジーテクト	11,700	1,931.00	22,592,700	
5974	中国工業	1,600	664.00	1,062,400	
5975	東プレ	19,700	2,705.00	53,288,500	
5976	高周波熱錬	20,400	956.00	19,502,400	
5981	東京製綱	7,600	1,867.00	14,189,200	
5985	サンコール	5,900	715.00	4,218,500	
5986	モリテック スチール	8,200	587.00	4,813,400	貸付有価証券 4,100株(4,100株)
5988	パイオラックス	15,700	2,558.00	40,160,600	
5989	エイチワン	10,400	1,197.00	12,448,800	
5991	日本発條	105,400	1,071.00	112,883,400	
5992	中央発條	1,300	3,735.00	4,855,500	貸付有価証券 300株(300株)
5998	アドバネクス	1,700	2,062.00	3,505,400	貸付有価証券 400株(400株)
7989	立川ブラインド工業	4,700	1,450.00	6,815,000	
8155	三益半導体工業	8,300	1,770.00	14,691,000	
1909	日本ドライケミカル	1,400	2,333.00	3,266,200	
5631	日本製鋼所	34,600	2,791.00	96,568,600	
6005	三浦工業	45,800	2,705.00	123,889,000	貸付有価証券 15,400株(15,400株)
6013	タクマ	35,900	1,402.00	50,331,800	
6101	ツガミ	28,000	986.00	27,608,000	
6103	オークマ	12,300	5,750.00	70,725,000	貸付有価証券 700株(700株)
6104	東芝機械	60,000	523.00	31,380,000	
6113	アマダホールディングス	163,400	1,079.00	176,308,600	
6118	アイダエンジニアリング	26,900	1,061.00	28,540,900	
6121	滝澤鉄工所	3,300	1,768.00	5,834,400	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
6134	F U J I	31,700	1,924.00	60,990,800	
6135	牧野フライス製作所	54,000	859.00	46,386,000	
6136	オーエスジー	48,800	2,239.00	109,263,200	
6138	ダイジェット工業	1,300	1,742.00	2,264,600	
6140	旭ダイヤモンド工業	31,500	787.00	24,790,500	
6141	D M G 森精機	58,600	1,561.00	91,474,600	
6143	ソディック	23,100	1,006.00	23,238,600	



6146	ディスコ	14,300	18,780.00	268,554,000	貸付有価証券 6,400株(6,400株)
6151	日東工器	6,500	2,615.00	16,997,500	
6157	日進工具	2,800	2,556.00	7,156,800	
6165	パンチ工業	8,800	1,015.00	8,932,000	
6167	富士ダイス	5,300	859.00	4,552,700	
6203	豊和工業	5,800	968.00	5,614,400	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
6205	OKK	4,100	1,156.00	4,739,600	
6208	石川製作所	2,800	1,847.00	5,171,600	
6210	東洋機械金属	8,300	683.00	5,668,900	
6217	津田駒工業	2,500	1,833.00	4,582,500	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
6218	エンシュウ	27,000	140.00	3,780,000	貸付有価証券 20,000株(20,000株)
6222	島精機製作所	13,400	5,280.00	70,752,000	貸付有価証券 9,400株(9,400株)
6235	オプトラン	10,300	4,010.00	41,303,000	
6236	NCホールディングス	3,400	764.00	2,597,600	
6238	フリュー	7,500	985.00	7,387,500	
6240	ヤマシンフィルタ	16,100	1,026.00	16,518,600	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
6247	日阪製作所	15,200	1,017.00	15,458,400	
6250	やまびこ	20,500	1,283.00	26,301,500	
6258	平田機工	3,900	7,790.00	30,381,000	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
6262	ベガサスミシン製造	9,900	1,032.00	10,216,800	
6268	ナプテスコ	58,200	3,400.00	197,880,000	
6269	三井海洋開発	11,200	2,902.00	32,502,400	
6272	レオン自動機	9,400	2,019.00	18,978,600	
6273	SMC	33,600	41,960.00	1,409,856,000	貸付有価証券 5,600株(5,600株)
6274	新川	8,700	906.00	7,882,200	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
6277	ホソカワミクロン	3,700	6,930.00	25,641,000	
6278	ユニオンツール	4,800	3,540.00	16,992,000	貸付有価証券 500株(500株)
6282	オイレス工業	13,700	2,118.00	29,016,600	
6284	日精エー・エス・ビー機械	3,100	5,730.00	17,763,000	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
6287	サトーホールディングス	13,900	3,205.00	44,549,500	貸付有価証券 6,800株(6,800株)
6289	技研製作所	7,300	2,532.00	18,483,600	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
6291	日本エアーテック	3,600	844.00	3,038,400	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
6292	カワタ	2,200	1,595.00	3,509,000	
6293	日精樹脂工業	8,900	1,195.00	10,635,500	

6294	オカダアイオン	3,600	1,684.00	6,062,400	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
6298	ワイエイシイホールディングス	3,500	874.00	3,059,000	
6301	小松製作所	516,800	3,101.00	1,602,596,800	
6302	住友重機械工業	61,300	3,685.00	225,890,500	
6305	日立建機	50,000	3,535.00	176,750,000	貸付有価証券 29,400株（29,400株）
6306	日工	2,900	2,513.00	7,287,700	
6309	巴工業	4,600	2,296.00	10,561,600	
6310	井関農機	10,700	1,948.00	20,843,600	貸付有価証券 8,400株（8,400株）
6315	TOWA	8,300	1,124.00	9,329,200	貸付有価証券 6,900株（6,900株）
6316	丸山製作所	2,300	1,823.00	4,192,900	
6317	北川鉄工所	5,100	2,627.00	13,397,700	
6323	ローツェ	5,300	2,088.00	11,066,400	
6325	タカキタ	3,700	771.00	2,852,700	
6326	クボタ	574,200	1,806.00	1,037,005,200	
6328	荏原実業	3,100	2,279.00	7,064,900	
6331	三菱化工機	3,700	2,021.00	7,477,700	
6332	月島機械	21,200	1,628.00	34,513,600	貸付有価証券 13,900株（13,900株）
6333	帝国電機製作所	7,500	1,345.00	10,087,500	
6335	東京機械製作所	4,200	456.00	1,915,200	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
6339	新東工業	25,400	973.00	24,714,200	
6340	澁谷工業	9,400	3,315.00	31,161,000	
6345	アイチ コーポレーション	18,500	654.00	12,099,000	
6349	小森コーポレーション	26,900	1,275.00	34,297,500	貸付有価証券 14,000株（14,000株）
6351	鶴見製作所	9,000	1,818.00	16,362,000	
6355	住友精密工業	18,000	361.00	6,498,000	
6358	酒井重工業	2,000	3,550.00	7,100,000	
6361	荏原製作所	44,000	3,300.00	145,200,000	
6362	石井鐵工所	1,600	1,991.00	3,185,600	貸付有価証券 600株（600株）
6363	西島製作所	10,900	1,038.00	11,314,200	貸付有価証券 7,300株（7,300株）
6364	北越工業	12,000	1,075.00	12,900,000	
6367	ダイキン工業	146,100	13,435.00	1,962,853,500	
6368	オルガノ	3,900	3,095.00	12,070,500	
6369	トーヨーカネツ	4,500	3,945.00	17,752,500	
6370	栗田工業	57,900	3,010.00	174,279,000	
6371	椿本チエイン	64,000	861.00	55,104,000	
6373	大同工業	4,100	1,451.00	5,949,100	
6378	木村化工機	8,900	419.00	3,729,100	

6381	アネスト岩田	18,000	1,161.00	20,898,000	貸付有価証券 13,300株(13,300株)
6383	ダイフク	54,500	4,940.00	269,230,000	
6387	サムコ	2,900	1,175.00	3,407,500	
6390	加藤製作所	5,100	2,745.00	13,999,500	
6393	油研工業	2,100	2,620.00	5,502,000	
6395	タダノ	51,600	1,379.00	71,156,400	
6406	フジテック	34,300	1,347.00	46,202,100	
6407	C K D	29,800	1,806.00	53,818,800	
6409	キトー	8,100	2,200.00	17,820,000	
6412	平和	33,200	2,622.00	87,050,400	
6413	理想科学工業	10,600	2,221.00	23,542,600	
6417	S A N K Y O	26,800	4,385.00	117,518,000	
6418	日本金銭機械	9,900	1,224.00	12,117,600	
6419	マースエンジニアリング	6,800	2,611.00	17,754,800	
6420	福島工業	6,600	5,020.00	33,132,000	
6428	オーイズミ	4,500	566.00	2,547,000	貸付有価証券 2,900株(2,900株)
6430	ダイコク電機	4,900	1,874.00	9,182,600	
6432	竹内製作所	17,900	2,274.00	40,704,600	
6436	アマノ	33,100	2,525.00	83,577,500	
6440	J U K I	15,900	1,083.00	17,219,700	
6444	サンデンホールディングス	13,100	1,456.00	19,073,600	貸付有価証券 9,600株(9,600株)
6445	蛇の目マシン工業	9,700	698.00	6,770,600	
6454	マックス	16,500	1,384.00	22,836,000	
6457	グローリー	31,900	3,085.00	98,411,500	
6458	新晃工業	10,900	1,909.00	20,808,100	
6459	大和冷機工業	17,200	1,290.00	22,188,000	
6460	セガサミーホールディングス	106,200	1,930.00	204,966,000	
6461	日本ピストンリング	3,900	2,287.00	8,919,300	
6462	リケン	5,000	5,680.00	28,400,000	貸付有価証券 600株(600株)
6463	T P R	12,000	2,593.00	31,116,000	
6464	ツバキ・ナカシマ	10,700	2,671.00	28,579,700	
6465	ホシザキ	33,700	11,590.00	390,583,000	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
6470	大豊工業	8,700	1,245.00	10,831,500	
6471	日本精工	219,800	1,145.00	251,671,000	
6472	N T N	247,700	446.00	110,474,200	貸付有価証券 103,400株(103,400株)
6473	ジェイテクト	114,100	1,509.00	172,176,900	
6474	不二越	9,900	4,995.00	49,450,500	貸付有価証券 2,900株(2,900株)

6480	日本トムソン	34,200	860.00	29,412,000	貸付有価証券 27,000株(27,000株)
6481	THK	66,700	3,270.00	218,109,000	
6482	ユーシン精機	9,500	1,304.00	12,388,000	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
6485	前澤給装工業	4,200	1,958.00	8,223,600	
6486	イーグル工業	13,200	1,754.00	23,152,800	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
6489	前澤工業	7,800	454.00	3,541,200	
6490	日本ピラー工業	10,800	1,503.00	16,232,400	
6498	キッツ	43,400	899.00	39,016,600	
6586	マキタ	139,600	4,870.00	679,852,000	貸付有価証券 71,800株(71,800株)
7004	日立造船	84,900	507.00	43,044,300	
7011	三菱重工業	179,400	3,955.00	709,527,000	
7013	IHI	82,200	3,900.00	320,580,000	
7718	スター精密	17,100	1,701.00	29,087,100	
3105	日清紡ホールディングス	65,400	1,169.00	76,452,600	
4062	イビデン	65,500	1,756.00	115,018,000	
4902	コニカミノルタ	250,600	1,037.00	259,872,200	貸付有価証券 145,400株(145,400株)
6448	ブラザー工業	130,700	2,167.00	283,226,900	
6479	ミネベアミツミ	198,700	1,875.00	372,562,500	貸付有価証券 79,800株(79,800株)
6501	日立製作所	2,570,000	781.60	2,008,712,000	
6503	三菱電機	1,070,400	1,451.00	1,553,150,400	
6504	富士電機	323,000	849.00	274,227,000	貸付有価証券 153,000株(153,000株)
6505	東洋電機製造	4,200	1,828.00	7,677,600	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
6506	安川電機	124,100	3,995.00	495,779,500	貸付有価証券 60,000株(60,000株)
6507	シンフォニアテクノロジー	69,000	376.00	25,944,000	貸付有価証券 51,000株(51,000株)
6508	明電舎	91,000	398.00	36,218,000	
6513	オリジン電気	3,100	2,139.00	6,630,900	
6516	山洋電気	5,200	7,650.00	39,780,000	
6517	デンヨー	9,900	1,741.00	17,235,900	
6588	東芝テック	77,000	663.00	51,051,000	
6590	芝浦メカトロニクス	16,000	361.00	5,776,000	
6592	マブチモーター	29,600	5,300.00	156,880,000	
6594	日本電産	128,800	16,605.00	2,138,724,000	貸付有価証券 61,200株(61,200株)
6615	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4,500	2,483.00	11,173,500	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
6616	トレックス・セミコンダクター	3,000	1,403.00	4,209,000	

6617	東光高岳	5,400	1,941.00	10,481,400	
6619	ダブル・スコープ	15,600	1,715.00	26,754,000	
6620	宮越ホールディングス	4,000	1,167.00	4,668,000	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
6622	ダイヘン	59,000	655.00	38,645,000	貸付有価証券 44,000株(44,000株)
6624	田淵電機	14,800	237.00	3,507,600	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
6630	ヤーマン	15,500	1,927.00	29,868,500	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
6632	JVCケンウッド	78,500	303.00	23,785,500	
6638	ミマキエンジニアリング	9,600	881.00	8,457,600	貸付有価証券 3,300株(3,300株)
6640	第一精工	5,000	1,802.00	9,010,000	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
6641	日新電機	25,100	1,003.00	25,175,300	
6644	大崎電気工業	22,900	832.00	19,052,800	
6645	オムロン	113,800	5,240.00	596,312,000	貸付有価証券 61,000株(61,000株)
6651	日東工業	17,100	2,144.00	36,662,400	
6652	I D E C	13,200	2,572.00	33,950,400	貸付有価証券 10,300株(10,300株)
6654	不二電機工業	1,200	1,426.00	1,711,200	
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	192,000	493.00	94,656,000	貸付有価証券 97,000株(97,000株)
6675	サクサホールディングス	2,700	2,356.00	6,361,200	
6676	メルコホールディングス	5,200	4,095.00	21,294,000	
6678	テクノメディカ	2,600	2,012.00	5,231,200	
6701	日本電気	138,500	3,080.00	426,580,000	
6702	富士通	1,101,000	671.80	739,651,800	
6703	沖電気工業	43,500	1,209.00	52,591,500	貸付有価証券 21,200株(21,200株)
6704	岩崎通信機	4,700	819.00	3,849,300	
6706	電気興業	6,100	3,325.00	20,282,500	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
6707	サンケン電気	63,000	563.00	35,469,000	
6715	ナカヨ	2,100	1,819.00	3,819,900	
6718	アイホン	6,100	1,725.00	10,522,500	
6723	ルネサスエレクトロニクス	55,400	1,085.00	60,109,000	
6724	セイコーエプソン	159,400	1,907.00	303,975,800	
6727	ワコム	83,000	617.00	51,211,000	貸付有価証券 43,300株(43,300株)
6728	アルバック	24,600	4,300.00	105,780,000	
6730	アクセル	4,500	827.00	3,721,500	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
6737	E I Z O	9,800	4,420.00	43,316,000	
6740	ジャパンディスプレイ	219,800	148.00	32,530,400	

6741	日本信号	29,500	1,048.00	30,916,000	貸付有価証券 21,800株（21,800株）
6742	京三製作所	25,100	738.00	18,523,800	
6744	能美防災	14,200	2,396.00	34,023,200	
6745	ホーチキ	7,800	2,175.00	16,965,000	貸付有価証券 5,700株（5,700株）
6748	星和電機	3,600	533.00	1,918,800	
6750	エレコム	9,300	2,504.00	23,287,200	
6752	パナソニック	1,222,800	1,487.00	1,818,303,600	
6753	シャープ	99,400	2,492.00	247,704,800	
6754	アンリツ	78,000	1,534.00	119,652,000	貸付有価証券 32,000株（32,000株）
6755	富士通ゼネラル	32,700	1,596.00	52,189,200	
6758	ソニー	716,500	5,491.00	3,934,301,500	
6762	T D K	56,000	11,410.00	638,960,000	貸付有価証券 8,700株（8,700株）
6763	帝国通信工業	4,700	1,254.00	5,893,800	
6768	タムラ製作所	41,300	648.00	26,762,400	
6770	アルプス電気	92,200	2,715.00	250,323,000	貸付有価証券 40,300株（40,300株）
6771	池上通信機	34,000	149.00	5,066,000	貸付有価証券 24,000株（24,000株）
6773	パイオニア	178,400	155.00	27,652,000	貸付有価証券 128,000株（128,000株）
6779	日本電波工業	9,700	555.00	5,383,500	貸付有価証券 7,100株（7,100株）
6785	鈴木	5,000	952.00	4,760,000	貸付有価証券 1,400株（1,400株）
6788	日本トリム	2,300	4,740.00	10,902,000	
6789	ローランド ディー . ジー .	5,500	2,408.00	13,244,000	
6794	フォスター電機	12,500	1,546.00	19,325,000	
6796	クラリオン	56,000	288.00	16,128,000	
6798	S M K	27,000	361.00	9,747,000	
6800	ヨコオ	6,900	1,857.00	12,813,300	貸付有価証券 5,600株（5,600株）
6803	ティアック	77,000	43.00	3,311,000	貸付有価証券 45,000株（45,000株）
6804	ホシデン	27,000	937.00	25,299,000	
6806	ヒロセ電機	18,200	13,650.00	248,430,000	貸付有価証券 10,500株（10,500株）
6807	日本航空電子工業	28,000	1,709.00	47,852,000	
6809	T O A	11,500	1,173.00	13,489,500	
6810	マクセルホールディングス	21,300	1,804.00	38,425,200	
6814	古野電気	12,700	877.00	11,137,900	
6815	ユニデンホールディングス	29,000	319.00	9,251,000	貸付有価証券 24,000株（24,000株）
6816	アルパイン	25,500	2,035.00	51,892,500	

6817	スミダコーポレーション	10,900	1,192.00	12,992,800	貸付有価証券 6,400株(6,400株)
6820	アイコム	5,900	2,610.00	15,399,000	貸付有価証券 4,400株(4,400株)
6823	リオン	4,500	2,312.00	10,404,000	
6826	本多通信工業	8,300	946.00	7,851,800	貸付有価証券 3,800株(3,800株)
6839	船井電機	10,800	641.00	6,922,800	
6841	横河電機	107,100	1,911.00	204,668,100	
6844	新電元工業	3,800	5,270.00	20,026,000	
6845	アズビル	32,100	4,920.00	157,932,000	
6848	東亜ディーケーケー	5,300	1,196.00	6,338,800	
6849	日本光電工業	44,700	3,075.00	137,452,500	
6850	チノー	3,700	1,602.00	5,927,400	
6853	共和電業	12,100	421.00	5,094,100	貸付有価証券 5,800株(5,800株)
6855	日本電子材料	4,200	699.00	2,935,800	貸付有価証券 3,100株(3,100株)
6856	堀場製作所	21,200	7,650.00	162,180,000	
6857	アドバンテスト	59,700	2,228.00	133,011,600	貸付有価証券 43,100株(43,100株)
6858	小野測器	4,600	860.00	3,956,000	
6859	エスバック	9,500	2,074.00	19,703,000	
6861	キーエンス	52,500	64,460.00	3,384,150,000	
6866	日置電機	5,600	4,385.00	24,556,000	
6869	シスメックス	83,300	10,860.00	904,638,000	貸付有価証券 3,900株(3,900株)
6871	日本マイクロニクス	17,300	955.00	16,521,500	
6875	メガチップス	8,400	2,935.00	24,654,000	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
6877	OBARA GROUP	6,200	6,240.00	38,688,000	貸付有価証券 5,100株(5,100株)
6901	澤藤電機	1,100	2,270.00	2,497,000	貸付有価証券 800株(800株)
6905	コーセル	14,800	1,364.00	20,187,200	
6908	イリソ電子工業	9,000	6,420.00	57,780,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
6911	新日本無線	6,500	750.00	4,875,000	
6914	オブテックスグループ	17,400	3,035.00	52,809,000	貸付有価証券 11,200株(11,200株)
6915	千代田インテグレ	4,900	2,364.00	11,583,600	
6916	アイ・オー・データ機器	4,400	1,201.00	5,284,400	
6920	レーザーテック	21,900	3,290.00	72,051,000	
6923	スタンレー電気	81,900	3,830.00	313,677,000	
6924	岩崎電気	4,200	1,597.00	6,707,400	
6925	ウシオ電機	65,000	1,366.00	88,790,000	貸付有価証券 33,400株(33,400株)

6926	岡谷電機産業	7,600	518.00	3,936,800	貸付有価証券 300株(300株)
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	9,100	687.00	6,251,700	貸付有価証券 6,700株(6,700株)
6929	日本セラミック	10,900	2,947.00	32,122,300	貸付有価証券 4,500株(4,500株)
6932	遠藤照明	5,400	880.00	4,752,000	
6937	古河電池	7,600	855.00	6,498,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
6938	双信電機	4,700	555.00	2,608,500	貸付有価証券 3,800株(3,800株)
6941	山一電機	7,800	1,512.00	11,793,600	
6947	図研	7,000	1,806.00	12,642,000	
6951	日本電子	39,000	1,079.00	42,081,000	貸付有価証券 30,000株(30,000株)
6952	カシオ計算機	86,100	1,800.00	154,980,000	貸付有価証券 57,200株(57,200株)
6954	ファナック	101,700	22,180.00	2,255,706,000	貸付有価証券 61,400株(61,400株)
6958	日本シイエムケイ	18,900	691.00	13,059,900	貸付有価証券 13,600株(13,600株)
6961	エンプラス	4,800	3,070.00	14,736,000	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
6962	大真空	3,900	1,312.00	5,116,800	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
6963	ローム	48,000	9,180.00	440,640,000	
6965	浜松ホトニクス	76,800	4,640.00	356,352,000	貸付有価証券 43,000株(43,000株)
6966	三井ハイテック	14,100	1,317.00	18,569,700	貸付有価証券 11,400株(11,400株)
6967	新光電気工業	40,400	943.00	38,097,200	貸付有価証券 18,500株(18,500株)
6971	京セラ	175,700	6,158.00	1,081,960,600	
6976	太陽誘電	48,000	2,876.00	138,048,000	貸付有価証券 26,800株(26,800株)
6981	村田製作所	112,300	18,125.00	2,035,437,500	貸付有価証券 58,100株(58,100株)
6985	ユーシン	16,100	711.00	11,447,100	貸付有価証券 600株(600株)
6986	双葉電子工業	17,500	1,911.00	33,442,500	貸付有価証券 10,200株(10,200株)
6989	北陸電気工業	4,300	1,231.00	5,293,300	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
6996	ニチコン	33,700	1,348.00	45,427,600	貸付有価証券 13,800株(13,800株)
6997	日本ケミコン	8,700	4,125.00	35,887,500	
6999	K O A	14,800	2,638.00	39,042,400	貸付有価証券 10,900株(10,900株)
7244	市光工業	16,000	1,321.00	21,136,000	
7276	小糸製作所	64,100	7,570.00	485,237,000	



7280	ミツバ	19,700	966.00	19,030,200	貸付有価証券 11,400株(11,400株)
7735	S C R E E Nホールディングス	20,300	8,230.00	167,069,000	貸付有価証券 16,000株(16,000株)
7739	キヤノン電子	9,800	2,233.00	21,883,400	
7751	キヤノン	576,200	3,712.00	2,138,854,400	貸付有価証券 200,800株(200,800株)
7752	リコー	321,800	1,017.00	327,270,600	貸付有価証券 148,200株(148,200株)
7965	象印マホービン	19,900	1,582.00	31,481,800	
7999	M U T O Hホールディングス	1,500	2,375.00	3,562,500	
8035	東京エレクトロン	71,400	18,635.00	1,330,539,000	
3116	トヨタ紡織	31,200	2,071.00	64,615,200	
3526	芦森工業	2,200	2,402.00	5,284,400	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
5949	ユニプレス	20,700	2,238.00	46,326,600	
6201	豊田自動織機	86,600	6,010.00	520,466,000	
6455	モリタホールディングス	17,200	2,281.00	39,233,200	貸付有価証券 13,800株(13,800株)
6584	三櫻工業	13,600	714.00	9,710,400	
6902	デンソー	237,500	5,406.00	1,283,925,000	
6995	東海理化電機製作所	28,200	2,040.00	57,528,000	
7003	三井E & Sホールディングス	38,700	1,388.00	53,715,600	貸付有価証券 21,300株(21,300株)
7012	川崎重工業	83,300	3,225.00	268,642,500	
7014	名村造船所	32,100	431.00	13,835,100	貸付有価証券 22,100株(22,100株)
7022	サノヤスホールディングス	13,000	224.00	2,912,000	貸付有価証券 7,300株(7,300株)
7102	日本車輛製造	39,000	277.00	10,803,000	貸付有価証券 32,000株(32,000株)
7105	三菱ロジスネクスト	12,700	1,315.00	16,700,500	
7122	近畿車輛	1,600	2,370.00	3,792,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
7201	日産自動車	1,262,400	1,067.50	1,347,612,000	
7202	いすゞ自動車	310,200	1,464.00	454,132,800	
7203	トヨタ自動車	1,301,300	7,091.00	9,227,518,300	
7205	日野自動車	152,800	1,164.00	177,859,200	貸付有価証券 69,000株(69,000株)
7211	三菱自動車工業	396,200	865.00	342,713,000	貸付有価証券 129,400株(129,400株)
7212	エフテック	6,800	1,426.00	9,696,800	
7213	レシップホールディングス	3,800	883.00	3,355,400	
7214	G M B	1,700	1,445.00	2,456,500	
7215	ファルテック	1,900	1,196.00	2,272,400	

7220	武蔵精密工業	11,400	3,750.00	42,750,000	
7222	日産車体	41,800	975.00	40,755,000	貸付有価証券 30,600株(30,600株)
7224	新明和工業	46,500	1,319.00	61,333,500	貸付有価証券 22,000株(22,000株)
7226	極東開発工業	19,900	1,657.00	32,974,300	
7230	日信工業	21,800	1,960.00	42,728,000	
7231	トピー工業	8,800	2,982.00	26,241,600	
7236	ティラド	3,900	3,570.00	13,923,000	
7238	曙ブレーキ工業	49,700	286.00	14,214,200	貸付有価証券 34,900株(34,900株)
7239	タチエス	18,200	1,841.00	33,506,200	
7240	N O K	57,500	2,139.00	122,992,500	貸付有価証券 26,700株(26,700株)
7241	フタバ産業	32,700	711.00	23,249,700	貸付有価証券 24,000株(24,000株)
7242	K Y B	11,100	5,050.00	56,055,000	
7245	大同メタル工業	13,400	1,091.00	14,619,400	
7246	プレス工業	56,800	636.00	36,124,800	貸付有価証券 42,000株(42,000株)
7247	ミクニ	13,600	557.00	7,575,200	
7250	太平洋工業	22,400	1,657.00	37,116,800	貸付有価証券 17,400株(17,400株)
7251	ケーヒン	24,600	2,210.00	54,366,000	
7256	河西工業	13,100	1,384.00	18,130,400	
7259	アイシン精機	88,100	5,030.00	443,143,000	
7261	マツダ	335,900	1,353.50	454,640,650	貸付有価証券 164,000株(164,000株)
7266	今仙電機製作所	9,900	1,187.00	11,751,300	
7267	本田技研工業	963,200	3,310.00	3,188,192,000	
7269	スズキ	212,100	6,173.00	1,309,293,300	貸付有価証券 106,400株(106,400株)
7270	S U B A R U	332,300	3,184.00	1,058,043,200	
7271	安永	5,200	1,954.00	10,160,800	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
7272	ヤマハ発動機	151,200	2,795.00	422,604,000	
7274	ショーワ	27,800	1,911.00	53,125,800	
7277	T B K	12,700	502.00	6,375,400	
7278	エクセディ	12,900	3,500.00	45,150,000	
7282	豊田合成	38,900	2,778.00	108,064,200	
7283	愛三工業	18,800	931.00	17,502,800	
7284	盟和産業	1,600	1,270.00	2,032,000	貸付有価証券 500株(500株)
7291	日本プラス	5,800	981.00	5,689,800	
7294	ヨロズ	10,800	1,643.00	17,744,400	

7296	エフ・シー・シー	17,500	3,115.00	54,512,500	
7309	シマノ	43,100	16,140.00	695,634,000	
7313	テイ・エス テック	24,900	4,590.00	114,291,000	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
7408	ジャムコ	5,400	2,471.00	13,343,400	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
4543	テルモ	164,100	6,560.00	1,076,496,000	
5187	クリエートメディック	3,500	1,413.00	4,945,500	
6376	日機装	37,000	1,125.00	41,625,000	
7701	島津製作所	127,900	3,240.00	414,396,000	
7702	JMS	9,900	647.00	6,405,300	
7709	クボテック	2,300	484.00	1,113,200	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
7715	長野計器	8,400	1,254.00	10,533,600	
7717	バイ・テクノロジー	2,500	20,890.00	52,225,000	
7721	東京計器	6,800	1,221.00	8,302,800	
7723	愛知時計電機	1,400	4,125.00	5,775,000	
7725	インターアクション	5,700	1,464.00	8,344,800	
7727	オーバル	10,400	313.00	3,255,200	
7729	東京精密	19,300	3,690.00	71,217,000	
7730	マニー	13,000	5,120.00	66,560,000	
7731	ニコン	186,500	1,736.00	323,764,000	貸付有価証券 39,000株(39,000株)
7732	トプコン	57,500	1,816.00	104,420,000	貸付有価証券 26,500株(26,500株)
7733	オリンパス	159,400	4,135.00	659,119,000	貸付有価証券 82,000株(82,000株)
7734	理研計器	10,200	2,509.00	25,591,800	貸付有価証券 5,300株(5,300株)
7740	タムロン	8,600	2,011.00	17,294,600	
7741	HOYA	215,500	6,358.00	1,370,149,000	
7743	シード	1,500	6,600.00	9,900,000	貸付有価証券 700株(700株)
7744	ノーリツ鋼機	10,800	1,874.00	20,239,200	貸付有価証券 7,100株(7,100株)
7745	エー・アンド・デイ	9,800	1,032.00	10,113,600	
7762	シチズン時計	127,800	723.00	92,399,400	貸付有価証券 35,400株(35,400株)
7769	リズム時計工業	4,100	2,110.00	8,651,000	
7775	大研医器	9,500	763.00	7,248,500	貸付有価証券 5,900株(5,900株)
7780	メニコン	14,700	2,904.00	42,688,800	
7782	シンシア	1,100	626.00	688,600	
7979	松風	5,200	1,439.00	7,482,800	
8050	セイコーホールディングス	16,500	2,384.00	39,336,000	貸付有価証券 3,800株(3,800株)

8086	ニプロ	74,100	1,300.00	96,330,000	貸付有価証券 58,900株(58,900株)
7811	中本パックス	2,700	1,750.00	4,725,000	
7816	スノーピーク	3,300	1,486.00	4,903,800	貸付有価証券 100株(100株)
7817	パラマウントベッドホールディングス	11,300	4,660.00	52,658,000	貸付有価証券 5,700株(5,700株)
7818	トランザクション	5,800	995.00	5,771,000	
7819	S H O - B I	3,100	438.00	1,357,800	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
7820	ニホンフラッシュ	5,000	2,755.00	13,775,000	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
7821	前田工織	11,800	1,879.00	22,172,200	
7822	永大産業	14,000	540.00	7,560,000	
7823	アートネイチャー	11,400	675.00	7,695,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	110,700	4,645.00	514,201,500	
7833	アイフィスジャパン	2,400	740.00	1,776,000	貸付有価証券 800株(800株)
7838	共立印刷	17,800	374.00	6,657,200	
7839	S H O E I	5,100	3,770.00	19,227,000	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
7840	フランスベッドホールディングス	12,700	948.00	12,039,600	
7846	パイロットコーポレーション	18,700	6,300.00	117,810,000	
7856	萩原工業	5,900	1,788.00	10,549,200	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
7862	トッパン・フォームズ	22,900	1,116.00	25,556,400	
7864	フジシールインターナショナル	24,000	3,820.00	91,680,000	
7867	タカラトミー	44,800	874.00	39,155,200	
7868	廣済堂	9,900	505.00	4,999,500	
7872	A s - m e エステール	3,100	780.00	2,418,000	
7873	アーク	54,500	121.00	6,594,500	貸付有価証券 30,300株(30,300株)
7885	タカノ	4,700	1,014.00	4,765,800	
7893	プロネクサス	10,000	1,287.00	12,870,000	貸付有価証券 7,300株(7,300株)
7897	ホクシン	7,500	174.00	1,305,000	
7898	ウッドワン	3,600	1,389.00	5,000,400	
7905	大建工業	8,400	2,493.00	20,941,200	
7911	凸版印刷	302,000	858.00	259,116,000	
7912	大日本印刷	140,100	2,471.00	346,187,100	
7913	図書印刷	7,200	985.00	7,092,000	貸付有価証券 700株(700株)
7914	共同印刷	3,300	2,818.00	9,299,400	
7915	N I S S H A	22,000	2,230.00	49,060,000	貸付有価証券 13,200株(13,200株)
7916	光村印刷	900	2,243.00	2,018,700	
7921	宝印刷	5,600	1,793.00	10,040,800	

7936	アシックス	106,300	1,815.00	192,934,500	
7937	ツツミ	3,300	1,823.00	6,015,900	
7949	小松ウオール工業	3,600	2,008.00	7,228,800	
7951	ヤマハ	72,100	5,730.00	413,133,000	
7952	河合楽器製作所	3,600	5,650.00	20,340,000	
7955	クリナップ	10,000	815.00	8,150,000	
7956	ビジョン	64,700	5,430.00	351,321,000	
7961	兼松サステック	800	1,949.00	1,559,200	
7962	キングジム	8,900	1,062.00	9,451,800	
7966	リンテック	25,400	3,220.00	81,788,000	
7972	イトーキ	22,500	635.00	14,287,500	
7974	任天堂	65,900	36,110.00	2,379,649,000	
7976	三菱鉛筆	17,600	2,274.00	40,022,400	
7981	タカラスタンダード	22,100	1,812.00	40,045,200	
7984	コクヨ	51,300	1,962.00	100,650,600	
7987	ナカバヤシ	10,500	686.00	7,203,000	
7990	グローブライド	4,800	4,150.00	19,920,000	
7994	オカムラ	37,400	1,596.00	59,690,400	
8022	美津濃	10,600	4,000.00	42,400,000	
9501	東京電力ホールディングス	854,500	509.00	434,940,500	
9502	中部電力	327,500	1,647.50	539,556,250	貸付有価証券 181,400株(181,400株)
9503	関西電力	436,800	1,564.50	683,373,600	
9504	中国電力	148,000	1,409.00	208,532,000	貸付有価証券 76,100株(76,100株)
9505	北陸電力	104,900	1,095.00	114,865,500	貸付有価証券 53,900株(53,900株)
9506	東北電力	250,700	1,333.00	334,183,100	
9507	四国電力	96,400	1,487.00	143,346,800	貸付有価証券 49,600株(49,600株)
9508	九州電力	236,400	1,200.00	283,680,000	貸付有価証券 121,600株(121,600株)
9509	北海道電力	107,300	730.00	78,329,000	
9511	沖縄電力	21,600	2,171.00	46,893,600	
9513	電源開発	85,200	2,750.00	234,300,000	
9514	エフオン	5,300	1,633.00	8,654,900	
9517	イーレックス	16,900	1,118.00	18,894,200	貸付有価証券 7,500株(7,500株)
9519	レノバ	5,500	1,430.00	7,865,000	
9531	東京瓦斯	228,300	2,848.50	650,312,550	
9532	大阪瓦斯	207,700	2,204.00	457,770,800	貸付有価証券 113,400株(113,400株)
9533	東邦瓦斯	53,000	3,790.00	200,870,000	

9534	北海道瓦斯	29,000	308.00	8,932,000	
9535	広島ガス	22,000	379.00	8,338,000	
9536	西部瓦斯	13,000	3,000.00	39,000,000	
9543	静岡ガス	30,400	1,022.00	31,068,800	
9551	メタウォーター	6,000	3,125.00	18,750,000	
2384	SBSホールディングス	10,600	1,204.00	12,762,400	
9001	東武鉄道	112,900	3,420.00	386,118,000	貸付有価証券 19,500株(19,500株)
9003	相鉄ホールディングス	34,200	3,400.00	116,280,000	
9005	東京急行電鉄	290,700	1,922.00	558,725,400	貸付有価証券 38,900株(38,900株)
9006	京浜急行電鉄	146,600	1,818.00	266,518,800	貸付有価証券 70,500株(70,500株)
9007	小田急電鉄	159,200	2,357.00	375,234,400	貸付有価証券 88,000株(88,000株)
9008	京王電鉄	59,800	5,350.00	319,930,000	貸付有価証券 30,800株(30,800株)
9009	京成電鉄	74,500	3,780.00	281,610,000	
9010	富士急行	14,600	3,385.00	49,421,000	貸付有価証券 10,500株(10,500株)
9014	新京成電鉄	2,700	2,200.00	5,940,000	
9020	東日本旅客鉄道	192,200	10,505.00	2,019,061,000	
9021	西日本旅客鉄道	96,600	8,043.00	776,953,800	
9022	東海旅客鉄道	95,800	23,590.00	2,259,922,000	
9024	西武ホールディングス	136,400	1,866.00	254,522,400	
9025	鴻池運輸	15,100	1,686.00	25,458,600	
9031	西日本鉄道	29,700	3,025.00	89,842,500	貸付有価証券 20,400株(20,400株)
9037	ハマキョウレックス	7,600	3,340.00	25,384,000	
9039	サカイ引越センター	5,600	5,660.00	31,696,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
9041	近鉄グループホールディングス	101,400	4,485.00	454,779,000	貸付有価証券 5,500株(5,500株)
9042	阪急阪神ホールディングス	135,200	4,430.00	598,936,000	
9044	南海電気鉄道	48,100	3,100.00	149,110,000	貸付有価証券 35,400株(35,400株)
9045	京阪ホールディングス	45,100	3,910.00	176,341,000	
9046	神戸電鉄	2,400	3,990.00	9,576,000	貸付有価証券 500株(500株)
9048	名古屋鉄道	80,700	2,888.00	233,061,600	貸付有価証券 38,400株(38,400株)
9052	山陽電気鉄道	7,800	2,700.00	21,060,000	
9062	日本通運	39,800	8,180.00	325,564,000	
9064	ヤマトホールディングス	177,700	3,373.00	599,382,100	貸付有価証券 102,500株(102,500株)
9065	山九	26,000	5,970.00	155,220,000	貸付有価証券 13,400株(13,400株)

9067	丸運	5,800	352.00	2,041,600	
9068	丸全昭和運輸	36,000	505.00	18,180,000	貸付有価証券 22,000株(22,000株)
9069	センコーグループホールディングス	61,000	898.00	54,778,000	貸付有価証券 15,700株(15,700株)
9070	トナミホールディングス	2,400	6,440.00	15,456,000	
9072	ニッコンホールディングス	38,600	2,956.00	114,101,600	貸付有価証券 11,400株(11,400株)
9074	日本石油輸送	1,200	3,235.00	3,882,000	
9075	福山通運	14,800	5,800.00	85,840,000	
9076	セイノーホールディングス	75,900	1,983.00	150,509,700	
9078	エスライン	2,800	1,173.00	3,284,400	
9081	神奈川中央交通	2,500	3,705.00	9,262,500	
9086	日立物流	22,300	2,900.00	64,670,000	
9090	丸和運輸機関	5,300	4,005.00	21,226,500	
9099	C & F ロジホールディングス	11,100	1,323.00	14,685,300	
9142	九州旅客鉄道	85,100	3,455.00	294,020,500	
9143	S Gホールディングス	95,800	2,338.00	223,980,400	
9101	日本郵船	84,800	2,189.00	185,627,200	
9104	商船三井	64,100	2,642.00	169,352,200	貸付有価証券 30,900株(30,900株)
9107	川崎汽船	46,800	2,082.00	97,437,600	貸付有価証券 35,000株(35,000株)
9110	N S ユナイテッド海運	4,800	2,087.00	10,017,600	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
9115	明治海運	10,800	393.00	4,244,400	
9119	飯野海運	51,700	485.00	25,074,500	貸付有価証券 5,800株(5,800株)
9130	共栄タンカー	800	1,864.00	1,491,200	
9308	乾汽船	7,800	1,132.00	8,829,600	
9201	日本航空	188,100	4,059.00	763,497,900	
9202	A N Aホールディングス	196,900	4,140.00	815,166,000	
9232	パスコ	10,000	314.00	3,140,000	
9058	トランコム	2,800	7,690.00	21,532,000	
9066	日新	8,800	2,591.00	22,800,800	
9301	三菱倉庫	35,100	2,378.00	83,467,800	貸付有価証券 18,000株(18,000株)
9302	三井倉庫ホールディングス	58,000	340.00	19,720,000	
9303	住友倉庫	70,000	682.00	47,740,000	
9304	澁澤倉庫	5,600	1,680.00	9,408,000	
9306	東陽倉庫	18,300	361.00	6,606,300	
9310	日本トランスシティ	24,500	537.00	13,156,500	
9312	ケイヒン	2,000	1,605.00	3,210,000	
9319	中央倉庫	6,200	1,253.00	7,768,600	
9322	川西倉庫	2,100	1,963.00	4,122,300	貸付有価証券 1,200株(1,200株)

9324	安田倉庫	9,100	909.00	8,271,900	
9351	東洋埠頭	3,100	1,707.00	5,291,700	
9358	宇徳	8,700	522.00	4,541,400	
9364	上組	62,500	2,317.00	144,812,500	
9366	サンリツ	2,600	800.00	2,080,000	
9368	キムラユニティー	2,700	1,136.00	3,067,200	
9369	キューソー流通システム	2,900	2,767.00	8,024,300	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
9375	近鉄エクスプレス	19,100	2,313.00	44,178,300	
9380	東海運	5,800	370.00	2,146,000	
9381	エーアイティー	7,200	1,161.00	8,359,200	
9384	内外トランスライン	3,600	1,572.00	5,659,200	貸付有価証券 300株(300株)
9386	日本コンセプト	2,000	1,445.00	2,890,000	
1973	NECネットエスアイ	11,600	2,450.00	28,420,000	
2317	システナ	33,700	1,199.00	40,406,300	
2326	デジタルアーツ	5,200	5,630.00	29,276,000	
2327	新日鉄住金ソリューションズ	15,700	2,854.00	44,807,800	
2335	キューブシステム	6,100	968.00	5,904,800	
2352	エイジア	2,100	1,553.00	3,261,300	
2359	コア	4,400	1,392.00	6,124,800	
3040	ソリトンシステムズ	4,600	996.00	4,581,600	
3371	ソフトクリエイトホールディングス	5,000	1,699.00	8,495,000	
3626	T I S	35,000	4,955.00	173,425,000	
3627	ネオス	3,100	438.00	1,357,800	貸付有価証券 100株(100株)
3630	電算システム	3,700	2,091.00	7,736,700	
3632	グリー	56,300	597.00	33,611,100	貸付有価証券 34,600株(34,600株)
3635	コーエーテクモホールディングス	17,900	2,220.00	39,738,000	貸付有価証券 14,800株(14,800株)
3636	三菱総合研究所	4,100	4,775.00	19,577,500	
3639	ボルテージ	2,100	837.00	1,757,700	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
3640	電算	1,200	2,228.00	2,673,600	
3648	A G S	5,900	881.00	5,197,900	
3649	ファインデックス	8,700	839.00	7,299,300	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
3654	ヒト・コミュニケーションズ	2,400	2,076.00	4,982,400	貸付有価証券 800株(800株)
3655	ブレインパッド	2,200	3,875.00	8,525,000	貸付有価証券 600株(600株)
3656	K L a b	19,900	1,461.00	29,073,900	貸付有価証券 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ングス	7,600	2,340.00	17,784,000	



3658	イーブックイニシアティブジャパン	1,700	1,182.00	2,009,400	
3659	ネクソン	236,500	1,597.00	377,690,500	貸付有価証券 90,200株（90,200株）
3660	アイスタイル	26,700	1,131.00	30,197,700	貸付有価証券 4,400株（4,400株）
3661	エムアップ	3,500	1,619.00	5,666,500	
3662	エイチーム	6,600	2,373.00	15,661,800	
3666	テクノスジャパン	9,500	985.00	9,357,500	貸付有価証券 2,000株（2,000株）
3667	e n i s h	3,600	847.00	3,049,200	貸付有価証券 2,700株（2,700株）
3668	コロブラ	30,000	732.00	21,960,000	貸付有価証券 10,400株（10,400株）
3669	モバイルクリエイト	8,500	315.00	2,677,500	貸付有価証券 2,600株（2,600株）
3672	オルトプラス	6,000	687.00	4,122,000	貸付有価証券 4,800株（4,800株）
3673	ブロードリーフ	52,100	606.00	31,572,600	
3675	クロス・マーケティンググループ	2,900	666.00	1,931,400	
3676	ハーツユナイテッドグループ	5,600	1,612.00	9,027,200	
3678	メディアドゥホールディングス	3,400	2,347.00	7,979,800	
3681	ブイキューブ	6,500	559.00	3,633,500	貸付有価証券 2,400株（2,400株）
3683	サイバーリンクス	1,600	1,101.00	1,761,600	
3686	ディー・エル・イー	6,800	574.00	3,903,200	貸付有価証券 1,700株（1,700株）
3687	フィックスターズ	10,000	1,553.00	15,530,000	貸付有価証券 5,000株（5,000株）
3688	VOYAGE GROUP	5,500	1,158.00	6,369,000	
3694	オプティム	1,800	2,587.00	4,656,600	
3696	セレス	3,200	1,624.00	5,196,800	貸付有価証券 1,900株（1,900株）
3724	ベリサーブ	1,400	3,505.00	4,907,000	貸付有価証券 800株（800株）
3738	ティーガイア	10,500	2,995.00	31,447,500	
3741	セック	1,400	3,115.00	4,361,000	
3751	日本アジアグループ	11,000	483.00	5,313,000	
3756	豆蔵ホールディングス	7,800	967.00	7,542,600	
3762	テクマトリックス	5,800	2,224.00	12,899,200	
3763	プロシップ	1,500	2,588.00	3,882,000	
3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	284,800	282.00	80,313,600	貸付有価証券 191,500株（191,500株）
3769	GMOペイメントゲートウェイ	8,600	13,490.00	116,014,000	貸付有価証券 6,800株（6,800株）
3770	ザッパラス	5,000	372.00	1,860,000	
3771	システムリサーチ	1,400	3,230.00	4,522,000	
3774	インターネットイニシアティブ	17,100	2,260.00	38,646,000	

3778	さくらインターネット	12,500	832.00	10,400,000	
3784	ヴィンクス	2,900	1,039.00	3,013,100	
3788	GMOクラウド	2,300	3,070.00	7,061,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
3817	SRAホールディングス	5,600	2,890.00	16,184,000	
3822	Minorisソリューションズ	2,000	1,620.00	3,240,000	
3826	システムインテグレータ	1,500	1,019.00	1,528,500	
3834	朝日ネット	9,600	517.00	4,963,200	
3835	eBASE	2,700	1,670.00	4,509,000	
3836	アバント	2,800	944.00	2,643,200	
3837	アドソル日進	4,000	1,658.00	6,632,000	
3843	フリービット	7,000	1,366.00	9,562,000	
3844	コムチュア	5,300	2,779.00	14,728,700	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
3852	サイバーコム	1,900	1,881.00	3,573,900	貸付有価証券 500株(500株)
3853	インフォテリア	5,200	1,023.00	5,319,600	
3901	マークライنز	5,200	2,683.00	13,951,600	
3902	メディカル・データ・ビジョン	8,000	1,549.00	12,392,000	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
3903	gumi	12,100	749.00	9,062,900	貸付有価証券 9,400株(9,400株)
3909	ショーケース・ティービー	2,000	1,320.00	2,640,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
3912	モバイルファクトリー	2,600	1,690.00	4,394,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
3916	デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,600	1,115.00	5,129,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
3918	PCIホールディングス	1,800	3,060.00	5,508,000	
3919	パイブドHD	1,600	1,054.00	1,686,400	
3920	アイビーシー	1,700	2,108.00	3,583,600	貸付有価証券 600株(600株)
3921	ネオジャパン	2,500	1,771.00	4,427,500	
3926	オーブンドア	4,200	2,098.00	8,811,600	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
3928	マイネット	2,800	1,291.00	3,614,800	
3932	アカツキ	2,800	4,045.00	11,326,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
3934	ベネフィットジャパン	600	1,293.00	775,800	
3937	Ubicomホールディングス	1,500	1,046.00	1,569,000	
3938	LINE	31,700	4,575.00	145,027,500	貸付有価証券 10,000株(10,000株)
3963	シンクロ・フード	3,500	990.00	3,465,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
3964	オークネット	4,400	1,491.00	6,560,400	
3975	AOI TYO Holdings	8,600	1,376.00	11,833,600	貸付有価証券 2,600株(2,600株)

3978	マクロミル	13,200	2,666.00	35,191,200	貸付有価証券 8,100株(8,100株)
3981	ビーグリー	2,400	1,603.00	3,847,200	
3983	オロ	1,000	3,060.00	3,060,000	
4284	ソルクシーズ	4,000	1,325.00	5,300,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
4295	フェイス	3,700	1,368.00	5,061,600	
4299	ハイマックス	1,400	1,801.00	2,521,400	
4307	野村総合研究所	66,700	5,480.00	365,516,000	
4312	サイバネットシステム	8,600	883.00	7,593,800	
4320	C E ホールディングス	2,700	790.00	2,133,000	
4323	日本システム技術	1,700	1,517.00	2,578,900	
4326	インテージホールディングス	12,400	1,203.00	14,917,200	
4333	東邦システムサイエンス	3,500	873.00	3,055,500	
4344	ソースネクスト	14,800	803.00	11,884,400	貸付有価証券 7,800株(7,800株)
4662	フォーカスシステムズ	6,000	809.00	4,854,000	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
4674	クレスコ	2,400	3,205.00	7,692,000	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
4676	フジ・メディア・ホールディングス	110,000	1,849.00	203,390,000	
4684	オービック	33,100	9,230.00	305,513,000	
4686	ジャストシステム	17,100	2,224.00	38,030,400	
4687	T D C ソフト	4,600	1,648.00	7,580,800	
4689	ヤフー	757,300	370.00	280,201,000	貸付有価証券 393,300株(393,300株)
4704	トレンドマイクロ	51,300	6,140.00	314,982,000	
4709	インフォメーション・ディベロプメント	3,300	1,340.00	4,422,000	
4716	日本オラクル	17,000	8,500.00	144,500,000	
4719	アルファシステムズ	3,500	2,318.00	8,113,000	
4722	フューチャー	14,300	1,377.00	19,691,100	
4725	C A C Holdings	7,900	1,067.00	8,429,300	
4726	ソフトバンク・テクノロジー	4,400	1,565.00	6,886,000	
4728	トーセ	2,800	1,062.00	2,973,600	
4733	オービックビジネスコンサルタント	5,400	7,810.00	42,174,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	47,900	1,909.00	91,441,100	
4743	アイティフォー	12,700	1,241.00	15,760,700	
4746	東計電算	1,900	3,050.00	5,795,000	
4762	エクスネット	1,600	900.00	1,440,000	
4768	大塚商会	63,100	4,500.00	283,950,000	
4776	サイボウズ	14,000	541.00	7,574,000	
4779	ソフトブレーン	8,200	649.00	5,321,800	貸付有価証券 6,800株(6,800株)
4812	電通国際情報サービス	6,500	3,265.00	21,222,500	

4819	デジタルガレージ	18,900	4,350.00	82,215,000	
4820	E Mシステムズ	7,200	1,138.00	8,193,600	
4825	ウェザーニューズ	3,500	3,315.00	11,602,500	
4826	C I J	8,200	690.00	5,658,000	
4828	東洋ビジネスエンジニアリング	1,000	2,026.00	2,026,000	
4829	日本エンタープライズ	10,800	217.00	2,343,600	貸付有価証券 3,700株(3,700株)
4839	WOWOW	5,000	3,490.00	17,450,000	
4845	スカラ	8,400	1,012.00	8,500,800	
6879	イマジカ・ロボット ホールディングス	8,900	898.00	7,992,200	
7518	ネットワンシステムズ	42,900	1,884.00	80,823,600	貸付有価証券 28,800株(28,800株)
7527	システムソフト	24,800	138.00	3,422,400	貸付有価証券 14,800株(14,800株)
7595	アルゴグラフィックス	4,800	3,540.00	16,992,000	
7844	マーベラス	17,800	901.00	16,037,800	貸付有価証券 12,500株(12,500株)
7860	エイベックス	19,500	1,483.00	28,918,500	
8056	日本ユニシス	29,200	2,660.00	77,672,000	
8096	兼松エレクトロニクス	6,700	3,950.00	26,465,000	
9401	東京放送ホールディングス	58,100	2,491.00	144,727,100	
9404	日本テレビホールディングス	96,400	1,862.00	179,496,800	貸付有価証券 5,500株(5,500株)
9405	朝日放送グループホールディングス	10,400	838.00	8,715,200	
9409	テレビ朝日ホールディングス	28,900	2,383.00	68,868,700	
9412	スカパーJ S A Tホールディングス	80,200	509.00	40,821,800	
9413	テレビ東京ホールディングス	8,600	3,400.00	29,240,000	
9414	日本BS放送	3,500	1,346.00	4,711,000	
9416	ビジョン	2,700	3,650.00	9,855,000	
9418	USEN-NEXT HOLDINGS	2,700	1,197.00	3,231,900	
9419	ワイヤレスゲート	4,900	1,292.00	6,330,800	
9422	コネクシオ	7,400	1,851.00	13,697,400	
9424	日本通信	94,700	209.00	19,792,300	貸付有価証券 41,400株(41,400株)
9428	クロップス	2,200	867.00	1,907,400	
9432	日本電信電話	753,800	5,137.00	3,872,270,600	
9433	K D D I	945,800	3,016.00	2,852,532,800	
9435	光通信	12,700	20,120.00	255,524,000	
9437	NTTドコモ	754,200	2,807.50	2,117,416,500	貸付有価証券 274,100株(274,100株)
9438	エムティーアイ	12,100	605.00	7,320,500	
9449	GMOインターネット	38,300	2,703.00	103,524,900	貸付有価証券 28,900株(28,900株)

9466	アйдママーケティングコミュニケーション	2,200	917.00	2,017,400	
9468	カドカワ	30,600	1,216.00	37,209,600	貸付有価証券 9,600株(9,600株)
9470	学研ホールディングス	3,500	5,110.00	17,885,000	
9474	ゼンリン	19,000	2,578.00	48,982,000	貸付有価証券 100株(100株)
9475	昭文社	4,800	767.00	3,681,600	
9479	インプレスホールディングス	8,700	167.00	1,452,900	
9600	アイネット	5,900	1,767.00	10,425,300	
9601	松竹	6,900	16,310.00	112,539,000	貸付有価証券 5,100株(5,100株)
9602	東宝	69,100	3,820.00	263,962,000	
9605	東映	3,900	11,410.00	44,499,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	326,300	1,266.00	413,095,800	
9629	ピー・シー・エー	1,500	1,802.00	2,703,000	
9658	ビジネスブレイン太田昭和	1,800	2,273.00	4,091,400	
9682	D T S	10,900	4,205.00	45,834,500	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	48,800	5,630.00	274,744,000	
9692	シーイーシー	6,200	4,065.00	25,203,000	
9697	カプコン	45,000	2,678.00	120,510,000	
9702	アイ・エス・ピー	2,000	1,902.00	3,804,000	
9717	ジャステック	6,100	1,152.00	7,027,200	
9719	S C S K	24,200	5,210.00	126,082,000	
9739	日本システムウェア	3,500	2,201.00	7,703,500	
9742	アイネス	13,300	1,101.00	14,643,300	
9746	T K C	8,900	4,030.00	35,867,000	
9749	富士ソフト	14,600	4,635.00	67,671,000	
9759	N S D	17,200	2,517.00	43,292,400	
9766	コナミホールディングス	42,900	5,750.00	246,675,000	
9790	福井コンピュータホールディングス	3,100	1,889.00	5,855,900	
9889	J B C Cホールディングス	8,300	1,162.00	9,644,600	
9928	ミロク情報サービス	9,300	2,807.00	26,105,100	
9984	ソフトバンクグループ	475,500	8,198.00	3,898,149,000	貸付有価証券 266,800株(266,800株)
1352	ハウスイ	800	1,127.00	901,600	
2676	高千穂交易	4,100	1,158.00	4,747,800	
2692	伊藤忠食品	2,600	6,120.00	15,912,000	
2715	エレマテック	4,900	2,690.00	13,181,000	
2729	J A L U X	3,000	2,999.00	8,997,000	
2733	あらた	5,200	6,540.00	34,008,000	
2737	トーメンデバイス	1,600	2,876.00	4,601,600	
2760	東京エレクトロン デバイス	3,800	1,959.00	7,444,200	

2767	フィールズ	8,100	976.00	7,905,600	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
2768	双日	623,900	405.00	252,679,500	
2784	アルフレッサホールディングス	117,200	2,630.00	308,236,000	
2874	横浜冷凍	26,800	1,008.00	27,014,400	貸付有価証券 19,300株(19,300株)
3004	神栄	1,400	1,420.00	1,988,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
3023	ラサ商事	4,600	956.00	4,397,600	
3031	ラクーン	6,200	561.00	3,478,200	
3036	アルコニックス	11,200	1,644.00	18,412,800	貸付有価証券 8,800株(8,800株)
3038	神戸物産	6,800	5,010.00	34,068,000	
3053	ベッパーフードサービス	7,600	4,755.00	36,138,000	貸付有価証券 5,300株(5,300株)
3076	あいホールディングス	16,900	2,416.00	40,830,400	
3079	ディーブイエックス	3,700	1,385.00	5,124,500	
3107	ダイワボウホールディングス	9,000	5,960.00	53,640,000	
3132	マクニカ・富士エレホールディングス	20,200	1,721.00	34,764,200	貸付有価証券 14,000株(14,000株)
3139	ラクト・ジャパン	2,000	6,060.00	12,120,000	
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	19,800	1,124.00	22,255,200	
3153	八洲電機	8,100	954.00	7,727,400	
3154	メディアスホールディングス	5,800	1,035.00	6,003,000	
3156	UKCホールディングス	6,800	2,314.00	15,735,200	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
3157	ジューテックホールディングス	2,400	1,155.00	2,772,000	貸付有価証券 700株(700株)
3160	大光	2,600	778.00	2,022,800	
3166	OCHIホールディングス	3,100	1,437.00	4,454,700	
3167	TOKAIホールディングス	55,700	1,078.00	60,044,600	
3173	Cominix	1,600	914.00	1,462,400	
3176	三洋貿易	5,300	2,148.00	11,384,400	
3180	ビューティガレージ	1,400	2,218.00	3,105,200	貸付有価証券 200株(200株)
3183	ウイン・パートナーズ	7,600	1,470.00	11,172,000	
3321	ミタチ産業	2,500	950.00	2,375,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
3360	シップヘルスケアホールディングス	22,000	4,080.00	89,760,000	
3388	明治電機工業	3,600	1,950.00	7,020,000	
3392	デリカフーズホールディングス	2,000	1,600.00	3,200,000	
3393	スターティアホールディングス	2,400	667.00	1,600,800	
3543	コメダホールディングス	19,500	2,154.00	42,003,000	
5009	富士興産	4,100	625.00	2,562,500	
6973	協栄産業	1,300	2,076.00	2,698,800	貸付有価証券 1,000株(1,000株)

7414	小野建	9,300	1,897.00	17,642,100	
7420	佐島電機	7,800	1,052.00	8,205,600	
7427	エコートレーディング	2,400	711.00	1,706,400	
7433	伯東	6,400	1,641.00	10,502,400	
7438	コンドーテック	8,400	1,019.00	8,559,600	
7442	中山福	6,000	746.00	4,476,000	
7447	ナガイレーベン	15,200	2,812.00	42,742,400	
7451	三菱食品	11,600	2,927.00	33,953,200	
7456	松田産業	7,700	1,646.00	12,674,200	
7458	第一興商	15,700	5,270.00	82,739,000	
7459	メディパルホールディングス	105,600	2,250.00	237,600,000	
7466	S P K	2,300	2,813.00	6,469,900	
7467	萩原電気ホールディングス	3,800	3,200.00	12,160,000	
7476	アズワン	8,300	7,770.00	64,491,000	
7480	スズデン	3,700	1,608.00	5,949,600	
7481	尾家産業	3,100	1,398.00	4,333,800	
7482	シモジマ	6,400	1,123.00	7,187,200	
7483	ドウシシャ	11,200	2,501.00	28,011,200	
7487	小津産業	2,300	2,085.00	4,795,500	
7504	高速	6,300	1,342.00	8,454,600	
7510	たけびし	3,700	1,665.00	6,160,500	
7525	リックス	2,400	1,937.00	4,648,800	
7537	丸文	9,300	852.00	7,923,600	
7552	ハピネット	7,200	1,363.00	9,813,600	
7570	橋本総業ホールディングス	2,200	1,783.00	3,922,600	
7575	日本ライフライン	30,000	2,715.00	81,450,000	貸付有価証券 5,000株（5,000株）
7591	エクセル	4,200	2,554.00	10,726,800	
7594	マルカキカイ	3,400	1,945.00	6,613,000	
7599	I D O M	32,000	627.00	20,064,000	
7600	日本エム・ディ・エム	7,000	1,052.00	7,364,000	
7607	進和	6,200	2,415.00	14,973,000	
7608	エスケイジャパン	2,500	445.00	1,112,500	
7609	ダイترون	4,800	2,260.00	10,848,000	
7613	シークス	13,400	2,320.00	31,088,000	貸付有価証券 9,800株（9,800株）
7619	田中商事	3,200	705.00	2,256,000	
7628	オーハシテクニカ	5,900	1,802.00	10,631,800	
7637	白銅	3,800	2,316.00	8,800,800	
8001	伊藤忠商事	773,700	2,005.00	1,551,268,500	貸付有価証券 323,400株（323,400株）
8002	丸紅	866,400	827.90	717,292,560	
8007	高島	1,800	2,137.00	3,846,600	

8012	長瀬産業	63,500	1,741.00	110,553,500	
8014	蝶理	6,700	1,937.00	12,977,900	
8015	豊田通商	117,700	3,735.00	439,609,500	
8018	三共生興	17,900	463.00	8,287,700	
8020	兼松	44,900	1,645.00	73,860,500	
8025	ツカモトコーポレーション	1,900	1,212.00	2,302,800	
8031	三井物産	868,600	1,808.50	1,570,863,100	
8032	日本紙パルプ商事	5,500	5,100.00	28,050,000	
8036	日立ハイテクノロジーズ	36,600	4,390.00	160,674,000	
8037	カメイ	13,700	1,682.00	23,043,400	
8038	東都水産	1,600	1,888.00	3,020,800	
8041	OUGホールディングス	1,700	2,787.00	4,737,900	
8043	スターゼン	4,100	5,990.00	24,559,000	
8051	山善	41,200	1,080.00	44,496,000	
8052	椿本興業	2,400	3,875.00	9,300,000	
8053	住友商事	665,000	1,814.00	1,206,310,000	
8057	内田洋行	4,800	3,650.00	17,520,000	
8058	三菱商事	739,800	3,083.00	2,280,803,400	
8059	第一実業	4,800	3,360.00	16,128,000	
8060	キャノンマーケティングジャパン	30,100	2,260.00	68,026,000	
8061	西華産業	6,400	2,448.00	15,667,200	貸付有価証券 2,900株(2,900株)
8065	佐藤商事	9,400	1,272.00	11,956,800	
8068	菱洋エレクトロ	9,800	1,730.00	16,954,000	貸付有価証券 7,200株(7,200株)
8070	東京産業	10,500	619.00	6,499,500	
8074	ユアサ商事	10,000	3,570.00	35,700,000	
8075	神鋼商事	2,400	2,983.00	7,159,200	
8077	小林産業	7,000	342.00	2,394,000	貸付有価証券 5,200株(5,200株)
8078	阪和興業	19,700	4,275.00	84,217,500	
8079	正栄食品工業	5,800	3,795.00	22,011,000	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
8081	カナデン	10,100	1,406.00	14,200,600	
8084	菱電商事	7,600	1,840.00	13,984,000	
8087	フルサト工業	5,800	1,819.00	10,550,200	
8088	岩谷産業	23,400	3,820.00	89,388,000	
8089	すてきナイスグループ	4,500	1,335.00	6,007,500	
8090	昭光通商	37,000	101.00	3,737,000	
8091	ニチモウ	1,600	1,681.00	2,689,600	
8093	極東貿易	15,000	421.00	6,315,000	
8095	イワキ	14,800	434.00	6,423,200	
8097	三愛石油	28,300	1,339.00	37,893,700	
8098	稲畑産業	25,300	1,532.00	38,759,600	



8101	G S Iクレオス	2,800	1,506.00	4,216,800	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
8103	明和産業	9,700	497.00	4,820,900	
8125	ワキタ	22,500	1,143.00	25,717,500	
8129	東邦ホールディングス	31,200	2,650.00	82,680,000	
8130	サンゲツ	35,100	2,251.00	79,010,100	貸付有価証券 9,300株(9,300株)
8131	ミツウロコグループホールディングス	15,300	848.00	12,974,400	
8132	シナネンホールディングス	4,300	2,722.00	11,704,600	
8133	伊藤忠エネクス	23,300	1,043.00	24,301,900	
8136	サンリオ	29,600	2,055.00	60,828,000	貸付有価証券 13,700株(13,700株)
8137	サンワテクノス	6,800	1,574.00	10,703,200	
8140	リョーサン	13,300	3,840.00	51,072,000	貸付有価証券 8,100株(8,100株)
8141	新光商事	11,600	1,754.00	20,346,400	貸付有価証券 200株(200株)
8142	トーヨー	4,800	2,597.00	12,465,600	
8150	三信電気	9,700	1,900.00	18,430,000	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
8151	東陽テクニカ	12,100	892.00	10,793,200	貸付有価証券 5,900株(5,900株)
8153	モスフードサービス	13,800	3,255.00	44,919,000	
8154	加賀電子	9,500	2,561.00	24,329,500	
8158	ソーダニッカ	10,900	731.00	7,967,900	
8159	立花エレテック	7,100	2,089.00	14,831,900	
8275	フォーバル	4,600	884.00	4,066,400	
8283	P A L T A C	14,800	6,030.00	89,244,000	
8285	三谷産業	12,200	344.00	4,196,800	
8835	太平洋興発	4,400	967.00	4,254,800	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
9260	西本Wismettacホールディングス	2,900	5,720.00	16,588,000	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
9265	ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	1,502.00	1,201,600	
9305	ヤマタネ	5,300	2,288.00	12,126,400	
9763	丸紅建材リース	10,000	242.00	2,420,000	
9810	日鉄住金物産	8,200	5,500.00	45,100,000	
9824	泉州電業	3,500	3,330.00	11,655,000	
9830	トラスコ中山	21,900	2,789.00	61,079,100	
9832	オートボックスセブン	41,900	1,955.00	81,914,500	貸付有価証券 19,100株(19,100株)
9837	モリト	8,400	1,009.00	8,475,600	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
9869	加藤産業	16,500	3,780.00	62,370,000	
9880	イノテック	9,100	1,367.00	12,439,700	
9882	イエローハット	10,000	3,190.00	31,900,000	

9896	J Kホールディングス	10,600	879.00	9,317,400	
9902	日伝	8,700	2,096.00	18,235,200	
9930	北沢産業	8,700	260.00	2,262,000	貸付有価証券 6,400株(6,400株)
9932	杉本商事	5,700	1,890.00	10,773,000	
9934	因幡電機産業	14,000	4,550.00	63,700,000	
9957	パイテックホールディングス	4,800	2,243.00	10,766,400	
9960	東テク	3,500	2,638.00	9,233,000	
9962	ミスミグループ本社	122,500	3,165.00	387,712,500	
9972	アルテック	9,000	308.00	2,772,000	貸付有価証券 5,600株(5,600株)
9982	タキヒヨー	3,500	2,407.00	8,424,500	
9986	蔵王産業	1,700	1,672.00	2,842,400	
9987	スズケン	48,100	4,690.00	225,589,000	
9991	ジェコス	7,300	1,078.00	7,869,400	
9995	ルネサスイーストン	9,700	568.00	5,509,600	
2651	ローソン	26,700	6,960.00	185,832,000	貸付有価証券 22,300株(22,300株)
2659	サンエー	8,000	5,470.00	43,760,000	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
2664	カワチ薬品	8,200	2,264.00	18,564,800	
2670	エービーシー・マート	19,200	6,220.00	119,424,000	
2674	ハードオフコーポレーション	4,600	968.00	4,452,800	
2678	アスクル	9,200	3,435.00	31,602,000	
2681	ゲオホールディングス	19,300	1,465.00	28,274,500	
2685	アダストリア	16,200	1,442.00	23,360,400	
2686	ジーフット	6,400	770.00	4,928,000	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,300	785.00	1,020,500	
2695	くらコーポレーション	6,200	7,170.00	44,454,000	
2698	キャンドウ	5,000	1,771.00	8,855,000	
2726	パルグループホールディングス	5,400	2,723.00	14,704,200	
2730	エディオン	40,900	1,084.00	44,335,600	貸付有価証券 33,000株(33,000株)
2734	サーラコーポレーション	18,100	696.00	12,597,600	
2735	ワッツ	3,500	1,120.00	3,920,000	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
2742	ハローズ	4,000	2,640.00	10,560,000	
2753	あみやき亭	2,300	4,665.00	10,729,500	
2764	ひらまつ	14,500	506.00	7,337,000	貸付有価証券 10,700株(10,700株)
2791	大黒天物産	2,500	5,110.00	12,775,000	
2792	ハニーズホールディングス	10,200	962.00	9,812,400	
2796	ファーマライズホールディングス	2,400	670.00	1,608,000	
3028	アルベン	8,100	2,417.00	19,577,700	貸付有価証券 2,900株(2,900株)

3030	ハブ	2,600	1,150.00	2,990,000	
3034	クオール	11,600	2,086.00	24,197,600	
3046	ジンス	7,200	6,600.00	47,520,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
3048	ビックカメラ	56,100	1,666.00	93,462,600	
3050	D C Mホールディングス	56,800	1,060.00	60,208,000	貸付有価証券 22,500株(22,500株)
3064	M o n o t a R O	37,500	5,060.00	189,750,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
3067	東京一番フーズ	2,600	680.00	1,768,000	
3073	D Dホールディングス	2,300	2,749.00	6,322,700	貸付有価証券 700株(700株)
3082	きちり	2,800	1,021.00	2,858,800	貸付有価証券 600株(600株)
3085	アークランドサービスホールディングス	8,800	2,499.00	21,991,200	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
3086	J . フロント リテイリング	125,900	1,695.00	213,400,500	
3087	ドール・日レスホールディングス	18,500	2,158.00	39,923,000	
3088	マツモトキヨシホールディングス	43,600	5,040.00	219,744,000	
3091	ブロンコピリー	5,500	4,725.00	25,987,500	
3092	スタートトゥデイ	103,600	4,400.00	455,840,000	
3093	トレジャー・ファクトリー	3,100	724.00	2,244,400	
3097	物語コーポレーション	3,000	10,930.00	32,790,000	
3098	ココカラファイン	11,000	6,870.00	75,570,000	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	197,200	1,368.00	269,769,600	
3134	H a m e e	2,700	1,522.00	4,109,400	貸付有価証券 400株(400株)
3141	ウエルシアホールディングス	27,900	5,810.00	162,099,000	
3148	クリエイトSDホールディングス	15,500	3,205.00	49,677,500	
3159	丸善CHIホールディングス	12,300	382.00	4,698,600	
3169	ミサワ	1,900	463.00	879,700	貸付有価証券 500株(500株)
3172	ティールライフ	1,400	1,367.00	1,913,800	
3175	エー・ピーカンパニー	2,000	696.00	1,392,000	貸付有価証券 700株(700株)
3178	チムニー	3,200	2,910.00	9,312,000	貸付有価証券 600株(600株)
3179	シュッピン	6,400	1,620.00	10,368,000	貸付有価証券 4,400株(4,400株)
3186	ネクステージ	11,300	1,309.00	14,791,700	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
3191	ジョイフル本田	30,900	1,704.00	52,653,600	貸付有価証券 12,700株(12,700株)
3193	鳥貴族	3,500	2,549.00	8,921,500	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
3194	麒麟堂ホールディングス	3,800	2,682.00	10,191,600	
3196	ホットランド	6,100	1,391.00	8,485,100	

3197	すかいらーく	65,500	1,663.00	108,926,500	貸付有価証券 14,900株(14,900株)
3199	綿半ホールディングス	3,900	3,260.00	12,714,000	
3221	ヨシックス	1,700	3,305.00	5,618,500	
3222	ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	35,000	1,423.00	49,805,000	貸付有価証券 25,900株(25,900株)
3313	ブックオフコーポレーション	6,000	785.00	4,710,000	
3319	ゴルフダイジェスト・オンライン	4,300	1,099.00	4,725,700	
3328	B E E N O S	2,500	1,647.00	4,117,500	
3333	あさひ	7,800	1,430.00	11,154,000	貸付有価証券 5,800株(5,800株)
3341	日本調剤	3,700	2,854.00	10,559,800	
3349	コスモス薬品	5,300	22,440.00	118,932,000	
3361	トーエル	5,100	927.00	4,727,700	
3366	一六堂	2,300	409.00	940,700	
3376	オンリー	1,800	921.00	1,657,800	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	441,900	4,780.00	2,112,282,000	
3385	薬王堂	4,600	3,705.00	17,043,000	貸付有価証券 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	28,300	1,655.00	46,836,500	
3391	ツルハホールディングス	22,800	14,190.00	323,532,000	
3395	サンマルクホールディングス	7,600	2,768.00	21,036,800	
3396	フェリシモ	2,700	1,374.00	3,709,800	
3397	トリドールホールディングス	13,000	2,678.00	34,814,000	貸付有価証券 9,400株(9,400株)
3415	T O K Y O B A S E	9,400	900.00	8,460,000	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
3538	ウイルプラスホールディングス	1,000	1,162.00	1,162,000	
3544	サツドラホールディングス	1,700	2,186.00	3,716,200	
3546	ダイユー・リックホールディングス	4,900	1,131.00	5,541,900	
3548	パロックジャパンリミテッド	8,400	968.00	8,131,200	
3549	クスリのアオキホールディングス	8,400	7,520.00	63,168,000	
3561	力の源ホールディングス	2,300	1,447.00	3,328,100	
3563	スシローグローバルホールディングス	11,600	6,510.00	75,516,000	
3564	L I X I L ビバ	13,400	1,717.00	23,007,800	
4350	メディカルシステムネットワーク	12,200	487.00	5,941,400	
4775	総合メディカル	9,200	2,308.00	21,233,600	
7416	はるやまホールディングス	4,900	1,023.00	5,012,700	
7419	ノジマ	18,600	2,524.00	46,946,400	
7421	カッパ・クリエイト	13,100	1,453.00	19,034,300	
7445	ライトオン	8,900	1,019.00	9,069,100	
7448	ジーンズメイト	3,200	701.00	2,243,200	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
7453	良品計画	14,000	39,000.00	546,000,000	

7455	三城ホールディングス	13,000	493.00	6,409,000	
7463	アドヴァン	10,700	952.00	10,186,400	
7475	アルピス	3,400	3,225.00	10,965,000	
7494	コナカ	13,500	509.00	6,871,500	
7506	ハウス オブ ローゼ	1,300	1,753.00	2,278,900	
7508	G - 7ホールディングス	3,100	3,000.00	9,300,000	
7512	イオン北海道	10,600	802.00	8,501,200	
7513	コジマ	15,500	538.00	8,339,000	
7514	ヒマラヤ	3,300	1,161.00	3,831,300	
7516	コーナン商事	15,000	2,619.00	39,285,000	
7520	エコス	4,300	1,669.00	7,176,700	
7522	ワタミ	12,500	1,456.00	18,200,000	貸付有価証券 9,700株(9,700株)
7524	マルシェ	2,800	815.00	2,282,000	
7532	ドンキホーテホールディングス	68,300	5,360.00	366,088,000	
7545	西松屋チェーン	23,100	1,296.00	29,937,600	
7550	ゼンショーホールディングス	54,700	2,810.00	153,707,000	貸付有価証券 40,100株(40,100株)
7554	幸楽苑ホールディングス	6,700	1,715.00	11,490,500	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
7561	ハークスレイ	2,600	1,100.00	2,860,000	
7581	サイゼリヤ	17,400	2,517.00	43,795,800	貸付有価証券 5,500株(5,500株)
7593	V Tホールディングス	35,700	559.00	19,956,300	貸付有価証券 16,500株(16,500株)
7596	魚力	2,900	1,491.00	4,323,900	
7601	ポブラ	2,700	878.00	2,370,600	
7605	フジ・コーポレーション	1,800	2,651.00	4,771,800	
7606	ユナイテッドアローズ	13,100	4,140.00	54,234,000	
7611	ハイデイ日高	13,800	2,695.00	37,191,000	
7615	京都きもの友禅	6,700	646.00	4,328,200	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
7616	コロワイド	35,000	2,961.00	103,635,000	貸付有価証券 25,900株(25,900株)
7618	ピーシーデポコーポレーション	15,700	555.00	8,713,500	
7630	壱番屋	7,400	4,995.00	36,963,000	貸付有価証券 5,800株(5,800株)
7640	トップカルチャー	3,800	408.00	1,550,400	
7646	P L A N T	2,400	1,306.00	3,134,400	
7649	スギホールディングス	23,200	6,640.00	154,048,000	
7918	ヴィア・ホールディングス	12,600	720.00	9,072,000	貸付有価証券 5,300株(5,300株)
8005	スクロール	16,200	556.00	9,007,200	
8008	ヨンドシーホールディングス	10,700	2,626.00	28,098,200	貸付有価証券 1,600株(1,600株)

8028	ユニー・ファミリーマートホールディングス	33,700	12,270.00	413,499,000	
8160	木曽路	12,900	2,805.00	36,184,500	
8163	S R Sホールディングス	12,400	1,017.00	12,610,800	
8165	千趣会	19,100	541.00	10,333,100	
8166	タカキュー	8,100	215.00	1,741,500	
8168	ケーヨー	19,500	562.00	10,959,000	貸付有価証券 13,100株（13,100株）
8173	上新電機	12,400	3,550.00	44,020,000	
8174	日本瓦斯	19,400	6,310.00	122,414,000	貸付有価証券 700株（700株）
8179	ロイヤルホールディングス	18,700	2,979.00	55,707,300	貸付有価証券 13,000株（13,000株）
8181	東天紅	800	1,709.00	1,367,200	
8182	いなげや	11,800	1,797.00	21,204,600	
8184	島忠	23,900	3,475.00	83,052,500	
8185	チヨダ	12,400	2,526.00	31,322,400	
8194	ライフコーポレーション	8,000	2,735.00	21,880,000	
8200	リンガーハット	13,000	2,590.00	33,670,000	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
8201	さが美グループホールディングス	9,000	149.00	1,341,000	
8203	M r M a x H D	13,200	687.00	9,068,400	
8207	テンアライド	9,700	472.00	4,578,400	
8214	A O K Iホールディングス	21,100	1,590.00	33,549,000	貸付有価証券 9,400株（9,400株）
8217	オークワ	15,000	1,135.00	17,025,000	
8218	コメリ	16,300	2,814.00	45,868,200	
8219	青山商事	20,300	3,815.00	77,444,500	
8227	しまむら	12,300	11,160.00	137,268,000	
8230	はせがわ	5,600	496.00	2,777,600	
8233	高島屋	165,000	926.00	152,790,000	貸付有価証券 73,000株（73,000株）
8237	松屋	21,300	1,701.00	36,231,300	貸付有価証券 15,600株（15,600株）
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	49,900	1,689.00	84,281,100	貸付有価証券 11,700株（11,700株）
8244	近鉄百貨店	4,000	4,040.00	16,160,000	
8251	パルコ	10,100	1,259.00	12,715,900	貸付有価証券 7,400株（7,400株）
8252	丸井グループ	100,900	2,339.00	236,005,100	
8255	アクシアル リテイリング	8,700	4,115.00	35,800,500	
8260	井筒屋	5,700	348.00	1,983,600	
8267	イオン	405,700	2,372.50	962,523,250	貸付有価証券 225,600株（225,600株）
8273	イズミ	19,100	6,980.00	133,318,000	
8274	東武ストア	1,300	3,090.00	4,017,000	

8276	平和堂	21,400	2,598.00	55,597,200	
8278	フジ	12,600	2,292.00	28,879,200	
8279	ヤオコー	12,000	6,070.00	72,840,000	貸付有価証券 8,800株(8,800株)
8281	ゼビオホールディングス	14,300	1,752.00	25,053,600	
8282	ケーズホールディングス	92,500	1,135.00	104,987,500	
8289	Olympicグループ	6,200	939.00	5,821,800	
8291	日産東京販売ホールディングス	15,500	357.00	5,533,500	
9267	Genky DrugStores	4,100	4,290.00	17,589,000	貸付有価証券 700株(700株)
9627	アインホールディングス	14,100	8,330.00	117,453,000	貸付有価証券 5,700株(5,700株)
9828	元気寿司	2,700	3,460.00	9,342,000	
9831	ヤマダ電機	353,300	537.00	189,722,100	貸付有価証券 244,400株(244,400株)
9842	アークランドサカモト	17,900	1,618.00	28,962,200	
9843	ニトリホールディングス	41,800	18,305.00	765,149,000	
9850	グルメ杵屋	8,000	1,270.00	10,160,000	
9854	愛眼	8,400	435.00	3,654,000	貸付有価証券 6,200株(6,200株)
9856	ケユーホールディングス	5,500	953.00	5,241,500	
9861	吉野家ホールディングス	34,600	2,195.00	75,947,000	貸付有価証券 26,700株(26,700株)
9887	松屋フーズ	5,100	3,725.00	18,997,500	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
9900	サガミチェーン	14,100	1,403.00	19,782,300	貸付有価証券 10,000株(10,000株)
9919	関西スーパーマーケット	8,000	1,214.00	9,712,000	
9936	王将フードサービス	7,700	6,290.00	48,433,000	
9945	ブレナス	11,800	1,821.00	21,487,800	貸付有価証券 6,100株(6,100株)
9946	ミニストップ	7,800	2,219.00	17,308,200	
9948	アークス	19,800	2,928.00	57,974,400	
9956	バローホールディングス	24,500	2,451.00	60,049,500	貸付有価証券 13,400株(13,400株)
9966	藤久	800	1,497.00	1,197,600	
9974	ベルク	4,700	5,850.00	27,495,000	
9979	大庄	5,600	1,766.00	9,889,600	
9983	ファーストリテイリング	14,100	51,640.00	728,124,000	
9989	サンドラッグ	44,600	4,500.00	200,700,000	
9990	サクスパーホールディングス	9,900	985.00	9,751,500	
9993	ヤマザワ	2,200	1,865.00	4,103,000	
9994	やまや	2,200	3,270.00	7,194,000	
9997	ベルーナ	25,900	1,383.00	35,819,700	
7150	島根銀行	2,200	1,247.00	2,743,400	

7161	じもとホールディングス	71,300	164.00	11,693,200	
7167	めぶきフィナンシャルグループ	548,600	363.00	199,141,800	
7173	東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,300	2,498.00	35,721,400	貸付有価証券 10,800株（10,800株）
7180	九州フィナンシャルグループ	173,200	522.00	90,410,400	
7182	ゆうちょ銀行	299,100	1,275.00	381,352,500	貸付有価証券 34,400株（34,400株）
7184	富山第一銀行	26,800	472.00	12,649,600	
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	630,400	568.00	358,067,200	
7189	西日本フィナンシャルホールディングス	67,600	1,211.00	81,863,600	
7321	関西みらいフィナンシャルグループ	46,200	791.00	36,544,200	
7322	三十三フィナンシャルグループ	8,900	2,011.00	17,897,900	
8303	新生銀行	91,400	1,697.00	155,105,800	貸付有価証券 47,000株（47,000株）
8304	あおぞら銀行	62,900	4,300.00	270,470,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,391,100	625.00	4,619,437,500	
8308	りそなホールディングス	1,158,600	586.40	679,403,040	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	207,600	4,375.00	908,250,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	799,100	4,273.00	3,414,554,300	
8324	第四銀行	12,900	4,390.00	56,631,000	
8325	北越銀行	10,600	2,198.00	23,298,800	
8331	千葉銀行	373,900	779.00	291,268,100	貸付有価証券 210,000株（210,000株）
8334	群馬銀行	214,400	586.00	125,638,400	
8336	武蔵野銀行	16,900	3,300.00	55,770,000	
8337	千葉興業銀行	28,900	470.00	13,583,000	
8338	筑波銀行	43,900	262.00	11,501,800	
8341	七十七銀行	33,100	2,392.00	79,175,200	
8342	青森銀行	8,200	3,215.00	26,363,000	貸付有価証券 5,700株（5,700株）
8343	秋田銀行	6,800	2,993.00	20,352,400	
8344	山形銀行	11,900	2,349.00	27,953,100	貸付有価証券 8,800株（8,800株）
8345	岩手銀行	7,400	4,205.00	31,117,000	
8346	東邦銀行	94,400	401.00	37,854,400	貸付有価証券 40,500株（40,500株）
8349	東北銀行	5,400	1,353.00	7,306,200	
8350	みちのく銀行	6,800	1,756.00	11,940,800	貸付有価証券 3,900株（3,900株）
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	429,000	546.00	234,234,000	
8355	静岡銀行	278,700	1,011.00	281,765,700	
8356	十六銀行	14,200	2,895.00	41,109,000	
8358	スルガ銀行	108,000	959.00	103,572,000	



8359	八十二銀行	191,100	478.00	91,345,800	
8360	山梨中央銀行	65,000	418.00	27,170,000	
8361	大垣共立銀行	16,700	2,802.00	46,793,400	貸付有価証券 6,700株(6,700株)
8362	福井銀行	9,000	2,348.00	21,132,000	
8363	北國銀行	12,000	4,440.00	53,280,000	貸付有価証券 6,100株(6,100株)
8364	清水銀行	4,300	2,139.00	9,197,700	
8365	富山銀行	2,000	4,275.00	8,550,000	
8366	滋賀銀行	99,000	562.00	55,638,000	
8367	南都銀行	12,300	2,850.00	35,055,000	
8368	百五銀行	101,300	440.00	44,572,000	
8369	京都銀行	40,300	5,110.00	205,933,000	
8370	紀陽銀行	39,700	1,797.00	71,340,900	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	70,300	1,484.00	104,325,200	
8379	広島銀行	155,800	740.00	115,292,000	
8381	山陰合同銀行	62,600	985.00	61,661,000	
8382	中国銀行	73,000	1,145.00	83,585,000	
8383	鳥取銀行	3,400	1,695.00	5,763,000	
8385	伊予銀行	150,600	737.00	110,992,200	貸付有価証券 58,000株(58,000株)
8386	百十四銀行	112,000	358.00	40,096,000	
8387	四国銀行	16,200	1,331.00	21,562,200	
8388	阿波銀行	85,000	682.00	57,970,000	貸付有価証券 44,000株(44,000株)
8392	大分銀行	6,100	3,755.00	22,905,500	貸付有価証券 3,300株(3,300株)
8393	宮崎銀行	7,000	3,335.00	23,345,000	
8395	佐賀銀行	6,400	2,430.00	15,552,000	
8396	十八銀行	65,000	283.00	18,395,000	
8397	沖縄銀行	10,300	4,025.00	41,457,500	貸付有価証券 200株(200株)
8399	琉球銀行	20,500	1,643.00	33,681,500	貸付有価証券 7,700株(7,700株)
8410	セブン銀行	396,000	339.00	134,244,000	貸付有価証券 203,600株(203,600株)
8411	みずほフィナンシャルグループ	14,344,200	186.10	2,669,455,620	貸付有価証券 4,644,400株 (4,644,400株)
8416	高知銀行	3,800	1,184.00	4,499,200	
8418	山口フィナンシャルグループ	132,000	1,255.00	165,660,000	貸付有価証券 54,000株(54,000株)
8521	長野銀行	3,500	1,827.00	6,394,500	
8522	名古屋銀行	8,500	3,860.00	32,810,000	貸付有価証券 500株(500株)
8524	北洋銀行	159,100	360.00	57,276,000	貸付有価証券 81,800株(81,800株)

8527	愛知銀行	3,500	4,790.00	16,765,000	
8530	中京銀行	4,300	2,256.00	9,700,800	
8537	大光銀行	3,600	2,162.00	7,783,200	
8541	愛媛銀行	14,700	1,247.00	18,330,900	貸付有価証券 9,000株（9,000株）
8542	トマト銀行	4,100	1,508.00	6,182,800	
8544	京葉銀行	93,000	467.00	43,431,000	貸付有価証券 15,000株（15,000株）
8550	栃木銀行	54,600	382.00	20,857,200	
8551	北日本銀行	3,300	2,592.00	8,553,600	
8558	東和銀行	18,500	1,111.00	20,553,500	
8562	福島銀行	9,900	689.00	6,821,100	
8563	大東銀行	5,100	1,206.00	6,150,600	
8600	トモニホールディングス	87,100	457.00	39,804,700	
8713	フィデアホールディングス	102,500	169.00	17,322,500	
8714	池田泉州ホールディングス	112,100	372.00	41,701,200	
7148	F P G	33,800	1,467.00	49,584,600	
7190	マーキュリアインベストメント	2,900	1,041.00	3,018,900	
8473	S B Iホールディングス	119,400	2,965.00	354,021,000	貸付有価証券 65,300株（65,300株）
8518	日本アジア投資	9,500	342.00	3,249,000	
8595	ジャフコ	15,100	4,585.00	69,233,500	
8601	大和証券グループ本社	903,600	634.40	573,243,840	
8604	野村ホールディングス	1,816,300	540.20	981,165,260	
8609	岡三証券グループ	90,000	532.00	47,880,000	貸付有価証券 43,000株（43,000株）
8613	丸三証券	33,600	1,017.00	34,171,200	貸付有価証券 15,900株（15,900株）
8614	東洋証券	38,000	256.00	9,728,000	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	116,900	715.00	83,583,500	
8617	光世証券	2,500	1,289.00	3,222,500	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
8622	水戸証券	30,500	397.00	12,108,500	貸付有価証券 23,000株（23,000株）
8624	いちよし証券	22,100	1,207.00	26,674,700	
8628	松井証券	51,700	1,047.00	54,129,900	
8692	だいこう証券ビジネス	5,100	600.00	3,060,000	
8698	マネックスグループ	107,600	643.00	69,186,800	貸付有価証券 76,000株（76,000株）
8703	カブドットコム証券	66,400	360.00	23,904,000	
8706	極東証券	14,200	1,426.00	20,249,200	
8707	岩井コスモホールディングス	10,800	1,427.00	15,411,600	
8708	藍澤證券	19,800	778.00	15,404,400	貸付有価証券 2,200株（2,200株）
8732	マネーパートナーズグループ	13,500	397.00	5,359,500	

8742	小林洋行	3,000	294.00	882,000	
7181	かんぽ生命保険	39,900	2,325.00	92,767,500	貸付有価証券 22,700株(22,700株)
8630	SOMPOホールディングス	207,100	4,548.00	941,890,800	貸付有価証券 120,700株(120,700株)
8715	アニコムホールディングス	7,200	4,305.00	30,996,000	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
8725	MS&ADインシュアランスグループホール	276,000	3,415.00	942,540,000	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	86,700	2,144.00	185,884,800	
8750	第一生命ホールディングス	597,200	1,966.00	1,174,095,200	
8766	東京海上ホールディングス	397,700	5,313.00	2,112,980,100	
8769	アドバンテッジリスクマネジメント	3,400	1,234.00	4,195,600	
8795	T&Dホールディングス	326,500	1,676.00	547,214,000	
8798	アドバンスクリエイト	2,500	2,245.00	5,612,500	
7164	全国保証	29,800	5,100.00	151,980,000	
7187	ジェイリース	2,000	765.00	1,530,000	
7191	イントラスト	2,200	759.00	1,669,800	
7198	アルヒ	12,000	2,259.00	27,108,000	
8253	クレディセゾン	80,100	1,703.00	136,410,300	貸付有価証券 44,400株(44,400株)
8423	アクリーティブ	5,800	280.00	1,624,000	
8424	芙蓉総合リース	12,100	7,480.00	90,508,000	
8425	興銀リース	19,800	2,834.00	56,113,200	
8439	東京センチュリー	21,300	6,280.00	133,764,000	貸付有価証券 12,800株(12,800株)
8511	日本証券金融	43,200	605.00	26,136,000	
8515	アイフル	177,200	344.00	60,956,800	
8566	リコーリース	8,300	3,625.00	30,087,500	
8570	イオンフィナンシャルサービス	74,900	2,333.00	174,741,700	貸付有価証券 21,800株(21,800株)
8572	アコム	211,600	427.00	90,353,200	貸付有価証券 109,100株(109,100株)
8584	ジャックス	12,800	2,360.00	30,208,000	
8585	オリエントコーポレーション	228,400	149.00	34,031,600	貸付有価証券 166,900株(166,900株)
8586	日立キャピタル	29,000	2,862.00	82,998,000	貸付有価証券 10,700株(10,700株)
8589	アプラスフィナンシャル	50,700	111.00	5,627,700	貸付有価証券 28,600株(28,600株)
8591	オリックス	704,300	1,774.50	1,249,780,350	
8593	三菱UFJリース	267,900	674.00	180,564,600	
8596	九州リースサービス	4,500	770.00	3,465,000	
8697	日本取引所グループ	303,000	2,086.00	632,058,000	

8771	イー・ギャランティ	5,600	2,081.00	11,653,600	
8772	アサックス	1,500	1,945.00	2,917,500	
8793	NECキャピタルソリューション	4,300	1,931.00	8,303,300	
2337	いちご	150,900	523.00	78,920,700	
2353	日本駐車場開発	127,400	187.00	23,823,800	
3003	ヒューリック	220,400	1,180.00	260,072,000	
3228	三栄建築設計	4,200	1,853.00	7,782,600	貸付有価証券 3,100株(3,100株)
3230	スター・マイカ	5,100	2,452.00	12,505,200	
3231	野村不動産ホールディングス	70,200	2,466.00	173,113,200	
3232	三重交通グループホールディングス	21,400	514.00	10,999,600	
3244	サムティ	9,000	2,089.00	18,801,000	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
3245	ディア・ライフ	11,800	508.00	5,994,400	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
3246	コーセーアールイー	2,400	821.00	1,970,400	
3250	エー・ディー・ワークス	140,000	40.00	5,600,000	貸付有価証券 70,000株(70,000株)
3252	日本商業開発	5,900	1,821.00	10,743,900	
3254	プレサンスコーポレーション	14,500	1,770.00	25,665,000	
3258	ユニゾホールディングス	14,500	2,069.00	30,000,500	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
3271	THEグローバル社	4,900	852.00	4,174,800	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
3276	日本管理センター	7,000	1,294.00	9,058,000	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
3277	サンセイランディック	3,100	1,164.00	3,608,400	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
3280	エストラスト	1,400	917.00	1,283,800	
3284	フージャースホールディングス	25,600	778.00	19,916,800	
3288	オープンハウス	17,200	6,370.00	109,564,000	
3289	東急不動産ホールディングス	255,600	778.00	198,856,800	貸付有価証券 70,100株(70,100株)
3291	飯田グループホールディングス	88,100	2,117.00	186,507,700	貸付有価証券 35,000株(35,000株)
3294	イーグランド	1,700	1,187.00	2,017,900	
3299	ムゲンエステート	6,500	1,088.00	7,072,000	
3452	ビーロッド	1,600	1,584.00	2,534,400	
3454	ファーストブラザーズ	2,900	1,401.00	4,062,900	
3457	ハウスドゥ	1,900	5,080.00	9,652,000	
3458	シーアールイー	1,700	2,113.00	3,592,100	
3465	ケイアイスター不動産	3,800	2,560.00	9,728,000	
3475	グッドコムアセット	1,200	1,790.00	2,148,000	
4666	パーク24	61,600	2,982.00	183,691,200	
4809	パラカ	2,700	2,601.00	7,022,700	

8801	三井不動産	527,200	2,682.00	1,413,950,400	貸付有価証券 202,500株(202,500株)
8802	三菱地所	785,800	1,957.00	1,537,810,600	
8803	平和不動産	18,600	2,130.00	39,618,000	
8804	東京建物	115,400	1,538.00	177,485,200	
8806	ダイビル	27,200	1,136.00	30,899,200	
8818	京阪神ビルディング	17,500	924.00	16,170,000	
8830	住友不動産	253,000	4,154.00	1,050,962,000	
8840	大京	16,800	2,475.00	41,580,000	
8841	テーオーシー	36,400	817.00	29,738,800	
8842	東京楽天地	1,700	5,760.00	9,792,000	
8848	レオパレス21	126,000	613.00	77,238,000	
8850	スターツコーポレーション	14,400	2,650.00	38,160,000	
8860	フジ住宅	13,500	964.00	13,014,000	
8864	空港施設	10,600	612.00	6,487,200	
8869	明和地所	5,800	658.00	3,816,400	
8871	ゴールドクレスト	8,300	1,767.00	14,666,100	
8877	日本エスリード	4,100	1,897.00	7,777,700	
8881	日神不動産	14,000	692.00	9,688,000	
8892	日本エスコン	19,000	643.00	12,217,000	
8897	タカラレーベン	49,500	402.00	19,899,000	
8904	サンヨーハウジング名古屋	5,900	1,194.00	7,044,600	
8905	イオンモール	68,000	1,996.00	135,728,000	
8917	ファースト住建	3,900	1,439.00	5,612,100	
8918	ランド	247,000	13.00	3,211,000	貸付有価証券 32,400株(32,400株)
8919	カチタス	14,400	4,435.00	63,864,000	
8923	トーセイ	12,900	1,218.00	15,712,200	
8928	穴吹興産	1,200	3,325.00	3,990,000	
8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	65,600	1,194.00	78,326,400	貸付有価証券 33,700株(33,700株)
8934	サンフロンティア不動産	12,800	1,283.00	16,422,400	
8935	エフ・ジェー・ネクスト	8,100	1,050.00	8,505,000	
8940	インテリックス	3,000	963.00	2,889,000	
8944	ランドビジネス	5,300	332.00	1,759,600	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
8999	グランディハウス	9,200	497.00	4,572,400	
9706	日本空港ビルデング	30,900	5,540.00	171,186,000	
1954	日本工営	6,900	2,887.00	19,920,300	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
2120	LIFULL	35,500	712.00	25,276,000	貸付有価証券 19,800株(19,800株)
2124	ジェイエイシーリクルートメント	8,200	2,344.00	19,220,800	貸付有価証券 2,400株(2,400株)

2127	日本M&Aセンター	70,800	3,390.00	240,012,000	
2130	メンバーズ	3,400	1,409.00	4,790,600	
2139	中広	1,100	800.00	880,000	
2151	タケエイ	10,600	1,212.00	12,847,200	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
2154	トラスト・テック	4,900	4,125.00	20,212,500	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
2157	コシダカホールディングス	27,400	1,652.00	45,264,800	
2168	パソナグループ	9,700	1,744.00	16,916,800	貸付有価証券 6,100株(6,100株)
2169	C D S	2,800	1,327.00	3,715,600	
2170	リンクアンドモチベーション	18,800	1,372.00	25,793,600	貸付有価証券 13,500株(13,500株)
2174	G C A	11,600	883.00	10,242,800	貸付有価証券 6,100株(6,100株)
2175	エス・エム・エス	20,200	4,200.00	84,840,000	貸付有価証券 10,300株(10,300株)
2181	パーソルホールディングス	94,400	2,502.00	236,188,800	貸付有価証券 56,700株(56,700株)
2183	リニカル	6,600	2,365.00	15,609,000	
2193	クックパッド	32,100	528.00	16,948,800	
2196	エスクリ	3,600	795.00	2,862,000	
2198	アイ・ケイ・ケイ	6,000	828.00	4,968,000	貸付有価証券 3,800株(3,800株)
2301	学情	4,700	1,672.00	7,858,400	
2305	スタジオアリス	5,100	2,624.00	13,382,400	
2309	シミックホールディングス	5,700	2,206.00	12,574,200	
2325	N J S	2,500	1,748.00	4,370,000	
2331	総合警備保障	40,700	5,250.00	213,675,000	貸付有価証券 20,900株(20,900株)
2371	カカクコム	77,000	2,492.00	191,884,000	
2372	アイロムグループ	3,500	2,040.00	7,140,000	
2374	セントケア・ホールディング	4,300	713.00	3,065,900	
2376	サイネックス	1,500	833.00	1,249,500	
2378	ルネサンス	5,000	2,521.00	12,605,000	
2379	ディップ	14,400	2,791.00	40,190,400	貸付有価証券 5,300株(5,300株)
2389	オプトホールディング	7,100	2,389.00	16,961,900	
2395	新日本科学	12,500	497.00	6,212,500	
2398	ツクイ	24,100	952.00	22,943,200	
2410	キャリアデザインセンター	2,600	1,971.00	5,124,600	
2413	エムスリー	107,600	4,515.00	485,814,000	
2418	ツカダ・グローバルホールディング	8,100	638.00	5,167,800	
2424	プラス	800	836.00	668,800	
2427	アウトソーシング	30,500	2,037.00	62,128,500	

2428	ウェルネット	10,300	1,202.00	12,380,600	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
2429	ワールドホールディングス	3,400	3,400.00	11,560,000	
2432	ディー・エヌ・エー	55,100	2,067.00	113,891,700	貸付有価証券 37,000株(37,000株)
2433	博報堂DYホールディングス	142,100	1,808.00	256,916,800	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
2440	ぐるなび	16,200	894.00	14,482,800	
2445	エスアールジータカミヤ	12,100	718.00	8,687,800	貸付有価証券 4,100株(4,100株)
2453	ジャパンベストレスキューシステム	8,100	923.00	7,476,300	
2461	ファンコミュニケーションズ	28,500	716.00	20,406,000	
2462	ライク	4,000	1,810.00	7,240,000	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
2464	ビジネス・ブレークスルー	4,700	439.00	2,063,300	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
2475	WDBホールディングス	4,700	3,180.00	14,946,000	
2485	ティア	4,700	1,057.00	4,967,900	
2487	CDG	900	1,688.00	1,519,200	
2491	パリュウコマース	9,200	1,466.00	13,487,200	貸付有価証券 5,200株(5,200株)
2492	インフォマート	51,700	1,467.00	75,843,900	貸付有価証券 11,400株(11,400株)
2749	JPHホールディングス	32,100	375.00	12,037,500	
3521	エコナックホールディングス	19,900	127.00	2,527,300	
4282	EPSホールディングス	15,400	2,398.00	36,929,200	
4286	レッグス	2,500	1,061.00	2,652,500	
4290	プレステージ・インターナショナル	21,200	1,494.00	31,672,800	
4301	アミューズ	6,800	3,080.00	20,944,000	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
4310	ドリームインキュベータ	3,400	2,170.00	7,378,000	
4318	クイック	6,300	1,725.00	10,867,500	
4319	TAC	6,100	329.00	2,006,900	貸付有価証券 4,300株(4,300株)
4321	ケネディクス	135,500	665.00	90,107,500	
4324	電通	124,600	5,290.00	659,134,000	
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	4,800	1,742.00	8,361,600	
4337	びあ	3,400	6,420.00	21,828,000	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
4343	イオンファンタジー	3,300	6,380.00	21,054,000	
4345	シーティーエス	10,100	1,176.00	11,877,600	
4346	ネクシィーズグループ	3,100	1,676.00	5,195,600	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
4544	みらかホールディングス	30,500	3,195.00	97,447,500	
4641	アルプス技研	9,000	2,427.00	21,843,000	
4651	サニックス	16,300	310.00	5,053,000	
4653	ダイオーズ	2,000	1,326.00	2,652,000	

4658	日本空調サービス	10,700	812.00	8,688,400	
4661	オリエンタルランド	120,900	11,725.00	1,417,552,500	貸付有価証券 20,500株(20,500株)
4665	ダスキン	27,500	2,703.00	74,332,500	
4668	明光ネットワークジャパン	12,900	1,206.00	15,557,400	
4671	ファルコホールディングス	5,200	1,902.00	9,890,400	
4678	秀英予備校	2,200	487.00	1,071,400	
4679	田谷	1,900	688.00	1,307,200	
4680	ラウンドワン	31,700	1,718.00	54,460,600	
4681	リゾートトラスト	43,300	1,974.00	85,474,200	貸付有価証券 4,200株(4,200株)
4694	ビー・エム・エル	13,200	2,817.00	37,184,400	
4696	ワタベウェディング	1,600	502.00	803,200	
4708	りらいあコミュニケーションズ	16,200	1,611.00	26,098,200	
4714	リソー教育	17,300	801.00	13,857,300	
4718	早稲田アカデミー	1,500	2,416.00	3,624,000	
4732	ユー・エス・エス	124,900	2,106.00	263,039,400	
4745	東京個別指導学院	3,600	914.00	3,290,400	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
4751	サイバーエージェント	63,000	6,570.00	413,910,000	貸付有価証券 7,700株(7,700株)
4755	楽天	524,400	708.40	371,484,960	貸付有価証券 272,500株(272,500株)
4763	クリーク・アンド・リバー社	5,300	1,107.00	5,867,100	
4767	テー・オー・ダブリュー	9,800	841.00	8,241,800	
4801	セントラルスポーツ	3,800	4,105.00	15,599,000	貸付有価証券 200株(200株)
4848	フルキャストホールディングス	9,000	2,741.00	24,669,000	
4849	エン・ジャパン	32,800	5,730.00	187,944,000	
5261	リソルホールディングス	1,100	4,350.00	4,785,000	
6028	テクノプロ・ホールディングス	19,300	6,840.00	132,012,000	
6029	アトラ	1,700	670.00	1,139,000	
6032	インターワークス	2,300	1,000.00	2,300,000	
6036	Keepertech 技研	3,300	1,320.00	4,356,000	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
6037	ファーストロジック	2,000	678.00	1,356,000	貸付有価証券 600株(600株)
6044	三機サービス	1,500	1,919.00	2,878,500	
6047	Gunosy	6,100	1,385.00	8,448,500	
6048	デザインワン・ジャパン	2,000	1,252.00	2,504,000	
6050	イー・ガーディアン	4,800	3,100.00	14,880,000	貸付有価証券 3,100株(3,100株)
6054	リブセンス	6,500	565.00	3,672,500	
6055	ジャパンマテリアル	28,000	1,753.00	49,084,000	



6058	ベクトル	12,300	2,321.00	28,548,300	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
6059	ウチヤマホールディングス	5,000	542.00	2,710,000	
6065	ライクキッズネクスト	2,100	1,380.00	2,898,000	
6070	キャリアリンク	3,300	543.00	1,791,900	
6071	I B J	8,200	655.00	5,371,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
6073	アサンテ	3,700	2,069.00	7,655,300	
6077	N・フィールド	5,700	1,692.00	9,644,400	
6078	バリューHR	2,300	2,053.00	4,721,900	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
6080	M&Aキャピタルパートナーズ	2,600	10,100.00	26,260,000	
6082	ライドオンエクスプレスホールディングス	4,200	1,827.00	7,673,400	
6083	E R Iホールディングス	2,900	1,065.00	3,088,500	
6087	アビスト	1,600	4,790.00	7,664,000	
6088	シグマクシス	5,400	1,284.00	6,933,600	
6089	ウィルグループ	4,400	1,042.00	4,584,800	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
6093	エスクロー・エージェント・ジャパン	14,000	436.00	6,104,000	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
6097	日本ビューホテル	3,200	1,388.00	4,441,600	
6098	リクルートホールディングス	789,100	3,146.00	2,482,508,600	
6099	エラン	2,500	2,631.00	6,577,500	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
6171	土木管理総合試験所	3,300	584.00	1,927,200	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
6178	日本郵政	580,400	1,202.00	697,640,800	
6183	ベルシステム24ホールディングス	17,100	1,842.00	31,498,200	
6184	鎌倉新書	1,900	3,365.00	6,393,500	貸付有価証券 800株(800株)
6186	一蔵	1,300	788.00	1,024,400	
6187	L I T A L I C O	2,300	1,994.00	4,586,200	貸付有価証券 600株(600株)
6189	グローバルグループ	1,200	1,904.00	2,284,800	
6191	エボラブルアジア	2,900	2,444.00	7,087,600	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
6194	アトラエ	2,000	2,242.00	4,484,000	
6196	ストライク	2,600	4,480.00	11,648,000	
6197	ソラスト	6,200	3,885.00	24,087,000	
6199	セラク	2,300	890.00	2,047,000	
6200	インソース	3,400	2,214.00	7,527,600	
6538	キャリアインデックス	1,400	3,145.00	4,403,000	
6539	M S - J a p a n	1,000	7,460.00	7,460,000	
6540	船場	2,000	1,163.00	2,326,000	
6546	フルテック	1,100	1,157.00	1,272,700	

6547	グリーンズ	2,200	1,570.00	3,454,000	
6569	日総工産	1,700	5,540.00	9,418,000	
6571	キュービーネットホールディングス	5,100	2,077.00	10,592,700	
7030	スプリックス	900	2,400.00	2,160,000	
8876	リログループ	55,900	2,917.00	163,060,300	貸付有価証券 31,000株(31,000株)
8920	東祥	6,400	4,280.00	27,392,000	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
9603	エイチ・アイ・エス	15,900	3,255.00	51,754,500	貸付有価証券 100株(100株)
9612	ラックランド	2,000	2,683.00	5,366,000	
9616	共立メンテナンス	18,200	6,050.00	110,110,000	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
9619	イチネンホールディングス	11,500	1,410.00	16,215,000	
9621	建設技術研究所	7,100	1,492.00	10,593,200	
9622	スペース	6,600	1,456.00	9,609,600	
9624	長大	4,100	849.00	3,480,900	
9628	燦ホールディングス	2,400	2,490.00	5,976,000	
9632	スバル興業	700	6,400.00	4,480,000	
9633	東京テアトル	4,300	1,433.00	6,161,900	貸付有価証券 3,100株(3,100株)
9644	タナベ経営	2,000	2,056.00	4,112,000	
9663	ナガワ	2,000	4,715.00	9,430,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
9671	よみうりランド	2,200	4,670.00	10,274,000	
9672	東京都競馬	7,600	4,695.00	35,682,000	
9675	常磐興産	4,100	1,843.00	7,556,300	
9678	カナモト	15,600	3,570.00	55,692,000	
9681	東京ドーム	41,400	960.00	39,744,000	
9699	西尾レントオール	10,400	3,550.00	36,920,000	
9704	アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	56,000	33.00	1,848,000	貸付有価証券 40,000株(40,000株)
9715	トランス・コスモス	11,400	2,634.00	30,027,600	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
9716	乃村工藝社	23,900	2,451.00	58,578,900	貸付有価証券 17,600株(17,600株)
9722	藤田観光	4,100	3,435.00	14,083,500	貸付有価証券 2,900株(2,900株)
9726	KNT-CTホールディングス	6,400	1,557.00	9,964,800	貸付有価証券 3,800株(3,800株)
9728	日本管財	10,900	2,226.00	24,263,400	
9729	トーカイ	9,900	2,450.00	24,255,000	
9731	白洋舎	1,200	3,440.00	4,128,000	
9735	セコム	108,500	8,355.00	906,517,500	
9740	セントラル警備保障	4,900	5,110.00	25,039,000	
9743	丹青社	20,900	1,433.00	29,949,700	

9744	メイテック	12,000	5,070.00	60,840,000	
9755	応用地質	11,000	1,448.00	15,928,000	貸付有価証券 100株（100株）
9757	船井総研ホールディングス	21,200	2,482.00	52,618,400	
9760	進学会ホールディングス	4,700	607.00	2,852,900	貸付有価証券 500株（500株）
9765	オオバ	8,000	619.00	4,952,000	貸付有価証券 2,800株（2,800株）
9768	いであ	2,100	1,085.00	2,278,500	
9769	学究社	3,700	1,822.00	6,741,400	
9783	ベネッセホールディングス	37,500	3,995.00	149,812,500	貸付有価証券 18,200株（18,200株）
9787	イオンディライト	12,600	3,810.00	48,006,000	
9788	ナック	6,800	944.00	6,419,200	
9792	ニチイ学館	19,400	1,294.00	25,103,600	
9793	ダイセキ	17,100	3,180.00	54,378,000	
9795	ステップ	3,700	1,693.00	6,264,100	
合 計		130,241,100		264,707,379,160	

(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30年 6月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	8,858,822,938
コール・ローン	473,799,570
株式	323,279,197,521
投資証券	7,692,420,068
派生商品評価勘定	17,986,244
未収入金	133,610,448
未収配当金	461,551,475

[平成30年 6月25日現在]

差入委託証拠金	3,420,448,825
流動資産合計	344,337,837,089
資産合計	344,337,837,089
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	103,925,820
未払解約金	243,290,608
未払利息	1,003
流動負債合計	347,217,431
負債合計	347,217,431
純資産の部	
元本等	
元本	128,302,200,934
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	215,688,418,724
元本等合計	343,990,619,658
純資産合計	343,990,619,658
負債純資産合計	344,337,837,089

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[平成30年 6月25日現在]
1. 期首	平成29年 8月16日
期首元本額	133,928,912,002円
期中追加設定元本額	86,573,857,728円
期中一部解約元本額	92,200,568,796円
元本の内訳	
ファンド・マネジャー（海外株式）	170,757,758円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,064,730,179円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,253,595,625円
eMAXIS バランス（波乗り型）	424,523,881円
コアバランス	344,195円

	[平成30年 6月25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)	7,490,971円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	11,661,932円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	10,412,527円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	5,425,123,616円
海外株式セレクション(ラップ向け)	1,031,458,686円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	595,451,487円
つみたて先進国株式	289,346,616円
つみたて8資産均等バランス	79,919,918円
つみたて4資産均等バランス	17,076,155円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	886,758円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,135,323円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	1,432,272円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	672,388円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	840,254円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	944,873円
eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本)	389,754,426円
eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)	34,354,603円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	10,535,258,736円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,550,895,175円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	1,643,335,894円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	3,145,120,318円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	475,685,294円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	175,406,635円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	921,096,440円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	91,528,958円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	19,896,551円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	33,780,703円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	137,682,473円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	100,989,919円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	305,447,429円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	48,458,312円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	11,113,177,400円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)	186,903,970円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	1,908,822,071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)	45,038,670,652円

	[平成30年 6月25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)	95,049,753円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	31,313,979円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,461,014,832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)	3,112,345,701円
MUAM 全世界株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	7,813,247,024円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	38,467,093円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	219,118,587円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	2,235,375,589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)	629,527,965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)	213,158,518円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	29,937,936円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	1,286,515,396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)	27,774,307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)	479,066,066円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,499,288,234円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	2,185,017円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	6,758,133円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	8,872,076円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	10,670,976円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	67,193,154円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	16,657,967円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	110,804,672円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	23,643,286円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	162,799,976円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	4,448,979,619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)	165,280,589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)	659,200,424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)	638,960,685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)	564,922,007円
合計	128,302,200,934円
2. 受益権の総数	128,302,200,934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29年 8月16日 至 平成30年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<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30年 6月25日現在 ]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <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>

区分	[平成30年 6月25日現在]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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30年 6月25日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	
株式		349,630,134
投資証券		170,949,650
合計		520,579,784

（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30年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）	時価（円）		評価損益（円）
				うち1年超	
市場取引	株価指数先物取引 買建	13,461,566,129	13,376,109,123		85,457,006
	合計	13,461,566,129	13,376,109,123		85,457,006

## （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30年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）	時価（円）		評価損益（円）
				うち1年超	
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				



	アメリカドル	439,087,900		438,691,000	396,900
	カナダドル	28,892,900		28,868,000	24,900
	オーストラリアドル	24,411,600		24,408,000	3,600
	イギリスポンド	43,662,180		43,605,000	57,180
	スイスフラン	22,200,600		22,200,000	600
	ユーロ	76,685,390		76,686,000	610
	合計	634,940,570		634,458,000	482,570

## (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30年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	2.6811円
(1万口当たり純資産額)	(26,811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	43,752	74.11	3,242,460.72	
	ANDEAVOR	11,865	135.05	1,602,368.25	
	ANTERO RESOURCES CORP	15,404	20.81	320,557.24	
	APACHE CORP	30,385	44.76	1,360,032.60	

BAKER HUGHES A GE CO	35,322	32.72	1,155,735.84
CABOT OIL & GAS CORP	37,944	23.11	876,885.84
CHENIERE ENERGY INC	16,407	68.72	1,127,489.04
CHEVRON CORP	155,915	125.10	19,504,966.50
CIMAREX ENERGY CO	7,893	97.69	771,067.17
CONCHO RESOURCES INC	11,882	127.36	1,513,291.52
CONOCOPHILLIPS	95,816	67.78	6,494,408.48
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	8,375	66.20	554,425.00
DEVON ENERGY CORP	42,089	43.28	1,821,611.92
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,934	125.56	996,193.04
EOG RESOURCES INC	47,190	118.51	5,592,486.90
EQT CORP	22,248	53.68	1,194,272.64
EXXON MOBIL CORP	345,963	81.38	28,154,468.94
HALLIBURTON CO	72,129	46.22	3,333,802.38
HELMERICH & PAYNE	8,565	63.70	545,590.50
HESS CORP	22,850	64.57	1,475,424.50
HOLLYFRONTIER CORP	13,507	71.19	961,563.33
KINDER MORGAN INC	160,943	17.39	2,798,798.77
MARATHON OIL CORP	67,901	21.48	1,458,513.48
MARATHON PETROLEUM CORP	39,079	72.62	2,837,916.98
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,403	42.60	1,295,167.80
NEWFIELD EXPLORATION CO	17,563	30.75	540,062.25
NOBLE ENERGY INC	39,408	36.08	1,421,840.64
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	62,523	83.33	5,210,041.59
ONEOK INC	34,165	69.99	2,391,208.35
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,033	29.04	581,758.32
PHILLIPS 66	36,344	112.02	4,071,254.88
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,069	185.65	2,611,909.85
SCHLUMBERGER LTD	113,193	66.58	7,536,389.94
TARGA RESOURCES CORP	17,637	49.45	872,149.65
TECHNIPFMC PLC	35,476	32.34	1,147,293.84
VALERO ENERGY CORP	35,424	112.24	3,975,989.76
WILLIAMS COS INC	69,673	27.64	1,925,761.72
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	18,065	158.08	2,855,715.20
ALBEMARLE CORP	8,841	93.46	826,279.86
AVERY DENNISON CORP	7,252	100.25	727,013.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	19,428	30.42	590,999.76
BALL CORP	26,844	35.91	963,968.04
CELANESE CORP-SERIES A	10,864	114.00	1,238,496.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,222	45.30	870,756.60
CHEMOURS CO/THE	15,852	47.00	745,044.00
CROWN HOLDINGS INC	10,510	45.19	474,946.90

DOWDUPONT INC	190,082	67.00	12,735,494.00
EASTMAN CHEMICAL CO	11,520	102.09	1,176,076.80
ECOLAB INC	21,468	138.87	2,981,261.16
FMC CORP	10,760	88.94	956,994.40
FREEMONT-MCMORAN INC	110,051	16.44	1,809,238.44
INTERNATIONAL PAPER CO	32,968	53.00	1,747,304.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,526	124.60	813,139.60
LYONDELLBASELL INDU-CL A	27,626	111.02	3,067,038.52
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,053	227.43	1,149,203.79
MOSAIC CO/THE	29,909	28.88	863,771.92
NEWMONT MINING CORP	43,107	37.46	1,614,788.22
NUCOR CORP	25,557	66.20	1,691,873.40
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,699	115.28	887,540.72
PPG INDUSTRIES INC	20,448	105.42	2,155,628.16
PRAXAIR INC	23,503	158.14	3,716,764.42
SEALED AIR CORP	13,577	43.55	591,278.35
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,977	396.13	2,763,799.01
STEEL DYNAMICS INC	19,198	47.90	919,584.20
VULCAN MATERIALS CO	10,586	131.57	1,392,800.02
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,087	107.86	332,963.82
WESTROCK CO	20,366	57.97	1,180,617.02
3M CO	48,612	196.50	9,552,258.00
ACUITY BRANDS INC	3,234	121.41	392,639.94
AERCAP HOLDINGS NV	11,344	54.36	616,659.84
AGCO CORP	5,923	60.73	359,703.79
ALLEGION PLC	7,433	77.69	577,469.77
AMETEK INC	18,473	73.00	1,348,529.00
ARCONIC INC	36,975	17.04	630,054.00
BOEING CO/THE	45,636	338.91	15,466,496.76
CATERPILLAR INC	48,791	139.94	6,827,812.54
CUMMINS INC	12,583	136.05	1,711,917.15
DEERE & CO	25,108	143.17	3,594,712.36
DOVER CORP	12,584	72.94	917,876.96
EATON CORP PLC	36,364	76.59	2,785,118.76
EMERSON ELECTRIC CO	51,849	69.87	3,622,689.63
FASTENAL CO	22,967	50.59	1,161,900.53
FLOWSERVE CORP	9,747	40.79	397,580.13
FLUOR CORP	11,229	49.52	556,060.08
FORTIVE CORP	25,016	77.84	1,947,245.44
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	12,220	55.25	675,155.00
GENERAL DYNAMICS CORP	20,739	189.38	3,927,551.82
GENERAL ELECTRIC CO	708,949	13.05	9,251,784.45

HARRIS CORP	9,536	143.70	1,370,323.20
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,559	44.46	691,753.14
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	61,366	144.00	8,836,704.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3,743	212.96	797,109.28
IDEX CORP	6,262	138.66	868,288.92
ILLINOIS TOOL WORKS	25,277	141.46	3,575,684.42
INGERSOLL-RAND PLC	19,953	90.76	1,810,934.28
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,836	64.80	702,172.80
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	63.23	1,119,171.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	17,400	37.03	644,322.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	76,601	33.99	2,603,667.99
L3 TECHNOLOGIES INC	6,248	194.14	1,212,986.72
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,049	199.94	609,617.06
LOCKHEED MARTIN CORP	20,966	299.38	6,276,801.08
MASCO CORP	25,156	38.04	956,934.24
MIDDLEBY CORP	4,487	104.90	470,686.30
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,507	312.06	4,214,994.42
OWENS CORNING	8,513	65.63	558,708.19
PACCAR INC	29,509	62.11	1,832,803.99
PARKER HANNIFIN CORP	10,640	157.38	1,674,523.20
PENTAIR PLC	14,688	42.57	625,268.16
RAYTHEON COMPANY	23,551	193.38	4,554,292.38
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,266	167.98	1,724,482.68
ROCKWELL COLLINS INC	13,689	134.47	1,840,759.83
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,509	276.22	2,350,355.98
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	14,096	51.23	722,138.08
SMITH (A.O.) CORP	11,994	60.27	722,878.38
SNAP-ON INC	4,716	159.67	753,003.72
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	9,301	85.28	793,189.28
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,883	135.00	1,739,205.00
TEXTRON INC	21,056	67.06	1,412,015.36
TRANSDIGM GROUP INC	3,747	342.24	1,282,373.28
UNITED RENTALS INC	6,762	154.95	1,047,771.90
UNITED TECHNOLOGIES CORP	62,027	124.87	7,745,311.49
WABCO HOLDINGS INC	4,688	120.46	564,716.48
WABTEC CORP	6,665	100.70	671,165.50
WW GRAINGER INC	3,802	312.10	1,186,604.20
XYLEM INC	14,371	66.45	954,952.95
CINTAS CORP	7,233	188.63	1,364,360.79
COPART INC	16,600	59.91	994,506.00
COSTAR GROUP INC	2,906	412.09	1,197,533.54
EQUIFAX INC	9,623	126.60	1,218,271.80

IHS MARKIT LTD	31,872	51.25	1,633,440.00
MANPOWERGROUP INC	5,265	91.74	483,011.10
NIELSEN HOLDINGS PLC	29,113	31.12	905,996.56
REPUBLIC SERVICES INC	18,716	69.73	1,305,066.68
ROBERT HALF INTL INC	9,844	69.84	687,504.96
ROLLINS INC	8,873	52.41	465,033.93
STERICYCLE INC	7,535	64.26	484,199.10
TRANSUNION	14,675	71.70	1,052,197.50
VERISK ANALYTICS INC	12,537	107.89	1,352,616.93
WASTE CONNECTIONS INC	21,122	76.43	1,614,354.46
WASTE MANAGEMENT INC	35,831	81.88	2,933,842.28
AMERCO	625	362.50	226,562.50
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,768	41.35	403,906.80
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,867	88.61	1,051,534.87
CSX CORP	69,361	64.78	4,493,205.58
DELTA AIR LINES INC	15,100	52.72	796,072.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,468	74.02	1,070,921.36
FEDEX CORP	20,793	241.77	5,027,123.61
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,213	128.13	924,201.69
KANSAS CITY SOUTHERN	8,465	108.28	916,590.20
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,101	40.60	410,100.60
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,506	151.82	3,568,680.92
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,169	157.80	815,668.20
RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR	2,000	117.41	234,830.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	12,795	51.91	664,188.45
UNION PACIFIC CORP	64,264	143.95	9,250,802.80
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	5,879	72.94	428,814.26
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	56,253	113.70	6,395,966.10
XPO LOGISTICS INC	9,600	108.76	1,044,096.00
APTIV PLC	22,192	96.24	2,135,758.08
AUTOLIV INC	7,065	149.80	1,058,337.00
BORGWARNER INC	17,350	45.09	782,311.50
FORD MOTOR CO	304,171	11.65	3,543,592.15
GENERAL MOTORS CO	103,208	41.25	4,257,330.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	19,283	24.63	474,940.29
HARLEY-DAVIDSON INC	13,887	44.21	613,944.27
LEAR CORP	5,697	195.70	1,114,902.90
TESLA INC	10,423	333.63	3,477,425.49
DR HORTON INC	28,533	40.75	1,162,719.75
GARMIN LTD	9,413	60.23	566,944.99
HANESBRANDS INC	27,455	21.96	602,911.80
HASBRO INC	10,138	91.68	929,451.84

LEGETT & PLATT INC	9,928	43.69	433,754.32
LENNAR CORP-A	22,853	51.20	1,170,073.60
LULULEMON ATHLETICA INC	8,200	124.18	1,018,276.00
MATTEL INC	30,531	17.52	534,903.12
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	12,551	66.63	836,273.13
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	211.87	1,072,485.94
NEWELL BRANDS INC	39,208	26.21	1,027,641.68
NIKE INC -CL B	106,005	73.43	7,783,947.15
NVR INC	289	3,000.65	867,187.85
POLARIS INDUSTRIES INC	4,604	123.28	567,581.12
PULTEGROUP INC	22,739	28.78	654,428.42
PVH CORP	6,270	152.08	953,541.60
RALPH LAUREN CORP	4,829	130.26	629,025.54
TAPESTRY INC	22,831	47.27	1,079,221.37
TOLL BROTHERS INC	11,839	37.11	439,345.29
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	17,106	22.38	382,832.28
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	12,354	20.79	256,839.66
VF CORP	28,021	81.58	2,285,953.18
WHIRLPOOL CORP	5,118	144.65	740,318.70
ARAMARK	20,269	38.25	775,289.25
CARNIVAL CORP	35,332	63.53	2,244,641.96
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,030	469.94	953,978.20
DARDEN RESTAURANTS INC	10,021	108.87	1,090,986.27
DOMINO'S PIZZA INC	3,187	292.39	931,846.93
H&R BLOCK INC	18,404	23.00	423,292.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,900	80.87	1,932,793.00
LAS VEGAS SANDS CORP	32,717	79.80	2,610,816.60
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	24,819	132.61	3,291,247.59
MCDONALD'S CORP	64,874	164.55	10,675,016.70
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	19,000	29.91	568,290.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	42,812	30.07	1,287,356.84
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,441	51.96	906,234.36
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,657	111.55	1,523,438.35
STARBUCKS CORP	114,697	51.24	5,877,074.28
VAIL RESORTS INC	3,253	280.81	913,474.93
WYNN RESORTS LTD	7,782	170.14	1,324,029.48
YUM! BRANDS INC	26,666	80.36	2,142,879.76
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	27,463	56.70	1,557,152.10
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,662	299.30	4,089,036.60
COMCAST CORP-CLASS A	378,352	33.81	12,792,081.12
DISCOVERY INC - A	11,297	28.12	317,671.64
DISCOVERY INC-C	26,257	26.25	689,246.25

DISH NETWORK CORP-A	17,814	34.91	621,886.74
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	31,690	23.91	757,707.90
LIBERTY BROADBAND-C	8,777	77.09	676,618.93
LIBERTY GLOBAL PLC- C	45,691	28.98	1,324,125.18
LIBERTY GLOBAL PLC-A	14,956	30.13	450,624.28
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	6,982	46.22	322,708.04
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	15,093	46.34	699,409.62
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	16,859	35.32	595,459.88
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	11,571	48.73	563,854.83
NEWS CORP - CLASS A	28,895	15.82	457,118.90
OMNICOM GROUP	18,327	75.91	1,391,202.57
SIRIUS XM HOLDINGS INC	132,041	7.14	942,772.74
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	35,058	48.35	1,695,054.30
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	86,864	48.61	4,222,459.04
VIACOM INC-CLASS B	28,860	30.28	873,880.80
WALT DISNEY CO/THE	122,726	106.34	13,050,682.84
ADVANCE AUTO PARTS INC	6,056	138.85	840,875.60
AMAZON.COM INC	33,586	1,715.67	57,622,492.62
AUTOZONE INC	2,199	685.98	1,508,470.02
BEST BUY CO INC	21,539	76.26	1,642,564.14
BOOKING HOLDINGS INC	3,944	2,102.85	8,293,640.40
CARMAX INC	14,817	80.19	1,188,175.23
DOLLAR GENERAL CORP	21,857	100.15	2,188,978.55
DOLLAR TREE INC	18,962	86.99	1,649,504.38
EXPEDIA GROUP INC	10,062	124.83	1,256,039.46
GAP INC/THE	18,563	33.39	619,818.57
GENUINE PARTS CO	11,720	93.04	1,090,428.80
HOME DEPOT INC	95,357	197.41	18,824,425.37
KOHL'S CORP	13,815	73.84	1,020,099.60
L BRANDS INC	20,170	36.69	740,037.30
LKQ CORP	25,697	32.87	844,660.39
LOWE'S COS INC	67,782	98.22	6,657,548.04
MACY'S INC	23,845	37.43	892,518.35
NETFLIX INC	35,423	411.09	14,562,041.07
NORDSTROM INC	9,412	51.43	484,059.16
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,803	286.16	1,946,746.48
QURATE RETAIL INC	35,456	21.13	749,185.28
ROSS STORES INC	30,843	85.98	2,651,881.14
TARGET CORP	42,497	76.04	3,231,471.88
TIFFANY & CO	8,857	133.67	1,183,915.19
TJX COMPANIES INC	51,684	95.08	4,914,114.72
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10,033	76.85	771,036.05

TRIPADVISOR INC	8,261	56.66	468,068.26
ULTA BEAUTY INC	4,632	249.76	1,156,888.32
COSTCO WHOLESALE CORP	35,846	211.10	7,567,090.60
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	27,000	8.82	238,140.00
KROGER CO	70,459	29.69	2,091,927.71
SYSCO CORP	40,994	67.79	2,778,983.26
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	68,735	67.61	4,647,173.35
WALMART INC	120,871	84.82	10,252,278.22
ALTRIA GROUP INC	155,073	57.02	8,842,262.46
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,693	46.53	2,079,565.29
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,074	49.81	1,099,505.94
BUNGE LTD	11,634	71.52	832,063.68
CAMPBELL SOUP CO	14,324	38.60	552,906.40
COCA-COLA CO/THE	330,702	43.25	14,302,861.50
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	18,962	39.91	756,773.42
CONAGRA BRANDS INC	32,637	38.55	1,258,156.35
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,182	231.52	3,283,416.64
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,452	122.37	1,768,491.24
GENERAL MILLS INC	47,500	45.22	2,147,950.00
HERSHEY CO/THE	11,459	92.67	1,061,905.53
HORMEL FOODS CORP	23,767	36.27	862,029.09
INGREDION INC	5,986	109.67	656,484.62
JM SMUCKER CO/THE	9,124	105.71	964,498.04
KELLOGG CO	20,716	67.40	1,396,258.40
KRAFT HEINZ CO/THE	50,195	63.21	3,172,825.95
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,587	106.09	1,017,084.83
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,384	69.02	1,061,803.68
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	121,762	41.30	5,028,770.60
MONSTER BEVERAGE CORP	35,427	56.86	2,014,379.22
PEPSICO INC	115,886	108.37	12,558,565.82
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	126,799	80.19	10,168,011.81
TYSON FOODS INC-CL A	23,768	69.38	1,649,023.84
CHURCH & DWIGHT CO INC	20,216	50.63	1,023,536.08
CLOROX COMPANY	10,289	128.91	1,326,354.99
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,133	64.63	4,403,435.79
COTY INC-CL A	40,711	14.77	601,301.47
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	18,573	152.93	2,840,368.89
KIMBERLY-CLARK CORP	29,002	100.97	2,928,331.94
PROCTER & GAMBLE CO/THE	205,504	77.43	15,912,174.72
ABBOTT LABORATORIES	142,665	61.94	8,836,670.10
ABIOMED INC	3,524	427.29	1,505,769.96
AETNA INC	26,714	190.92	5,100,236.88



ALIGN TECHNOLOGY INC	6,355	353.27	2,245,030.85
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,068	93.50	1,221,858.00
ANTHEM INC	20,933	244.82	5,124,817.06
BAXTER INTERNATIONAL INC	42,061	74.32	3,125,973.52
BECTON DICKINSON AND CO	21,764	237.60	5,171,126.40
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,710	32.62	3,676,600.20
CARDINAL HEALTH INC	25,111	53.98	1,355,491.78
CENTENE CORP	16,977	125.60	2,132,311.20
CERNER CORP	23,881	59.81	1,428,322.61
CIGNA CORP	19,846	174.08	3,454,791.68
COOPER COS INC/THE	3,983	237.23	944,887.09
CVS HEALTH CORP	82,856	72.18	5,980,546.08
DANAHER CORP	51,322	99.30	5,096,274.60
DAVITA INC	11,339	71.95	815,841.05
DENTSPLY SIRONA INC	18,811	44.95	845,554.45
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	16,919	152.87	2,586,407.53
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	46,454	79.23	3,680,550.42
HCA HEALTHCARE INC	22,656	106.74	2,418,301.44
HENRY SCHEIN INC	12,690	74.69	947,816.10
HOLOGIC INC	22,660	40.46	916,823.60
HUMANA INC	11,283	299.98	3,384,674.34
IDEXX LABORATORIES INC	6,979	222.90	1,555,619.10
INTUITIVE SURGICAL INC	9,179	483.21	4,435,384.59
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,125	189.13	1,536,681.25
MCKESSON CORP	16,659	148.88	2,480,191.92
MEDTRONIC PLC	110,676	86.81	9,607,783.56
QUEST DIAGNOSTICS INC	10,912	112.04	1,222,580.48
RESMED INC	11,351	107.93	1,225,113.43
STRYKER CORP	27,557	172.00	4,739,804.00
TELEFLEX INC	3,655	281.71	1,029,650.05
UNITEDHEALTH GROUP INC	78,981	254.37	20,090,396.97
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,182	115.01	826,001.82
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,522	118.40	890,604.80
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,840	82.84	815,145.60
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,973	111.76	1,896,902.48
ABBVIE INC	124,095	93.49	11,601,641.55
AGILENT TECHNOLOGIES INC	27,187	62.79	1,707,071.73
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,855	127.57	2,277,762.35
ALKERMES PLC	12,397	44.13	547,079.61
ALLERGAN PLC	27,195	173.42	4,716,156.90
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,078	104.20	737,527.60
AMGEN INC	55,162	185.15	10,213,244.30

BIOGEN INC	17,327	296.04	5,129,485.08
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	15,010	99.03	1,486,440.30
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	133,316	55.14	7,351,044.24
CELGENE CORP	61,588	78.80	4,853,134.40
ELI LILLY & CO	80,548	85.92	6,920,684.16
GILEAD SCIENCES INC	107,256	71.07	7,622,683.92
ILLUMINA INC	12,012	282.65	3,395,191.80
INCYTE CORP	14,631	74.03	1,083,132.93
IQVIA HOLDINGS INC	12,492	103.84	1,297,169.28
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,881	178.50	871,258.50
JOHNSON & JOHNSON	218,999	122.84	26,901,837.16
MERCK & CO. INC.	220,142	61.47	13,532,128.74
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,048	582.31	1,192,570.88
MYLAN NV	41,125	38.31	1,575,498.75
NEKTAR THERAPEUTICS	12,858	52.85	679,545.30
PERRIGO CO PLC	10,497	75.66	794,203.02
PFIZER INC	486,033	36.51	17,745,064.83
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,609	331.97	2,193,989.73
SEATTLE GENETICS INC	9,185	66.85	614,017.25
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	77,167	23.99	1,851,236.33
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,830	208.75	6,853,262.50
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,243	116.47	377,712.21
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,825	159.19	3,315,131.75
WATERS CORP	6,367	193.87	1,234,370.29
ZOETIS INC	40,083	85.82	3,439,923.06
BANK OF AMERICA CORP	794,090	28.99	23,020,669.10
BB&T CORP	63,642	51.61	3,284,563.62
CIT GROUP INC	9,245	51.35	474,730.75
CITIGROUP INC	209,782	67.20	14,097,350.40
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,272	41.18	1,617,220.96
COMERICA INC	13,887	95.44	1,325,375.28
EAST WEST BANCORP INC	11,619	69.07	802,524.33
FIFTH THIRD BANCORP	56,390	30.10	1,697,339.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,510	100.28	1,354,782.80
HUNTINGTON BANCSHARES INC	92,256	15.35	1,416,129.60
JPMORGAN CHASE & CO	280,070	105.75	29,617,402.50
KEYCORP	85,937	20.40	1,753,114.80
M & T BANK CORP	11,881	172.98	2,055,175.38
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	37,394	11.41	426,665.54
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	26,187	18.55	485,768.85
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	38,611	139.36	5,380,828.96
REGIONS FINANCIAL CORP	92,848	18.53	1,720,473.44

SIGNATURE BANK	4,354	132.75	577,993.50
SUNTRUST BANKS INC	38,250	67.49	2,581,492.50
SVB FINANCIAL GROUP	4,218	310.17	1,308,297.06
US BANCORP	128,079	50.76	6,501,290.04
WELLS FARGO & CO	381,828	53.94	20,595,802.32
ZIONS BANCORPORATION	16,233	55.51	901,093.83
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,645	154.62	718,209.90
ALLY FINANCIAL INC	35,595	26.42	940,419.90
AMERICAN EXPRESS CO	59,756	97.23	5,810,075.88
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,805	146.36	1,727,779.80
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	82,452	56.75	4,679,151.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	104,203	188.91	19,684,988.73
BLACKROCK INC	9,833	522.74	5,140,102.42
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,738	95.01	3,775,507.38
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,248	104.98	970,855.04
CME GROUP INC	27,754	168.42	4,674,328.68
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,089	73.42	2,135,714.38
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,407	64.93	1,389,956.51
EATON VANCE CORP	10,263	53.89	553,073.07
FRANKLIN RESOURCES INC	27,157	32.90	893,465.30
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,488	226.02	6,664,877.76
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	47,994	74.80	3,589,951.20
INVESCO LTD	33,132	27.63	915,437.16
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,317	23.33	590,645.61
MOODY'S CORP	14,283	172.41	2,462,532.03
MORGAN STANLEY	109,806	48.89	5,368,415.34
MSCI INC	7,225	170.63	1,232,801.75
NASDAQ INC	9,460	93.60	885,456.00
NORTHERN TRUST CORP	17,248	107.30	1,850,710.40
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,580	96.02	1,015,891.60
S&P GLOBAL INC	20,855	206.35	4,303,429.25
SCHWAB (CHARLES) CORP	98,883	54.90	5,428,676.70
SEI INVESTMENTS COMPANY	11,275	65.16	734,679.00
STATE STREET CORP	29,624	98.14	2,907,299.36
SYNCHRONY FINANCIAL	60,153	34.13	2,053,021.89
T ROWE PRICE GROUP INC	20,088	123.00	2,470,824.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	22,636	58.39	1,321,716.04
VOYA FINANCIAL INC	14,917	49.37	736,452.29
AFLAC INC	62,899	44.19	2,779,506.81
ALLEGHANY CORP	1,254	585.00	733,590.00
ALLSTATE CORP	29,039	92.24	2,678,557.36
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,873	107.96	634,049.08

AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	73,720	54.46	4,014,791.20
AON PLC	20,179	137.14	2,767,348.06
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,938	26.48	925,158.24
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,643	66.74	977,273.82
ASSURANT INC	3,979	102.37	407,330.23
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	11,930	44.51	531,004.30
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,631	55.93	426,801.83
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,139	44.49	273,124.11
CHUBB LTD	37,936	125.38	4,756,415.68
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,800	68.34	874,752.00
EVEREST RE GROUP LTD	3,407	230.00	783,610.00
FNF GROUP	21,428	36.77	787,907.56
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	28,526	51.78	1,477,076.28
LINCOLN NATIONAL CORP	17,467	65.37	1,141,817.79
LOEWS CORP	22,943	48.77	1,118,930.11
MARKEL CORP	1,118	1,114.68	1,246,212.24
MARSH & MCLENNAN COS	42,002	81.60	3,427,363.20
METLIFE INC	73,426	45.71	3,356,302.46
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,051	55.66	1,283,018.66
PROGRESSIVE CORP	48,035	60.78	2,919,567.30
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,782	96.50	3,356,463.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,302	137.72	730,191.44
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,020	122.62	370,312.40
TORCHMARK CORP	9,098	83.68	761,320.64
TRAVELERS COS INC/THE	21,889	124.41	2,723,210.49
UNUM GROUP	18,854	37.99	716,263.46
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,612	154.16	1,635,945.92
WR BERKLEY CORP	7,557	73.73	557,177.61
XL GROUP LTD	20,495	56.15	1,150,794.25
CBRE GROUP INC - A	26,262	48.80	1,281,585.60
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	92,900	7.21	669,809.00
JONES LANG LASALLE INC	3,602	168.83	608,125.66
SBA COMMUNICATIONS CORP	9,410	162.06	1,524,984.60
ACCENTURE PLC-CL A	50,330	159.63	8,034,177.90
ACTIVISION BLIZZARD INC	58,855	75.98	4,471,802.90
ADOBE SYSTEMS INC	40,118	243.63	9,773,948.34
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	14,274	80.32	1,146,487.68
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,118	236.62	974,401.16
ALPHABET INC-CL A	24,363	1,169.29	28,487,412.27
ALPHABET INC-CL C	25,682	1,155.48	29,675,037.36
ANSYS INC	6,790	179.32	1,217,582.80
AUTODESK INC	18,231	136.51	2,488,713.81

AUTOMATIC DATA PROCESSING	36,195	139.09	5,034,362.55
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,437	116.48	1,099,221.76
CA INC	25,586	36.15	924,933.90
CADENCE DESIGN SYS INC	22,744	43.87	997,779.28
CDK GLOBAL INC	10,796	66.08	713,399.68
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,497	97.48	1,023,247.56
CITRIX SYSTEMS INC	11,613	105.51	1,225,287.63
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48,319	78.70	3,802,705.30
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	16,207	88.78	1,438,857.46
DXC TECHNOLOGY CO	23,881	80.85	1,930,778.85
EBAY INC	79,101	38.09	3,012,957.09
ELECTRONIC ARTS INC	25,305	141.26	3,574,584.30
FACEBOOK INC-A	195,475	201.74	39,435,126.50
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	26,692	107.63	2,872,859.96
FIRST DATA CORP- CLASS A	38,248	21.72	830,746.56
FISERV INC	33,351	75.57	2,520,335.07
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,162	216.31	1,549,212.22
FORTINET INC	12,004	63.93	767,415.72
GARTNER INC	7,391	134.96	997,489.36
GLOBAL PAYMENTS INC	12,728	114.40	1,456,083.20
GODADDY INC - CLASS A	11,900	73.29	872,151.00
IAC/INTERACTIVECORP	6,402	158.50	1,014,717.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	75,214	141.28	10,626,233.92
INTUIT INC	19,875	205.98	4,093,852.50
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,426	131.31	843,798.06
LEIDOS HOLDINGS INC	11,892	58.50	695,682.00
MASTERCARD INC - A	76,170	201.48	15,346,731.60
MERCADOLIBRE INC	3,363	290.86	978,162.18
MICROSOFT CORP	597,016	100.41	59,946,376.56
ORACLE CORP	253,432	44.10	11,176,351.20
PAYCHEX INC	25,826	70.22	1,813,501.72
PAYPAL HOLDINGS INC	93,068	85.12	7,921,948.16
RED HAT INC	14,695	142.14	2,088,747.30
SABRE CORP	18,992	25.75	489,044.00
SALESFORCE.COM INC	55,976	135.01	7,557,319.76
SERVICENOW INC	14,312	176.70	2,528,930.40
SPLUNK INC	11,981	105.23	1,260,760.63
SQUARE INC - A	23,108	65.75	1,519,351.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	17,946	54.88	984,876.48
SYMANTEC CORP	49,586	20.72	1,027,421.92
SYNOPSYS INC	12,082	88.12	1,064,665.84
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,176	116.96	1,073,224.96

TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,241	87.10	1,153,291.10
TWITTER INC	56,368	45.88	2,586,163.84
VERISIGN INC	7,470	138.68	1,035,939.60
VISA INC-CLASS A SHARES	147,093	135.33	19,906,095.69
VMWARE INC-CLASS A	5,717	150.01	857,607.17
WESTERN UNION CO	38,052	21.14	804,419.28
WORKDAY INC-CLASS A	10,959	124.01	1,359,025.59
WORLDPAY INC-CLASS A	23,783	85.08	2,023,457.64
ZILLOW GROUP INC - C	9,488	61.46	583,132.48
AMPHENOL CORP-CL A	25,550	89.20	2,279,060.00
APPLE INC	414,111	184.92	76,577,406.12
ARISTA NETWORKS INC	4,203	272.65	1,145,947.95
ARROW ELECTRONICS INC	6,738	77.58	522,734.04
AVNET INC	9,064	43.09	390,567.76
CDW CORP/DE	12,445	83.77	1,042,517.65
CISCO SYSTEMS INC	393,392	43.20	16,994,534.40
COGNEX CORP	15,151	45.11	683,461.61
COMMSCOPE HOLDING CO INC	16,514	29.31	484,025.34
CORNING INC	69,595	28.49	1,982,761.55
F5 NETWORKS INC	5,138	171.47	881,012.86
FLEX LTD	44,009	14.53	639,450.77
FLIR SYSTEMS INC	12,194	53.44	651,647.36
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	127,675	15.24	1,945,767.00
HP INC	133,917	23.80	3,187,224.60
IPG PHOTONICS CORP	3,125	234.25	732,031.25
JUNIPER NETWORKS INC	27,094	26.71	723,680.74
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	14,900	60.10	895,490.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,927	117.71	1,521,637.17
NETAPP INC	21,376	76.96	1,645,096.96
PALO ALTO NETWORKS INC	7,343	207.59	1,524,333.37
SEAGATE TECHNOLOGY	21,560	58.22	1,255,223.20
TE CONNECTIVITY LTD	29,141	95.13	2,772,183.33
TRIMBLE INC	20,682	33.34	689,537.88
WESTERN DIGITAL CORP	24,735	79.68	1,970,884.80
XEROX CORP	19,472	26.40	514,060.80
AT&T INC	592,632	31.69	18,780,508.08
CENTURYLINK INC	76,978	18.62	1,433,330.36
SPRINT CORP	72,295	5.50	397,622.50
T-MOBILE US INC	28,776	60.79	1,749,293.04
VERIZON COMMUNICATIONS INC	337,036	49.76	16,770,911.36
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,744	36.56	612,160.64
AES CORP	58,560	12.86	753,081.60

ALLIANT ENERGY CORP	18,407	41.09	756,343.63
AMEREN CORPORATION	19,696	58.68	1,155,761.28
AMERICAN ELECTRIC POWER	40,959	67.35	2,758,588.65
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,456	83.42	1,205,919.52
ATMOS ENERGY CORP	9,585	89.11	854,119.35
CENTERPOINT ENERGY INC	33,802	26.62	899,809.24
CMS ENERGY CORP	22,967	45.44	1,043,620.48
CONSOLIDATED EDISON INC	25,016	75.76	1,895,212.16
DOMINION ENERGY INC	53,696	66.94	3,594,410.24
DTE ENERGY COMPANY	14,516	100.45	1,458,132.20
DUKE ENERGY CORP	57,589	77.43	4,459,116.27
EDISON INTERNATIONAL	26,198	61.70	1,616,416.60
ENERGY CORP	14,638	80.21	1,174,113.98
EVERGY INC	21,669	54.44	1,179,660.36
EVERSOURCE ENERGY	25,627	56.03	1,435,880.81
EXELON CORP	79,543	41.50	3,301,034.50
FIRSTENERGY CORP	38,564	35.09	1,353,210.76
NEXTERA ENERGY INC	38,595	164.30	6,341,158.50
NISOURCE INC	28,570	25.06	715,964.20
OGE ENERGY CORP	18,121	34.96	633,510.16
P G & E CORP	41,236	42.92	1,769,849.12
PINNACLE WEST CAPITAL	9,432	78.29	738,431.28
PPL CORP	58,789	28.26	1,661,377.14
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	40,745	53.34	2,173,338.30
SCANA CORP	12,433	37.01	460,145.33
SEMPRA ENERGY	20,103	115.14	2,314,659.42
SOUTHERN CO/THE	83,095	45.81	3,806,581.95
UGI CORP	13,681	51.56	705,392.36
VISTRA ENERGY CORP	27,136	23.65	641,766.40
WEC ENERGY GROUP INC	25,504	62.29	1,588,644.16
XCEL ENERGY INC	40,992	43.85	1,797,499.20
ADVANCED MICRO DEVICES	73,576	15.80	1,162,500.80
ANALOG DEVICES INC	30,411	99.09	3,013,425.99
APPLIED MATERIALS INC	85,802	47.96	4,115,063.92
BROADCOM INC	33,511	259.71	8,703,141.81
INTEL CORP	381,965	52.50	20,053,162.50
KLA-TENCOR CORP	12,544	106.56	1,336,688.64
LAM RESEARCH CORP	13,398	174.70	2,340,630.60
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	36,072	21.31	768,694.32
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	22,550	60.39	1,361,794.50
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,717	96.92	1,814,051.64
MICRON TECHNOLOGY INC	94,381	57.10	5,389,155.10

	NVIDIA CORP	46,994	250.95	11,793,144.30
	NXP SEMICONDUCTORS NV	27,087	115.07	3,116,901.09
	ON SEMICONDUCTOR CORP	34,100	24.08	821,128.00
	QORVO INC	10,212	82.05	837,894.60
	QUALCOMM INC	120,850	58.50	7,069,725.00
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,696	98.55	1,448,290.80
	TEXAS INSTRUMENTS INC	80,322	112.38	9,026,586.36
	XILINX INC	21,388	66.73	1,427,221.24
	アメリカドル 小計	25,026,591		1,962,972,587.81 (215,318,463,156)
カナダドル	ALTAGAS LTD	15,500	26.51	410,905.00
	ARC RESOURCES LTD	24,400	13.28	324,032.00
	CAMECO CORP	35,000	15.06	527,100.00
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	100,000	44.17	4,417,000.00
	CENOVUS ENERGY INC	81,400	13.18	1,072,852.00
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	48,300	9.60	463,680.00
	ENBRIDGE INC	138,900	42.15	5,854,635.00
	ENCANA CORP	78,800	16.97	1,337,236.00
	HUSKY ENERGY INC	32,078	20.02	642,201.56
	IMPERIAL OIL LTD	23,100	43.23	998,613.00
	INTER PIPELINE LTD	30,000	25.08	752,400.00
	KEYERA CORP	17,300	36.98	639,754.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	40,432	46.05	1,861,893.60
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	15,188	25.93	393,824.84
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	22,800	14.04	320,112.00
	SUNCOR ENERGY INC	134,400	53.35	7,170,240.00
	TOURMALINE OIL CORP	20,500	23.48	481,340.00
	TRANSCANADA CORP	72,500	57.68	4,181,800.00
	VERMILION ENERGY INC	12,700	46.45	589,915.00
	AGNICO EAGLE MINES LTD	18,900	59.54	1,125,306.00
	BARRICK GOLD CORP	94,400	17.35	1,637,840.00
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	12,400	64.57	800,668.00
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,600	20.32	1,150,112.00
	FRANCO-NEVADA CORP	15,100	92.99	1,404,149.00
	GOLDCORP INC	70,400	18.22	1,282,688.00
	KINROSS GOLD CORP	90,100	4.97	447,797.00
	LUNDIN MINING CORP	48,400	8.10	392,040.00
	METHANEX CORP	5,200	92.59	481,468.00
	NUTRIEN LTD	53,359	71.22	3,800,227.98
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	40,800	34.59	1,411,272.00
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	99,000	3.76	372,240.00
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,900	85.69	419,881.00



WHEATON PRECIOUS METALS CORP	35,100	28.81	1,011,231.00
BOMBARDIER INC-B	175,600	5.25	921,900.00
CAE INC	23,500	27.02	634,970.00
FINNING INTERNATIONAL INC	15,000	32.99	494,850.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,400	60.14	805,876.00
WSP GLOBAL INC	8,100	71.78	581,418.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,600	107.03	6,486,018.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,600	249.11	2,889,676.00
LINAMAR CORP	4,400	60.10	264,440.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,500	83.36	2,292,400.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,000	37.70	640,900.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	18,310	80.65	1,476,701.50
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	37,200	27.78	1,033,416.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	5,200	173.94	904,488.00
DOLLARAMA INC	25,800	53.63	1,383,654.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	34,500	58.24	2,009,280.00
EMPIRE CO LTD 'A'	16,300	25.56	416,628.00
LOBLAW COMPANIES LTD	15,000	67.43	1,011,450.00
METRO INC	20,100	44.49	894,249.00
WESTON (GEORGE) LTD	4,700	106.07	498,529.00
SAPUTO INC	18,600	43.61	811,146.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	24,300	32.19	782,217.00
BANK OF MONTREAL	53,000	103.32	5,475,960.00
BANK OF NOVA SCOTIA	97,900	77.00	7,538,300.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	35,900	117.68	4,224,712.00
NATIONAL BANK OF CANADA	27,300	64.29	1,755,117.00
ROYAL BANK OF CANADA	117,800	101.37	11,941,386.00
TORONTO-DOMINION BANK	150,400	77.00	11,580,800.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	69,500	54.68	3,800,260.00
CI FINANCIAL CORP	23,900	24.60	587,940.00
IGM FINANCIAL INC	7,800	39.38	307,164.00
ONEX CORPORATION	7,500	96.32	722,400.00
THOMSON REUTERS CORP	23,200	54.08	1,254,656.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,400	751.50	1,803,600.00
GREAT-WEST LIFECO INC	23,800	32.97	784,686.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	9,800	51.46	504,308.00
INTACT FINANCIAL CORP	11,800	95.36	1,125,248.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	163,000	25.15	4,099,450.00
POWER CORP OF CANADA	27,800	29.95	832,610.00
POWER FINANCIAL CORP	19,200	31.49	604,608.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	49,000	54.32	2,661,680.00
FIRST CAPITAL REALTY INC	13,800	21.00	289,800.00

	BLACKBERRY LTD	38,900	14.16	550,824.00	
	CGI GROUP INC - CLASS A	20,400	83.70	1,707,480.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,600	1,049.95	1,679,920.00	
	OPEN TEXT CORP	21,500	47.54	1,022,110.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	7,100	216.17	1,534,807.00	
	BCE INC	11,500	54.37	625,255.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	29,100	62.63	1,822,533.00	
	TELUS CORP	11,600	46.77	542,532.00	
	ATCO LTD -CLASS I	7,600	40.20	305,520.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	12,300	32.60	400,980.00	
	EMERA INC	5,400	42.73	230,742.00	
	FORTIS INC	34,200	42.16	1,441,872.00	
	HYDRO ONE LTD	28,400	20.07	569,988.00	
	カナダドル 小計	3,329,067		149,739,908.48 (12,352,045,050)	
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,414	32.25	658,351.50	
	OIL SEARCH LTD	109,837	8.35	917,138.95	
	ORIGIN ENERGY LTD	141,815	9.72	1,378,441.80	
	SANTOS LTD	146,946	5.94	872,859.24	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	75,098	34.37	2,581,118.26	
	ALUMINA LTD	218,403	2.76	602,792.28	
	AMCOR LIMITED	94,730	14.33	1,357,480.90	
	BHP BILLITON LIMITED	261,885	32.52	8,516,500.20	
	BLUESCOPE STEEL LTD	43,294	17.95	777,127.30	
	BORAL LTD	92,091	6.57	605,037.87	
	FORTECUE METALS GROUP LTD	139,396	4.59	639,827.64	
	INCITEC PIVOT LTD	124,461	3.51	436,858.11	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	36,366	22.24	808,779.84	
	NEWCREST MINING LTD	62,435	21.47	1,340,479.45	
	ORICA LTD	34,500	17.93	618,585.00	
	RIO TINTO LTD	34,659	82.46	2,857,981.14	
	SOUTH32 LTD	416,876	3.63	1,513,259.88	
	CIMIC GROUP LTD	9,171	41.91	384,356.61	
	BRAMBLES LTD	129,655	9.04	1,172,081.20	
	SEEK LTD	30,226	22.39	676,760.14	
	AURIZON HOLDINGS LTD	159,542	4.43	706,771.06	
	SYDNEY AIRPORT	85,110	7.55	642,580.50	
	TRANSURBAN GROUP	179,383	12.21	2,190,266.43	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	48,137	30.88	1,486,470.56		
CROWN RESORTS LTD	35,743	13.60	486,104.80		
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,835	53.43	311,764.05		
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	5,195	62.37	324,012.15		

TABCORP HOLDINGS LTD	147,277	4.54	668,637.58
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	52,191	3.45	180,058.95
WESFARMERS LTD	93,490	49.20	4,599,708.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	104,777	29.96	3,139,118.92
COCA-COLA AMATIL LTD	39,381	9.01	354,822.81
TREASURY WINE ESTATES LTD	59,641	18.42	1,098,587.22
COCHLEAR LTD	4,694	201.94	947,906.36
HEALTHSCOPE LTD	160,669	2.18	350,258.42
RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,572	56.11	649,304.92
SONIC HEALTHCARE LTD	31,877	25.24	804,575.48
CSL LTD	37,078	198.47	7,358,870.66
AUST AND NZ BANKING GROUP	239,997	28.65	6,875,914.05
BANK OF QUEENSLAND LTD	38,258	10.51	402,091.58
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	43,844	10.77	472,199.88
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	143,222	73.86	10,578,376.92
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	224,246	27.64	6,198,159.44
WESTPAC BANKING CORP	278,224	29.38	8,174,221.12
AMP LTD	244,675	3.63	888,170.25
ASX LTD	16,061	64.29	1,032,561.69
CHALLENGER LTD	43,290	12.36	535,064.40
MACQUARIE GROUP LTD	27,054	122.03	3,301,399.62
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	191,707	8.57	1,642,928.99
MEDIBANK PRIVATE LTD	213,510	2.91	621,314.10
QBE INSURANCE GROUP LTD	112,351	9.64	1,083,063.64
SUNCORP GROUP LTD	105,352	14.74	1,552,888.48
LENDLEASE GROUP	48,751	19.89	969,657.39
COMPUTERSHARE LTD	35,943	18.68	671,415.24
REA GROUP LTD	5,063	93.20	471,871.60
TELSTRA CORP LTD	343,336	2.68	920,140.48
TPG TELECOM LTD	34,153	5.27	179,986.31
AGL ENERGY LTD	53,914	21.90	1,180,716.60
AUSNET SERVICES	186,905	1.58	296,244.42
オーストラリアドル 小計	6,113,706		103,064,022.38 (8,387,350,141)
イギリスポンド			
BP PLC	1,625,647	5.76	9,373,480.60
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	374,959	26.09	9,782,680.31
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	305,694	27.07	8,276,665.05
WOOD GROUP (JOHN) PLC	52,585	6.51	342,433.52
ANGLO AMERICAN PLC	87,902	16.97	1,491,696.94
ANTOFAGASTA PLC	34,937	10.28	359,327.04
BHP BILLITON PLC	173,515	16.66	2,891,106.93
CRODA INTERNATIONAL PLC	10,768	48.12	518,156.16

FRESNILLO PLC	20,771	11.73	243,643.83
GLENCORE PLC	940,660	3.87	3,641,765.19
JOHNSON MATTHEY PLC	15,583	36.90	575,012.70
MONDI PLC	29,973	20.15	603,955.95
RANDGOLD RESOURCES LTD	8,375	57.22	479,217.50
RIO TINTO PLC	97,818	41.82	4,090,748.76
ASHTED GROUP PLC	40,058	22.52	902,106.16
BAE SYSTEMS PLC	255,396	6.25	1,596,225.00
BUNZL PLC	26,298	22.96	603,802.08
DCC PLC	7,122	68.75	489,637.50
FERGUSON PLC	19,006	60.77	1,154,994.62
MEGGITT PLC	70,206	4.91	345,202.90
MELROSE INDUSTRIES PLC	405,550	2.21	899,915.45
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	132,792	9.40	1,248,510.38
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	8,618,406	0.00	8,618.40
SMITHS GROUP PLC	32,841	17.28	567,492.48
TRAVIS PERKINS PLC	22,803	14.19	323,574.57
WEIR GROUP PLC/THE	19,831	20.08	398,206.48
BABCOCK INTL GROUP PLC	22,771	8.40	191,276.40
EXPERIAN PLC	74,329	18.55	1,378,802.95
G4S PLC	115,955	2.71	315,049.73
INTERTEK GROUP PLC	13,214	56.82	750,819.48
RELX PLC	85,681	16.33	1,399,170.73
EASYJET PLC	11,810	17.90	211,458.05
ROYAL MAIL PLC	68,682	5.03	346,019.91
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	78,163	5.27	412,544.31
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	9,986	38.19	381,365.34
BURBERRY GROUP PLC	34,696	21.62	750,127.52
PERSIMMON PLC	25,010	25.76	644,257.60
TAYLOR WIMPEY PLC	265,537	1.81	480,887.50
CARNIVAL PLC	14,984	47.43	710,691.12
COMPASS GROUP PLC	131,130	16.22	2,126,928.60
GVC HOLDINGS PLC	41,340	10.35	427,869.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	14,659	48.29	707,883.11
MERLIN ENTERTAINMENT	65,182	3.84	250,820.33
TUI AG-DI	35,880	17.32	621,441.60
WHITBREAD PLC	14,854	40.59	602,923.86
INFORMA PLC	102,060	8.25	841,995.00
ITV PLC	281,780	1.76	497,623.48
PEARSON PLC	66,485	8.66	575,760.10
SKY PLC	82,524	14.15	1,167,714.60
WPP PLC	106,305	12.20	1,297,452.52

KINGFISHER PLC	182,583	3.02	552,678.74
MARKS & SPENCER GROUP PLC	144,803	2.97	430,209.71
NEXT PLC	12,078	60.10	725,887.80
SAINSBURY (J) PLC	142,153	3.17	451,335.77
TESCO PLC	806,848	2.61	2,111,521.21
WM MORRISON SUPERMARKETS	169,778	2.49	423,596.11
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,611	28.35	811,121.85
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	187,112	39.11	7,317,950.32
COCA-COLA HBC AG-DI	16,433	25.35	416,576.55
DIAGEO PLC	200,483	27.47	5,507,268.01
IMPERIAL BRANDS PLC	78,900	27.28	2,152,392.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	54,667	63.17	3,453,314.39
UNILEVER PLC	100,294	41.33	4,145,652.49
CONVATEC GROUP PLC	123,670	2.26	279,741.54
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	33,942	5.42	184,101.40
NMC HEALTH PLC	8,300	35.62	295,646.00
SMITH & NEPHEW PLC	70,206	13.95	979,724.73
ASTRAZENECA PLC	103,357	52.29	5,404,537.53
GLAXOSMITHKLINE PLC	404,784	15.46	6,257,960.64
SHIRE PLC	74,498	40.66	3,029,088.68
BARCLAYS PLC	1,398,100	1.94	2,712,593.62
HSBC HOLDINGS PLC	1,631,785	7.20	11,763,538.06
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,882,066	0.62	3,653,939.39
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	384,567	2.61	1,005,642.70
STANDARD CHARTERED PLC	224,398	7.11	1,595,694.17
3I GROUP PLC	78,219	9.32	729,313.95
HARGREAVES LANSDOWN PLC	22,987	19.98	459,280.26
INVESTEC PLC	61,199	5.48	335,492.91
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	25,064	44.61	1,118,105.04
SCHRODERS PLC	9,276	31.57	292,843.32
ST JAMES'S PLACE PLC	42,286	11.82	500,031.95
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	214,587	3.44	738,179.28
ADMIRAL GROUP PLC	18,346	19.12	350,775.52
AVIVA PLC	322,078	5.14	1,658,057.54
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	106,707	3.48	371,660.48
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	478,982	2.69	1,290,856.49
PRUDENTIAL PLC	211,154	18.14	3,830,333.56
RSA INSURANCE GROUP PLC	84,058	6.81	573,107.44
AUTO TRADER GROUP PLC	69,598	4.27	297,183.46
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	38,171	13.64	520,652.44
SAGE GROUP PLC/THE	89,391	6.32	564,951.12
BT GROUP PLC	675,366	2.18	1,477,363.12

	VODAFONE GROUP PLC	2,176,207	1.87	4,075,600.46
	CENTRICA PLC	451,590	1.58	713,512.20
	NATIONAL GRID PLC	272,786	8.34	2,275,035.24
	SEVERN TRENT PLC	19,125	19.30	369,112.50
	SSE PLC	82,498	13.51	1,114,547.98
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	61,347	7.50	460,470.58
	イギリスポンド 小計	33,267,951		158,077,239.59 (22,978,107,546)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	15,467	23.93	370,125.31
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	739	637.00	470,743.00
	GIVAUDAN-REG	743	2,218.00	1,647,974.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	40,329	49.65	2,002,334.85
	SIKA AG-REG	10,380	135.10	1,402,338.00
	ABB LTD-REG	151,255	22.20	3,357,861.00
	GEBERIT AG-REG	2,970	431.90	1,282,743.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,452	209.40	304,048.80
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,466	214.00	741,724.00
	ADECCO GROUP AG-REG	13,354	60.12	802,842.48
	SGS SA-REG	447	2,594.00	1,159,518.00
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4,374	149.15	652,382.10
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	42,801	87.24	3,733,959.24
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	2,563	475.50	1,218,706.50
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	4,905	86.85	425,999.25
	DUFREY AG-REG	2,518	136.30	343,203.40
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	1,800.00	288,000.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	88	6,360.00	559,680.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	75,800.00	606,400.00
	NESTLE SA-REG	253,822	75.20	19,087,414.40
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,547	174.75	794,588.25
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	881	746.50	657,666.50
	LONZA GROUP AG-REG	5,964	272.60	1,625,786.40
	NOVARTIS AG-REG	181,585	74.64	13,553,504.40
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	57,352	219.85	12,608,837.20
	VIFOR PHARMA AG	3,847	161.00	619,367.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	209,610	15.38	3,223,801.80
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,946	59.04	1,059,531.84
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,629	85.45	310,098.05
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,409	727.00	1,024,343.00
	UBS GROUP AG-REG	314,887	15.47	4,872,876.32
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,919	145.60	570,606.40
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,918	346.20	1,010,211.60
	SWISS RE AG	25,174	86.72	2,183,089.28

	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,411	297.40	3,691,031.40
	SWISS PRIME SITE-REG	5,600	91.30	511,280.00
	TEMENOS AG - REG	4,750	148.90	707,275.00
	SWISSCOM AG-REG	2,115	447.70	946,885.50
	スイスフラン 小計	1,410,385		90,428,777.27 (10,037,594,276)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	216,368	84.80	18,348,006.40
	NWS HOLDINGS LTD	146,500	14.12	2,068,580.00
	MTR CORP	118,000	43.45	5,127,100.00
	MINH GROUP LTD	54,000	34.00	1,836,000.00
	LI & FUNG LTD	542,000	3.00	1,626,000.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	110,500	44.05	4,867,525.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	48,000	22.45	1,077,600.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	189,000	63.70	12,039,300.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	88,400	20.60	1,821,040.00
	SANDS CHINA LTD	194,800	43.95	8,561,460.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD	122,000	15.46	1,886,120.00
	SJM HOLDINGS LTD	175,000	10.32	1,806,000.00
	WYNN MACAU LTD	117,600	26.65	3,134,040.00
	WH GROUP LTD	694,500	6.43	4,465,635.00
	BANK OF EAST ASIA LTD	112,820	31.95	3,604,599.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	296,500	38.40	11,385,600.00
	HANG SENG BANK LTD	61,300	194.70	11,935,110.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	97,100	242.20	23,517,620.00
	AIA GROUP LTD	988,600	68.60	67,817,960.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	217,368	64.45	14,009,367.60
	HANG LUNG GROUP LTD	85,000	22.85	1,942,250.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	188,000	16.62	3,124,560.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	102,947	42.70	4,395,836.90
	HYSAN DEVELOPMENT CO	57,000	45.15	2,573,550.00
	KERRY PROPERTIES LTD	60,500	42.45	2,568,225.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	494,000	11.30	5,582,200.00
	SINO LAND CO	281,400	13.08	3,680,712.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	133,000	121.90	16,212,700.00
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	45,500	85.40	3,885,700.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	106,200	30.15	3,201,930.00
	WHARF HOLDINGS LTD	92,000	26.10	2,401,200.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	102,000	59.50	6,069,000.00
	WHEELLOCK & CO LTD	62,000	56.65	3,512,300.00
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	276,000	9.96	2,748,960.00
	PCCW LTD	406,000	4.49	1,822,940.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,500	57.45	2,901,225.00

	CLP HOLDINGS LTD	133,500	80.20	10,706,700.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	751,484	14.94	11,227,170.96	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	115,500	54.60	6,306,300.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	24,400	100.50	2,452,200.00	
	香港ドル 小計	8,157,287		298,250,322.86 (4,169,539,513)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	121,800	7.05	858,690.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	92,600	2.76	255,576.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	110,300	3.35	369,505.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	208,500	0.95	199,117.50	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	200,900	2.23	448,007.00	
	SATS LTD	65,000	4.95	321,750.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	43,940	11.02	484,218.80	
	GENTING SINGAPORE LTD	443,500	1.23	545,505.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	149,350	2.67	398,764.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,300	32.55	205,065.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	639,560	0.33	211,054.80	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	146,900	3.14	461,266.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	147,000	26.89	3,952,830.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	259,300	11.75	3,046,775.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	110,300	26.31	2,901,993.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	61,500	7.17	440,955.00	
	CAPITALAND LTD	201,200	3.22	647,864.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,800	11.12	420,336.00	
	UOL GROUP LTD	44,300	7.56	334,908.00	
	VENTURE CORP LTD	22,000	18.06	397,320.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	646,860	3.12	2,018,203.20		
	シンガポールドル 小計	3,758,910		18,919,703.80 (1,525,117,323)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	62,944	6.82	429,278.08	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	86,349	6.90	595,808.10	
	A2 MILK CO LTD	57,800	11.95	690,710.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,896	15.15	695,324.40	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,094	12.00	433,128.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	164,869	3.66	603,420.54	
	MERIDIAN ENERGY LTD	85,115	3.16	268,963.40	
	ニュージーランドドル 小計	539,067		3,716,632.52 (281,757,911)	
スウェーデンクローネ	LUNDIN PETROLEUM AB	16,375	273.50	4,478,562.50	
	BOLIDEN AB	22,237	294.30	6,544,349.10	
	ALFA LAVAL AB	22,627	214.90	4,862,542.30	
	ASSA ABLOY AB-B	80,230	186.85	14,990,975.50	



	ATLAS COPCO AB-A SHS	55,832	264.50	14,767,564.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	31,407	240.00	7,537,680.00	
	EPIROC AB-A	55,832	88.06	4,916,565.92	
	EPIROC AB-B	31,407	80.00	2,512,560.00	
	SANDVIK AB	90,349	152.80	13,805,327.20	
	SKANSKA AB-B SHS	29,955	157.85	4,728,396.75	
	SKF AB-B SHARES	29,760	165.30	4,919,328.00	
	VOLVO AB-B SHS	130,197	142.00	18,487,974.00	
	SECURITAS AB-B SHS	28,546	144.10	4,113,478.60	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,714	208.00	3,892,512.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,162	84.74	3,233,847.88	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	69,907	138.24	9,663,943.68	
	ICA GRUPPEN AB	7,273	274.50	1,996,438.50	
	SWEDISH MATCH AB	14,539	429.80	6,248,862.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	48,445	217.50	10,536,787.50	
	NORDEA BANK AB	252,467	84.92	21,439,497.64	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	132,126	81.80	10,807,906.80	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	122,507	97.00	11,883,179.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	72,698	188.20	13,681,763.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	15,069	173.90	2,620,499.10	
	INVESTOR AB-B SHS	36,349	358.50	13,031,116.50	
	KINNEVIK AB - B	18,534	307.60	5,701,058.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	6,638	276.20	1,833,415.60	
	ERICSSON LM-B SHS	245,725	68.60	16,856,735.00	
	HEXAGON AB-B SHS	20,841	504.00	10,503,864.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,076	529.50	3,217,242.00	
	TELE2 AB-B SHS	32,831	111.90	3,673,788.90	
	TELIA CO AB	227,083	41.49	9,421,673.67	
	スウェーデンクローネ 小計	2,010,738		266,909,435.84 (3,307,007,910)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	8,800	305.80	2,691,040.00	
	EQUINOR ASA	96,587	214.30	20,698,594.10	
	NORSK HYDRO ASA	104,705	51.16	5,356,707.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,916	335.00	4,661,860.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	8,069	240.00	1,936,560.00	
	MARINE HARVEST	33,438	164.75	5,508,910.50	
	ORKLA ASA	66,555	73.12	4,866,501.60	
	DNB ASA	78,514	157.50	12,365,955.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	19,393	128.60	2,493,939.80	
	TELENOR ASA	60,281	168.00	10,127,208.00	
	ノルウェークローネ 小計	490,258		70,707,276.80 (956,669,455)	

デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,970	631.20	5,030,664.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	18,524	324.50	6,011,038.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	17,270	410.80	7,094,516.00	
	ISS A/S	12,749	224.50	2,862,150.50	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	288	8,440.00	2,430,720.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	535	8,910.00	4,766,850.00	
	DSV A/S	15,228	523.60	7,973,380.80	
	PANDORA A/S	8,665	487.70	4,225,920.50	
	CARLSBERG AS-B	8,702	750.60	6,531,721.20	
	COLOPLAST-B	9,613	640.40	6,156,165.20	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	8,279	256.40	2,122,735.60	
	GENMAB A/S	5,318	994.80	5,290,346.40	
	H LUNDBECK A/S	6,299	474.10	2,986,355.90	
	NOVO NORDISK A/S-B	144,265	301.00	43,423,765.00	
	DANSKE BANK A/S	62,471	206.70	12,912,755.70	
	TRYG A/S	8,747	152.30	1,332,168.10	
ORSTED A/S	15,366	380.90	5,852,909.40		
デンマーククローネ 小計		350,289		127,004,162.30	(2,178,121,383)
イスラエルシェケル	FRUTAROM	3,557	353.50	1,257,399.50	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	48,301	17.29	835,124.29	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,224	443.40	986,121.60	
	BANK HAPOALIM BM	84,651	24.97	2,113,735.47	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	119,218	21.85	2,604,913.30	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,539	69.05	865,817.95	
	AZRIELI GROUP LTD	3,746	184.30	690,387.80	
	NICE LTD	4,623	389.00	1,798,347.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	186,511	4.02	750,706.77	
イスラエルシェケル 小計		465,370		11,902,553.68	(362,075,682)
ユーロ	ENAGAS SA	17,298	24.78	428,644.44	
	ENI SPA	209,160	15.63	3,270,425.76	
	GALP ENERGIA SGPS SA	41,211	16.09	663,084.99	
	NESTE OYJ	10,473	65.52	686,190.96	
	OMV AG	12,060	49.23	593,713.80	
	REPSOL SA	106,294	16.70	1,775,109.80	
	REPSOL SA-RTS	106,294	0.47	50,808.53	
	SNAM SPA	186,489	3.47	648,795.23	
	TENARIS SA	38,020	15.68	596,343.70	
	TOTAL SA	196,765	52.48	10,326,227.20	
	VOPAK	6,646	39.96	265,574.16	
	AIR LIQUIDE SA	35,037	108.85	3,813,777.45	

AKZO NOBEL	20,171	74.78	1,508,387.38
ARCELORMITTAL	53,345	27.36	1,459,519.20
ARKEMA	5,560	101.95	566,842.00
BASF SE	74,958	83.55	6,262,740.90
COVESTRO AG	15,400	73.92	1,138,368.00
CRH PLC	67,673	31.10	2,104,630.30
EVONIK INDUSTRIES AG	12,299	29.68	365,034.32
FUCHS PETROLUB SE -PREF	6,365	43.12	274,458.80
HEIDELBERGCEMENT AG	11,930	73.22	873,514.60
IMERYS SA	3,250	66.40	215,800.00
K+S AG-REG	17,582	21.63	380,298.66
KONINKLIJKE DSM NV	14,519	86.54	1,256,474.26
LANXESS AG	7,138	68.66	490,095.08
LINDE AG - TENDER	15,270	205.30	3,134,931.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	18,000	34.98	629,640.00
SOLVAY SA	5,786	110.80	641,088.80
STORA ENSO OYJ-R SHS	45,052	16.85	759,351.46
SYMRISE AG	10,180	75.36	767,164.80
THYSSENKRUPP AG	35,229	21.48	756,718.92
UMICORE	17,081	49.34	842,776.54
UPM-KYMMENE OYJ	42,624	30.31	1,291,933.44
VOESTALPINE AG	8,922	42.33	377,668.26
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21,674	35.37	766,609.38
ACS ACTIVIDADES CONS Y-RTS	21,674	0.90	19,593.29
AIRBUS SE	47,392	100.64	4,769,530.88
ALSTOM	13,649	39.45	538,453.05
ANDRITZ AG	6,994	42.82	299,483.08
BOUYGUES SA	17,663	38.10	672,960.30
BRENTAG AG	13,002	48.83	634,887.66
CNH INDUSTRIAL NV	82,488	9.24	762,354.09
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	39,904	39.26	1,566,631.04
DASSAULT AVIATION SA	227	1,638.00	371,826.00
EIFFAGE	6,860	93.90	644,154.00
FERROVIAL SA	39,220	17.96	704,391.20
GEA GROUP AG	14,558	30.32	441,398.56
HOCHTIEF AG	1,803	153.10	276,039.30
KION GROUP AG	5,364	66.00	354,024.00
KONE OYJ-B	26,919	44.46	1,196,818.74
LEGRAND SA	21,313	63.32	1,349,539.16
LEONARDO SPA	33,278	8.74	291,115.94
MAN SE	2,503	92.85	232,403.55
METSO OYJ	7,690	28.78	221,318.20

MTU AERO ENGINES AG	4,434	162.80	721,855.20
OSRAM LICHT AG	8,336	46.54	387,957.44
PRYSMIAN SPA	15,800	23.20	366,560.00
REXEL SA	22,104	12.74	281,604.96
SAFRAN SA	27,444	99.70	2,736,166.80
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,042	71.74	3,159,573.08
SIEMENS AG-REG	62,442	116.30	7,262,004.60
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	21,635	12.33	266,867.72
THALES SA	8,481	108.40	919,340.40
VINCI SA	41,484	83.22	3,452,298.48
WARTSILA OYJ ABP	36,809	16.52	608,268.72
BUREAU VERITAS SA	20,920	23.26	486,599.20
EDENRED	20,587	26.91	553,996.17
RANDSTAD NV	9,747	53.24	518,930.28
RELX NV	77,270	18.50	1,429,881.35
SOCIETE BIC SA	1,768	79.80	141,086.40
TELEPERFORMANCE	4,994	150.80	753,095.20
WOLTERS KLUWER	23,206	48.69	1,129,900.14
ADP	2,325	191.60	445,470.00
AENA SME SA	5,420	156.75	849,585.00
ATLANTIA SPA	39,670	25.01	992,146.70
BOLLORE	63,360	4.10	260,029.44
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	19,485	22.73	442,894.05
DEUTSCHE POST AG-REG	80,403	29.23	2,350,179.69
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	3,949	83.12	328,240.88
GETLINK	36,809	12.01	442,076.09
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	48,325	8.28	400,517.60
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,597	80.31	2,216,315.07
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	4,090	69.20	283,028.00
CONTINENTAL AG	8,806	209.50	1,844,857.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	74,384	57.66	4,288,981.44
FAURECIA	6,208	66.50	412,832.00
FERRARI NV	9,857	120.15	1,184,318.55
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	86,034	16.49	1,419,388.93
MICHELIN (CGDE)	13,703	108.35	1,484,720.05
NOKIAN RENKAAT OYJ	8,460	34.95	295,677.00
PEUGEOT SA	47,169	20.45	964,606.05
PIRELLI & C SPA	32,400	7.35	238,334.40
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	12,200	58.30	711,260.00
RENAULT SA	15,354	76.72	1,177,958.88
SCHAEFFLER AG	16,373	12.05	197,294.65
VALEO SA	19,186	50.70	972,730.20

VOLKSWAGEN AG	2,744	148.20	406,660.80
VOLKSWAGEN AG-PREF	15,225	149.38	2,274,310.50
ADIDAS AG	15,481	190.95	2,956,096.95
HERMES INTERNATIONAL	2,551	529.00	1,349,479.00
HUGO BOSS AG -ORD	5,627	77.56	436,430.12
KERING	6,228	486.00	3,026,808.00
LUXOTTICA GROUP SPA	13,938	55.02	766,868.76
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	22,764	287.40	6,542,373.60
MONCLER SPA	14,300	39.57	565,851.00
PUMA SE	506	490.00	247,940.00
SEB SA	1,630	147.20	239,936.00
ACCOR SA	15,414	42.99	662,647.86
PADDY POWER BETFAIR PLC	6,890	95.65	659,028.50
SODEXO SA	7,574	87.22	660,604.28
AXEL SPRINGER SE	4,568	61.35	280,246.80
EUTELSAT COMMUNICATIONS	15,822	17.62	278,862.75
JCDECAUX SA	6,778	29.02	196,697.56
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	18,565	23.60	438,134.00
PUBLICIS GROUPE	16,592	60.64	1,006,138.88
RTL GROUP	2,552	64.05	163,455.60
SES	31,749	16.06	509,888.94
TELENET GROUP HOLDING NV	3,539	40.24	142,409.36
VIVENDI	86,191	21.55	1,857,416.05
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	89,892	29.81	2,679,680.52
ZALANDO SE	8,519	47.29	402,863.51
CARREFOUR SA	47,464	14.64	695,110.28
CASINO GUICHARD PERRACHON	5,233	33.70	176,352.10
COLRUYT SA	5,320	48.13	256,051.60
JERONIMO MARTINS	18,324	13.18	241,510.32
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	102,422	20.44	2,094,017.79
METRO AG	11,840	11.00	130,240.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	62,245	85.21	5,303,896.45
DANONE	49,488	64.75	3,204,348.00
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,690	6.92	295,628.25
HEINEKEN HOLDING NV	9,454	82.90	783,736.60
HEINEKEN NV	21,575	86.58	1,867,963.50
KERRY GROUP PLC-A	12,870	88.75	1,142,212.50
PERNOD RICARD SA	17,547	141.20	2,477,636.40
REMY COINTREAU	2,083	116.40	242,461.20
BEIERSDORF AG	8,254	93.42	771,088.68
HENKEL AG & CO KGAA	8,605	95.65	823,068.25
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	14,758	108.00	1,593,864.00

L'OREAL	20,507	209.60	4,298,267.20
UNILEVER NV-CVA	125,833	47.57	5,986,504.97
BIOMERIEUX	2,930	77.10	225,903.00
ESSILOR INTERNATIONAL	17,263	120.30	2,076,738.90
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	17,226	87.78	1,512,098.28
FRESENIUS SE & CO KGAA	34,435	69.86	2,405,629.10
KONINKLIJKE PHILIPS NV	77,274	36.19	2,796,932.43
SARTORIUS AG-VORZUG	2,850	122.00	347,700.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,781	36.94	472,130.14
BAYER AG-REG	73,353	98.84	7,250,210.52
EUROFINS SCIENTIFIC	1,011	425.80	430,483.80
GRIFOLS SA	24,100	26.86	647,326.00
IPSEN	3,382	132.05	446,593.10
MERCK KGAA	10,470	83.28	871,941.60
ORION OYJ-CLASS B	9,876	23.44	231,493.44
QIAGEN N.V.	18,980	31.55	598,819.00
RECORDATI SPA	9,703	34.24	332,230.72
SANOFI	92,159	69.01	6,359,892.59
UCB SA	10,500	67.34	707,070.00
ABN AMRO GROUP NV-CVA	34,089	22.64	771,774.96
AIB GROUP PLC	66,715	4.88	325,569.20
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	545,049	6.06	3,302,996.94
BANCO DE SABADELL SA	439,147	1.41	622,490.87
BANCO SANTANDER SA	1,317,687	4.73	6,237,930.25
BANK OF IRELAND GROUP PLC	76,133	6.95	529,124.35
BANKIA SA	91,183	3.35	305,463.05
BANKINTER SA	51,594	8.57	442,263.76
BNP PARIBAS	91,695	53.92	4,944,194.40
CAIXABANK S.A	285,877	3.67	1,049,740.34
COMMERZBANK AG	86,076	8.58	739,306.76
CREDIT AGRICOLE SA	91,074	11.76	1,071,030.24
ERSTE GROUP BANK AG	24,401	35.16	857,939.16
ING GROEP NV	318,034	12.65	4,025,038.30
INTESA SANPAOLO	1,099,125	2.58	2,844,535.50
INTESA SANPAOLO-RSP	84,372	2.69	227,635.65
IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD	47,248		
KBC GROUP NV	20,080	66.28	1,330,902.40
MEDIOBANCA SPA	52,486	8.43	442,666.92
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	11,130	27.37	304,628.10
SOCIETE GENERALE SA	63,372	36.22	2,295,333.84
UNICREDIT SPA	165,610	14.53	2,407,638.18
AMUNDI SA	4,654	60.36	280,915.44

DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	157,121	9.49	1,491,706.77
DEUTSCHE BOERSE AG	15,451	114.35	1,766,821.85
EURAZEO SA	3,256	65.65	213,756.40
EXOR NV	8,647	58.74	507,924.78
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,713	91.02	611,017.26
NATIXIS	73,936	6.10	451,601.08
WENDEL	2,038	120.90	246,394.20
AEGON NV	143,554	5.30	761,123.30
AGEAS	15,519	44.07	683,922.33
ALLIANZ SE-REG	35,976	175.72	6,321,702.72
ASSICURAZIONI GENERALI	93,927	14.54	1,365,698.58
AXA SA	158,729	21.42	3,399,975.18
CNP ASSURANCES	12,635	19.49	246,256.15
HANNOVER RUECK SE	4,864	108.70	528,716.80
MAPFRE SA	96,950	2.60	252,166.95
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	12,410	179.80	2,231,318.00
NN GROUP NV	24,458	36.03	881,221.74
POSTE ITALIANE SPA	47,684	7.34	350,286.66
SAMPO OYJ-A SHS	35,711	41.21	1,471,650.31
SCOR SE	13,243	32.03	424,173.29
DEUTSCHE WOHNEN SE	28,486	41.50	1,182,169.00
VONOVIA SE	38,934	41.20	1,604,080.80
AMADEUS IT GROUP SA	36,203	69.50	2,516,108.50
ATOS SE	7,658	122.25	936,190.50
CAPGEMINI SE	12,860	113.40	1,458,324.00
DASSAULT SYSTEMES SA	10,405	121.45	1,263,687.25
DELIVERY HERO AG	7,441	44.40	330,380.40
SAP SE	80,203	100.90	8,092,482.70
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,799	96.48	655,967.52
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,983	56.26	561,643.58
WIRECARD AG	9,404	147.20	1,384,268.80
INGENICO GROUP	4,342	73.88	320,786.96
NOKIA OYJ	464,666	5.07	2,355,856.62
1&1 DRILLISCH AG	3,933	59.10	232,440.30
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	273,383	13.54	3,701,605.82
ELISA OYJ	11,017	39.23	432,196.91
ILIAD SA	1,939	137.15	265,933.85
KONINKLIJKE KPN NV	277,545	2.42	672,769.08
ORANGE	165,100	14.49	2,393,124.50
PROXIMUS	14,134	20.93	295,824.62
TELECOM ITALIA SPA	944,380	0.66	631,223.59
TELECOM ITALIA-RSP	441,476	0.57	255,702.89

TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	67,973	3.48	236,953.87	
TELEFONICA SA	383,328	7.45	2,858,093.56	
E.ON SE	176,795	9.09	1,608,127.32	
EDF	51,470	11.86	610,434.20	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	209,615	3.39	711,642.92	
ENDESA SA	28,416	19.42	551,980.80	
ENEL SPA	671,259	4.74	3,185,795.21	
ENGIE	152,449	13.23	2,017,662.51	
FORTUM OYJ	36,767	19.66	722,839.22	
GAS NATURAL SDG SA	27,717	21.63	599,518.71	
IBERDROLA SA	478,008	6.52	3,119,480.20	
INNOGY SE	10,899	36.72	400,211.28	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	36,322	17.91	650,708.63	
RWE AG	41,875	19.31	808,606.25	
SUEZ	34,252	11.48	393,384.22	
TERNA SPA	115,585	4.46	516,087.02	
UNIPER SE	16,234	25.39	412,181.26	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,579	18.45	804,250.44	
ASML HOLDING NV	33,461	177.35	5,934,308.35	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	94,299	23.11	2,179,249.89	
STMICROELECTRONICS NV	54,731	20.16	1,103,376.96	
ユーロ 小計	16,096,748		324,091,285.99 (41,425,348,175)	
合 計	101,016,367		323,279,197,521 (323,279,197,521)	

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

## (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
アメリカ ドル	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	36,405	688,054.50	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,369	1,063,532.52	
		AMERICAN TOWER CORP	35,997	5,141,091.54	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	93,335	991,217.70	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,028	1,883,913.24	
		BOSTON PROPERTIES INC	12,344	1,550,406.40	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,315	674,369.85	
		CROWN CASTLE INTL CORP	33,373	3,457,442.80	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	17,273	1,863,583.97	
		DUKE REALTY CORP	29,082	836,398.32	



		EQUINIX INC	6,484	2,715,888.24
		EQUITY RESIDENTIAL	30,790	1,943,464.80
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,282	1,243,277.16
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,192	1,011,759.84
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,953	747,756.33
		GGP INC	53,464	1,104,031.60
		HCP INC	37,512	931,047.84
		HOST HOTELS & RESORTS INC	59,094	1,265,793.48
		INVITATION HOMES INC	25,988	587,328.80
		IRON MOUNTAIN INC	22,236	778,260.00
		KIMCO REALTY CORP	33,117	592,794.30
		LIBERTY PROPERTY TRUST	13,061	578,732.91
		MACERICH CO/THE	9,483	547,643.25
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,988	895,025.04
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	13,357	584,101.61
		PROLOGIS INC	43,902	2,823,337.62
		PUBLIC STORAGE	12,944	2,924,826.24
		REALTY INCOME CORP	22,514	1,210,802.92
		REGENCY CENTERS CORP	12,092	757,926.56
		SIMON PROPERTY GROUP INC	26,192	4,527,287.20
		SL GREEN REALTY CORP	7,165	727,892.35
		UDR INC	20,971	780,750.33
		VENTAS INC	28,452	1,584,491.88
		VEREIT INC	83,965	633,096.10
		VORNADO REALTY TRUST	13,856	1,020,494.40
		WELLTOWER INC	29,583	1,746,876.15
		WEYERHAEUSER CO	62,736	2,233,401.60
アメリカドル合計			983,894	54,648,099.39 (5,994,350,022)
カナダドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	12,200	248,392.00
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	13,700	333,458.00
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,700	173,793.00
カナダドル合計			31,600	755,643.00 (62,332,991)
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS	80,527	802,854.19
		GOODMAN GROUP	128,379	1,264,533.15
		GPT GROUP	160,354	833,840.80
		MIRVAC GROUP	334,934	753,601.50
		SCENTRE GROUP	427,988	1,870,307.56
		STOCKLAND	199,371	835,364.49
		VICINITY CENTRES	258,227	702,377.44
			1,589,780	7,062,879.13

オーストラリアドル合計				(574,777,103)
イギリス ポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	79,407	546,002.53
		HAMMERSON PLC	71,568	381,886.84
		LAND SECURITIES GROUP PLC	60,008	571,576.20
		SEGRO PLC	79,187	524,376.31
イギリスポンド合計			290,170	2,023,841.88 (294,185,655)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	176,000	12,320,000.00
香港ドル合計			176,000	12,320,000.00 (172,233,600)
シンガ ポールド ル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	182,200	473,720.00
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	204,700	335,708.00
		CAPITALAND MALL TRUST	176,500	358,295.00
		SUNTEC REIT	173,200	292,708.00
シンガポールドル合計			736,600	1,460,431.00 (117,725,342)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	3,109	276,234.65
		GECINA SA	3,732	535,168.80
		ICADE	3,138	254,021.10
		KLEPIERRE	15,616	515,171.84
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	11,276	2,149,769.40
ユーロ合計			36,871	3,730,365.79 (476,815,355)
合計				7,692,420,068 (7,692,420,068)

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式	600銘柄	97.29%	65.06%
	投資証券	37銘柄		2.71%
カナダドル	株式	87銘柄	99.50%	3.73%
	投資証券	3銘柄		0.50%
オーストラリアドル	株式	59銘柄	93.59%	2.53%
	投資証券	7銘柄		6.41%
イギリスポンド	株式	98銘柄	98.74%	6.94%
	投資証券	4銘柄		1.26%
スイスフラン	株式	38銘柄	100.00%	3.03%
香港ドル	株式	40銘柄	96.03%	1.26%

	投資証券	1銘柄		3.97%	0.05%
シンガポールドル	株式	21銘柄	92.83%		0.46%
	投資証券	4銘柄		7.17%	0.04%
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%		1.00%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.00%		0.29%
デンマーククローネ	株式	17銘柄	100.00%		0.66%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.00%		0.11%
ユーロ	株式	243銘柄	98.86%		12.52%
	投資証券	5銘柄		1.14%	0.14%

## 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30年 6月25日現在]

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	2,875,528,537
コール・ローン	502,366,634
株式	65,086,115,798
投資証券	246,266,080
派生商品評価勘定	1,641,924
未収入金	13,867,087
未収配当金	160,746,608
差入委託証拠金	411,063,899
流動資産合計	69,297,596,567
資産合計	69,297,596,567
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	155,766,329
未払解約金	309,955,500
未払利息	1,063
流動負債合計	465,722,892
負債合計	465,722,892
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	27,812,655,806
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	41,019,217,869
元本等合計	68,831,873,675

[平成30年 6月25日現在]

純資産合計	68,831,873,675
負債純資産合計	69,297,596,567

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[平成30年 6月25日現在]
1. 期首	平成29年 8月16日
期首元本額	23,120,238,049円
期中追加設定元本額	9,308,176,933円
期中一部解約元本額	4,615,759,176円
元本の内訳	
eMAXIS 新興国株式インデックス	13,304,185,597円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,308,962,433円
eMAXIS バランス(波乗り型)	65,146,338円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	195,303,720円
コアバランス	90,366円
海外株式セレクション(ラップ向け)	32,574,635円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	643,426,339円
eMAXIS Slim 新興国株式インデックス	2,647,883,284円
つみたて新興国株式	214,824,863円
つみたて8資産均等バランス	86,181,558円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	426,048円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	579,573円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	1,477,285円
eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本)	60,752,252円
eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)	37,019,881円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	6,674,028,788円
新興国株式インデックスオープン	296,766,552円

	[平成30年 6月25日現在]
eMAXIS 全世界株式インデックス	389,470,201円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	215,518,595円
新興国株式インデックスファンド（ラップ向け）	4,884,183円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	10,389,552円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	65,860,533円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	54,419,990円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	317,376,423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）	1,170,883,058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）	6,288,104円
合計	27,812,655,806円
2. 受益権の総数	27,812,655,806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29年 8月16日 至 平成30年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<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>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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30年 6月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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30年 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,882,240,717
投資証券	21,359,060
合計	2,903,599,777

(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30年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,672,713,863		3,518,799,958	153,913,905
	合計	3,672,713,863		3,518,799,958	153,913,905

(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30年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	197,730,900		197,415,000	315,900
	香港ドル	14,029,000		13,970,000	59,000
	南アフリカランド	24,285,600		24,450,000	164,400
合計		236,045,500		235,835,000	210,500

## （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30年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	2.4748円
(1万口当たり純資産額)	(24,748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	591,268	4.31	2,553,686.49	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	104,200	1.34	140,565.80	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	47,555	66.10	3,143,385.50	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	10,741	142.80	1,533,814.80	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	136,860	6.10	835,929.17	
	SURGUTNEFTEGAS OJSC	870,900	0.44	387,043.54	
	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	723,400	0.48	350,605.43	
	TATNEFT PJSC	177,460	10.26	1,821,263.67	
	TRANSNEFT PJSC	62	2,695.26	167,106.47	
	ALROSA PJSC	271,900	1.53	418,585.15	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	20,697	14.97	309,834.09	
	MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	17,700	9.20	162,840.00	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC	6,949	175.39	1,218,795.87	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC	152,840	2.46	376,805.51	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	14,167	12.99	184,029.33	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	5,400	31.10	167,940.00	
	SEVERSTAL PJSC	22,700	15.03	341,195.95	
	SOUTHERN COPPER CORP	9,180	46.72	428,889.60	
	51JOB INC-ADR	2,668	105.06	280,300.08	
	DP WORLD LTD	17,357	22.90	397,475.30	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	14,428	45.87	661,812.36	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	15,642	100.92	1,578,590.64	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	37,067	39.24	1,454,509.08	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	40,853	40.46	1,652,912.38	
	CTIP.COM INTERNATIONAL-ADR	45,009	48.78	2,195,539.02	
	JD.COM INC-ADR	80,633	40.82	3,291,439.06	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	45,216	11.23	507,775.68	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	42,710	17.34	740,804.95	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	12,897	27.90	359,826.30	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	154,992	4.66	723,037.68	
	CREDICORP LTD	7,873	220.53	1,736,232.69	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	292,542	13.94	4,078,035.48	
VTB BANK PJSC	315,130,000	0.00	229,509.17		
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	159,120	1.74	277,541.12		
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	3,021	55.70	168,269.70		
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	105,800	1.42	151,188.20		



	58.COM INC-ADR	10,981	78.33	860,141.73	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	129,738	202.01	26,208,373.38	
	AUTOHOME INC-ADR	6,473	114.40	740,511.20	
	BAIDU INC - SPON ADR	30,901	259.00	8,003,359.00	
	FANG HOLDINGS LTD - ADR	21,605	4.15	89,660.75	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	6,344	42.77	271,332.88	
	MOMO INC-SPON ADR	12,671	50.78	643,433.38	
	NETEASE INC-ADR	9,178	259.40	2,380,773.20	
	SINA CORP	6,454	88.81	573,179.74	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,111	98.17	501,746.87	
	YY INC-ADR	4,807	115.54	555,400.78	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	61,024	8.48	517,483.52	
	INTER RAO UES PJSC	3,193,000	0.06	206,154.12	
	RUSHYDRO PJSC	10,464,000	0.01	112,714.02	
	アメリカドル 小計	333,354,094		76,691,379.83 (8,412,277,453)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	170,000	3.39	576,300.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	218,000	7.35	1,602,300.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,830,000	7.05	19,951,500.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	392,500	20.80	8,164,000.00	
	CNOOC LTD	1,996,000	12.34	24,630,640.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	406,000	6.92	2,809,520.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,325,000	5.71	13,275,750.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	212,000	11.20	2,374,400.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	422,000	3.60	1,519,200.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	108,000	8.18	883,440.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	144,000	47.00	6,768,000.00	
	BBMG CORP-H	223,000	2.95	657,850.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	390,000	3.99	1,556,100.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	448,000	8.82	3,951,360.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	208,000	8.87	1,844,960.00	
	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	189,600	4.35	824,760.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	149,000	10.44	1,555,560.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	174,000	8.12	1,412,880.00	
	MMG LTD	260,000	5.82	1,513,200.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	187,000	10.82	2,023,340.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	385,000	4.86	1,871,100.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	87,000	6.01	522,870.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	666,000	3.18	2,117,880.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	285,000	4.60	1,311,000.00	
	BOC AVIATION LTD	21,300	49.45	1,053,285.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	524,000	8.14	4,265,360.00	

CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	192,500	28.90	5,563,250.00
CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	40,700	10.40	423,280.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	208,000	8.23	1,711,840.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	487,000	6.08	2,960,960.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	230,000	8.89	2,044,700.00
CITIC LTD	675,000	11.10	7,492,500.00
CRRG CORP LTD - H	486,550	6.28	3,055,534.00
FOSUN INTERNATIONAL LTD	287,000	15.54	4,459,980.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	79,000	19.36	1,529,440.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	253,000	2.34	592,020.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	428,000	2.70	1,155,600.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	60,000	19.10	1,146,000.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	130,500	8.10	1,057,050.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	72,000	14.90	1,072,800.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	227,800	11.34	2,583,252.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	58,800	10.16	597,408.00
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRI-H	58,000	37.85	2,195,300.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	300,000	10.18	3,054,000.00
AIR CHINA LTD-H	214,000	8.67	1,855,380.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	208,000	8.73	1,815,840.00
CAR INC	76,000	7.76	589,760.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	144,000	6.12	881,280.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	162,000	16.60	2,689,200.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	220,000	7.73	1,700,600.00
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT-H	311,000	1.39	432,290.00
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	112,000	3.90	436,800.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	263,500	3.80	1,001,300.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	182,000	6.81	1,239,420.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	140,000	10.22	1,430,800.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS	98,500	16.28	1,603,580.00
SINOTRANS LIMITED-H	205,000	4.14	848,700.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	196,000	7.22	1,415,120.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	184,500	8.07	1,488,915.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	340,000	14.48	4,923,200.00
BYD CO LTD-H	71,500	48.80	3,489,200.00
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	354,000	4.18	1,479,720.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	66,800	8.15	544,420.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	334,000	8.87	2,962,580.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	59,600	27.75	1,653,900.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	562,000	21.70	12,195,400.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	364,500	6.66	2,427,570.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	322,945	8.24	2,661,066.80

NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	99,000	11.82	1,170,180.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	121,000	43.40	5,251,400.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	156,000	27.65	4,313,400.00
HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	2,356,000	0.29	695,020.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	88,000	96.90	8,527,200.00
SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	172,000	3.84	660,480.00
CHINA TRAVEL INTL INV HK	216,000	3.13	676,080.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,410,000	0.90	1,269,000.00
CHINA LITERATURE LTD	18,000	71.40	1,285,200.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	1,128,000	0.79	891,120.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	61,500	24.60	1,512,900.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	265,000	11.14	2,952,100.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	186,000	2.94	546,840.00
CHINA HUI SHAN DAIRY HOLDINGS	372,000	0.42	156,240.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	319,000	28.00	8,932,000.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	160,000	37.90	6,064,000.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	210,500	6.03	1,269,315.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	212,000	18.44	3,909,280.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	42,000	46.10	1,936,200.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	133,000	9.57	1,272,810.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	576,000	7.42	4,273,920.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	86,000	78.55	6,755,300.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	418,000	7.73	3,231,140.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	268,000	5.76	1,543,680.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	115,900	21.90	2,538,210.00
SINOPHARM GROUP CO-H	130,800	32.50	4,251,000.00
3SBIO INC	119,500	19.10	2,282,450.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	166,000	17.44	2,895,040.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	228,500	10.88	2,486,080.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	232,000	7.00	1,624,000.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	542,000	23.65	12,818,300.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	86,000	23.60	2,029,600.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	113,500	8.24	935,240.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	53,000	45.05	2,387,650.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	340,000	1.86	632,400.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	780,000	12.22	9,531,600.00
SSY GROUP LTD	158,000	9.32	1,472,560.00
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	52,000	13.16	684,320.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	54,000	89.75	4,846,500.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,247,000	3.77	12,241,190.00
BANK OF CHINA LTD-H	8,884,000	3.90	34,647,600.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,069,900	6.16	6,590,584.00

CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	1,016,000	5.07	5,151,120.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	10,790,550	7.38	79,634,259.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	288,000	3.75	1,080,000.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	447,050	29.80	13,322,090.00
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	561,100	7.06	3,961,366.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	302,000	5.03	1,519,060.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	7,780,350	6.03	46,915,510.50
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	293,000	5.23	1,532,390.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	1,049,000	2.69	2,821,810.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	106,000	15.46	1,638,760.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	346,500	4.24	1,469,160.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	1,116,000	2.50	2,790,000.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	107,200	14.76	1,582,272.00
CHONG SING HOLDINGS FINTECH	1,816,000	0.93	1,688,880.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	251,500	16.48	4,144,720.00
FAR EAST HORIZON LTD	287,000	7.83	2,247,210.00
GF SECURITIES CO LTD-H	145,400	11.60	1,686,640.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	59,000	16.92	998,280.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	334,800	8.34	2,792,232.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	200,200	13.06	2,614,612.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	826,000	20.85	17,222,100.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	306,000	32.00	9,792,000.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	504,000	1.72	866,880.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	175,800	27.00	4,746,600.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	97,900	35.35	3,460,765.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	825,000	3.77	3,110,250.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	520,000	13.36	6,947,200.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	583,000	75.65	44,103,950.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	17,000	52.35	889,950.00
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	168,000	15.30	2,570,400.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	294,000	21.65	6,365,100.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	594,000	4.23	2,512,620.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	446,000	26.85	11,975,100.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	314,000	27.55	8,650,700.00
CHINA VANKE CO LTD-H	128,451	29.25	3,757,191.75
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	360,000	5.88	2,116,800.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	850,232	15.64	13,297,628.48
FULLSHARE HOLDINGS LTD	740,000	3.57	2,641,800.00
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	190,000	7.72	1,466,800.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	90,500	11.48	1,038,940.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	110,800	16.88	1,870,304.00
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	106,000	13.88	1,471,280.00

KAISA GROUP HOLDINGS LTD	230,000	3.80	874,000.00
KWG PROPERTY HOLDING LTD	134,000	11.18	1,498,120.00
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	148,000	11.70	1,731,600.00
LONGFOR PROPERTIES	168,500	22.70	3,824,950.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	328,000	2.97	974,160.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	133,500	23.45	3,130,575.00
SHUI ON LAND LTD	374,500	2.08	778,960.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	346,000	4.96	1,716,160.00
SOHO CHINA LTD	193,000	3.86	744,980.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	282,000	30.95	8,727,900.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	708,000	1.58	1,118,640.00
YUZHOU PROPERTIES CO	172,000	5.08	873,760.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	206,000	8.12	1,672,720.00
KINGSOFT CORP LTD	90,000	24.00	2,160,000.00
TENCENT HOLDINGS LTD	639,400	397.40	254,097,560.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	118,000	22.00	2,596,000.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	85,000	115.80	9,843,000.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	73,500	11.32	832,020.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	149,000	5.42	807,580.00
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	68,000	30.00	2,040,000.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	112,500	9.70	1,091,250.00
LEGEND HOLDINGS CORP-H	35,000	24.30	850,500.00
LENOVO GROUP LTD	826,000	4.21	3,477,460.00
MEITU INC	138,000	6.75	931,500.00
SUNNY OPTICAL TECH	79,500	145.90	11,599,050.00
ZTE CORP-H	81,131	11.86	962,213.66
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	304,000	4.91	1,492,640.00
CHINA MOBILE LTD	688,000	68.70	47,265,600.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,558,000	3.50	5,453,000.00
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	722,000	9.79	7,068,380.00
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	65,500	40.60	2,659,300.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	682,000	4.42	3,014,440.00
CGN POWER CO LTD-H	1,342,000	2.07	2,777,940.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	193,000	32.60	6,291,800.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	347,000	6.74	2,338,780.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	435,000	1.94	843,900.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	108,000	32.05	3,461,400.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	226,000	14.24	3,218,240.00
DATANG INTL POWER GEN CO-H	304,000	2.43	738,720.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	85,000	81.00	6,885,000.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD	332,000	12.62	4,189,840.00
HUADIAN POWER INTL CORP-H	144,000	3.20	460,800.00

	HUANENG POWER INTL INC-H	532,000	5.34	2,840,880.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	512,000	2.87	1,469,440.00	
	TOWNGAS CHINA CO LTD	104,000	7.45	774,800.00	
	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,507,000	0.76	1,145,320.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROU	960,000	3.91	3,753,600.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	323,400	11.30	3,654,420.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	298,000	2.58	768,840.00	
	香港ドル 小計	101,564,959		1,139,473,109.19 (15,929,834,066)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	386,580	3.14	1,213,861.20	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	26,100	24.28	633,708.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	275,100	8.40	2,310,840.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	169,100	4.22	713,602.00	
	GAMUDA BHD	205,700	3.26	670,582.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	70,300	9.74	684,722.00	
	IJM CORP BHD	311,300	1.81	563,453.00	
	SIME DARBY BERHAD	248,500	2.42	601,370.00	
	AIRASIA GROUP BHD	140,000	3.10	434,000.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	91,500	8.75	800,625.00	
	MISC BHD	114,300	5.92	676,656.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	148,400	3.33	494,172.00	
	UMW HOLDINGS BHD	49,000	6.30	308,700.00	
	GENTING BHD	222,100	8.54	1,896,734.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	373,800	4.93	1,842,834.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	217,200	1.60	347,520.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	17,300	35.12	607,576.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	120,100	1.51	181,351.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	9,400	38.60	362,840.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	39,200	9.54	373,968.00	
	IOI CORP BHD	241,900	4.59	1,110,321.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	37,500	23.64	886,500.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,300	147.10	1,073,830.00	
	PPB GROUP BERHAD	55,700	19.36	1,078,352.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	248,500	5.28	1,312,080.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	163,600	5.76	942,336.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	232,200	6.00	1,393,200.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	67,600	11.56	781,456.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	146,200	4.17	609,654.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	165,700	3.65	604,805.00	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	530,900	5.81	3,084,529.00		
HONG LEONG BANK BERHAD	71,800	18.12	1,301,016.00		
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	33,300	18.18	605,394.00		

	MALAYAN BANKING BHD	414,300	9.19	3,807,417.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	337,600	22.92	7,737,792.00	
	RHB BANK BHD	91,549	5.65	517,251.85	
	IOI PROPERTIES GROUP BHD	172,800	1.57	271,296.00	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	248,500	1.16	288,260.00	
	SP SETIA BHD	158,000	2.93	462,940.00	
	MY EG SERVICES BHD	323,500	1.00	323,500.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	339,300	4.26	1,445,418.00	
	DIGI.COM BHD	363,600	4.37	1,588,932.00	
	MAXIS BHD	237,400	5.50	1,305,700.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	135,500	3.21	434,955.00	
	PETRONAS GAS BHD	73,500	17.36	1,275,960.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	344,500	13.80	4,754,100.00	
	YTL CORP BHD	545,663	1.14	622,055.82	
	マレーシアリングット 小計	9,022,892		55,338,164.87 (1,512,945,427)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	270,600	19.80	5,357,880.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	133,000	33.75	4,488,750.00	
	IRPC PCL - NVDR	1,161,700	6.05	7,028,285.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	158,200	129.50	20,486,900.00	
	PTT PCL-NVDR	1,147,000	48.00	55,056,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	105,500	80.00	8,440,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	192,500	55.50	10,683,750.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	264,161	81.25	21,463,081.25	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	42,450	404.00	17,149,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	501,500	65.00	32,597,500.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	862,300	7.60	6,553,480.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	722,800	9.20	6,649,760.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	290,400	32.75	9,510,600.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	500,701	13.50	6,759,463.50	
	ROBINSON PCL-NVDR	45,900	56.50	2,593,350.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	132,900	51.50	6,844,350.00	
	CP ALL PCL-NVDR	577,500	77.25	44,611,875.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	384,800	24.60	9,466,080.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	262,200	16.30	4,273,860.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	422,000	25.00	10,550,000.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	39,900	176.00	7,022,400.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	45,000	192.50	8,662,500.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	185,200	193.00	35,743,600.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	408,600	17.10	6,987,060.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	191,400	128.50	24,594,900.00	
	TMB BANK PCL-NVDR	1,542,100	2.30	3,546,830.00	

	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	169,400	69.25	11,730,950.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	200,700	11.50	2,308,050.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	60,600	60.00	3,636,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	120,200	187.50	22,537,500.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	1,227,076	5.95	7,301,102.20	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	12,700	231.00	2,933,700.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	66,900	94.50	6,322,050.00	
	タイパーツ 小計	12,447,888		433,891,406.95 (1,444,858,385)	
フィリピン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	205,080	55.35	11,351,178.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	559,300	12.00	6,711,600.00	
	DMCI HOLDINGS INC	571,900	10.00	5,719,000.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	320,650	49.65	15,920,272.50	
	SM INVESTMENTS CORP	29,405	868.00	25,523,540.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	45,000	79.40	3,573,000.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	48,550	267.00	12,962,850.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	90,220	115.00	10,375,300.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	100,271	88.00	8,823,848.00	
	BDO UNIBANK INC	216,670	125.50	27,192,085.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	83,045	73.20	6,078,894.00	
	SECURITY BANK CORP	21,400	198.00	4,237,200.00	
	AYALA CORPORATION	27,335	886.50	24,232,477.50	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	10,115	902.00	9,123,730.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	1,538,500	4.59	7,061,715.00	
	AYALA LAND INC	789,800	37.55	29,656,990.00	
	MEGAWORLD CORP	999,000	4.45	4,445,550.00	
	ROBINSONS LAND CO	304,700	18.62	5,673,514.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,069,600	33.25	35,564,200.00	
	GLOBE TELECOM INC	4,210	1,540.00	6,483,400.00	
	PLDT INC	11,215	1,133.00	12,706,595.00	
	ABOITIZ POWER CORP	195,300	35.70	6,972,210.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,800	334.80	8,303,040.00	
	フィリピン 小計	7,266,066		288,692,189.00 (594,705,909)	
インドネシア	ADARO ENERGY TBK PT	1,586,200	1,930.00	3,061,366,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	195,100	32,975.00	6,433,422,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	294,600	19,250.00	5,671,050,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	201,300	14,150.00	2,848,395,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	318,000	7,625.00	2,424,750,000.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	154,300	4,110.00	634,173,000.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	436,500	2,100.00	916,650,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	281,200	4,250.00	1,195,100,000.00	



	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,190,300	6,600.00	14,455,980,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	866,400	2,100.00	1,819,440,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	276,200	8,450.00	2,333,890,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	877,400	3,620.00	3,176,188,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	61,900	66,525.00	4,117,897,500.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	1,006,600	3,400.00	3,422,440,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	283,800	8,400.00	2,383,920,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	446,600	6,550.00	2,925,230,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	181,000	44,200.00	8,000,200,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,804,100	1,310.00	3,673,371,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,073,400	21,925.00	23,534,295,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	401,400	6,400.00	2,568,960,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	2,181,000	6,700.00	14,612,700,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	829,600	7,400.00	6,139,040,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	6,431,400	2,980.00	19,165,572,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	580,600	2,690.00	1,561,814,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	701,700	1,645.00	1,154,296,500.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	1,900,000	530.00	1,007,000,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	5,429,300	3,580.00	19,436,894,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	212,600	4,880.00	1,037,488,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	1,314,400	2,030.00	2,668,232,000.00	
	インドネシアルピア 小計	33,516,900		162,379,754,500.00 (1,266,562,085)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	1,653,368	12.75	21,080,442.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	386,570	57.16	22,096,341.20	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	15,420	337.17	5,199,161.40	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	121,598	56.24	6,838,671.52	
	ALFA S.A.B.-A	352,900	22.23	7,844,967.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	70,500	64.10	4,519,050.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	41,900	185.93	7,790,467.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	23,965	319.89	7,666,163.85	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	24,200	178.20	4,312,440.00	
	ALSEA SAB DE CV	42,800	66.16	2,831,648.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	277,000	71.66	19,849,820.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	16,500	118.19	1,950,135.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	575,900	52.88	30,453,592.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	54,766	123.06	6,739,503.96	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	52,200	116.01	6,055,722.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	221,400	170.35	37,715,490.00	
	GRUMA S.A.B.-B	22,680	238.10	5,400,108.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	190,500	37.22	7,090,410.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	172,300	31.31	5,394,713.00	

	BANCO SANTANDER MEXICO-B	232,345	26.65	6,191,994.25	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	270,000	111.33	30,059,100.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	270,700	28.24	7,644,568.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	3,727,300	16.31	60,792,263.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	59,700	86.58	5,168,826.00	
	メキシコペソ 小計	8,876,512		320,685,597.18 (1,754,150,216)	
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	19,200	35.39	679,488.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	329,200	17.76	5,846,592.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	442,000	15.11	6,678,620.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	43,100	45.93	1,979,583.00	
	BRASKEM SA-PREF A	19,100	50.74	969,134.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	73,800	7.72	569,736.00	
	FIBRIA CELULOSE SA	29,900	71.33	2,132,767.00	
	GERDAU SA-PREF	113,100	14.26	1,612,806.00	
	KLABIN SA - UNIT	72,500	19.37	1,404,325.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	53,200	43.88	2,334,416.00	
	VALE SA	355,630	48.01	17,073,796.30	
	EMBRAER SA	77,700	24.30	1,888,110.00	
	WEG SA	85,644	15.44	1,322,343.36	
	CCR SA	152,400	9.84	1,499,616.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	54,375	22.82	1,240,837.50	
	RUMO SA	125,300	13.08	1,638,924.00	
	KROTON EDUCACIONAL SA	153,992	9.65	1,486,022.80	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	91,661	15.91	1,458,326.51	
	LOJAS RENNER S.A.	78,200	28.38	2,219,316.00	
	MAGAZINE LUIZA SA	8,100	122.81	994,761.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	35,300	17.54	619,162.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	42,800	15.26	653,128.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	18,900	78.00	1,474,200.00	
	RAIA DROGASIL SA	28,200	67.87	1,913,934.00	
	AMBEV SA	522,100	18.16	9,481,336.00	
	BRF SA	48,300	19.45	939,435.00	
	JBS SA	93,400	9.33	871,422.00	
	M DIAS BRANCO SA	12,800	39.00	499,200.00	
	NATURA COSMETICOS SA	22,100	30.29	669,409.00	
	ODONTOPREV S.A.	24,500	12.62	309,190.00	
	HYPERA SA	36,200	27.80	1,006,360.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	122,877	23.60	2,899,897.20	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	364,028	26.14	9,515,691.92	
	BANCO DO BRASIL S.A.	100,500	26.10	2,623,050.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	48,500	30.15	1,462,275.00	

	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	358,587	39.34	14,106,812.58	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	512,607	8.98	4,603,210.86	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	235,675	19.97	4,706,429.75	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	79,400	24.32	1,931,008.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	10,400	47.01	488,904.00	
	PORTO SEGURO SA	15,200	38.80	589,760.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	27,358	18.27	499,830.66	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	82,954	9.13	757,370.02	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	9,900	53.76	532,224.00	
	CIELO SA	146,821	15.33	2,250,765.93	
	TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	50,275	45.50	2,287,512.50	
	TIM PARTICIPACOES SA	89,277	12.88	1,149,887.76	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	20,100	15.22	305,922.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	29,400	12.87	378,378.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	101,173	6.59	666,730.07	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	44,400	22.80	1,012,320.00	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	40,100	14.05	563,405.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	19,800	33.78	668,844.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	16,600	56.98	945,868.00	
	ブラジルリアル 小計	5,788,634		128,412,393.72 (3,720,107,046)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	45,164	9,889.60	446,653,894.00	
	EMPRESAS CMPC SA	147,834	2,382.80	352,258,855.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	10,805	31,515.00	340,519,575.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	35,269	7,020.40	247,602,487.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	84,605	5,934.40	502,079,912.00	
	CENCOSUD SA	134,178	1,669.10	223,956,499.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	17,584	8,053.30	141,609,227.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	22,000	2,639.40	58,066,800.00	
	BANCO DE CHILE	2,357,472	100.90	237,868,924.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,119	42,982.00	220,024,858.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	7,467,266	50.57	377,619,641.00	
	ITAU CORPBANCA	19,865,237	6.46	128,428,757.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	17,574	6,078.90	106,830,588.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	336,630	364.22	122,607,378.00	
	COLBUN SA	958,889	139.20	133,477,348.00	
	ENEL AMERICAS SA	3,137,061	118.03	370,267,309.00	
	ENEL CHILE SA	3,083,441	65.42	201,718,710.00	
	チリペソ 小計	37,726,128		4,211,590,762.00 (725,235,929)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	6,300	54,700.00	344,610,000.00	
	S-OIL CORP	5,104	110,000.00	561,440,000.00	

SK INNOVATION CO LTD	7,489	202,000.00	1,512,778,000.00
HANWHA CHEMICAL CORP	11,326	22,200.00	251,437,200.00
HYOSUNG CORPORATION	2,186	134,000.00	292,924,000.00
HYUNDAI STEEL CO	8,945	55,100.00	492,869,500.00
KOREA ZINC CO LTD	986	378,000.00	372,708,000.00
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	2,157	112,000.00	241,584,000.00
LG CHEM LTD	5,256	343,000.00	1,802,808,000.00
LG CHEM LTD-PREFERENCE	961	204,000.00	196,044,000.00
LOTTE CHEMICAL CORP	1,708	348,000.00	594,384,000.00
OCI CO LTD	1,883	110,500.00	208,071,500.00
POSCO	8,512	343,500.00	2,923,872,000.00
CJ CORP	1,568	140,500.00	220,304,000.00
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	3,208	80,000.00	256,640,000.00
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	13,323	5,850.00	77,939,550.00
DOOSAN BOBCAT INC	3,200	30,950.00	99,040,000.00
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	4,900	15,650.00	76,685,000.00
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,056	46,600.00	282,209,600.00
HANWHA CORPORATION	5,451	32,100.00	174,977,100.00
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	4,074	55,500.00	226,107,000.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,084	61,300.00	556,849,200.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	4,220	110,500.00	466,310,000.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	1,097	367,500.00	403,147,500.00
KCC CORP	654	329,500.00	215,493,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,500	40,300.00	302,250,000.00
LG CORP	9,995	71,900.00	718,640,500.00
LOTTE CORP	3,952	56,000.00	221,312,000.00
POSCO DAEWOO CORP	4,198	20,550.00	86,268,900.00
SAMSUNG C&T CORP	8,170	118,000.00	964,060,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	15,977	15,400.00	246,045,800.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	44,499	7,240.00	322,172,760.00
SK HOLDINGS CO LTD	3,418	257,000.00	878,426,000.00
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	2,040	35,500.00	72,420,000.00
S-1 CORPORATION	1,650	95,800.00	158,070,000.00
CJ LOGISTICS	730	164,000.00	119,720,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,125	120,500.00	256,062,500.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	5,796	28,150.00	163,157,400.00
PAN OCEAN CO LTD	19,000	4,780.00	90,820,000.00
HANKOOK TIRE CO LTD	8,476	43,850.00	371,672,600.00
HANON SYSTEMS	23,021	10,850.00	249,777,850.00
HYUNDAI MOBIS CO LTD	7,505	217,000.00	1,628,585,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	16,970	130,000.00	2,206,100,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	4,444	92,000.00	408,848,000.00

HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	2,671	83,300.00	222,494,300.00
KIA MOTORS CORP	31,389	31,300.00	982,475,700.00
COWAY CO LTD	5,978	87,400.00	522,477,200.00
HANSSEM CO LTD	1,257	107,500.00	135,127,500.00
HLB INC	3,390	98,000.00	332,220,000.00
LG ELECTRONICS INC	12,407	82,300.00	1,021,096,100.00
KANGWON LAND INC	13,902	27,650.00	384,390,300.00
CHEIL WORLDWIDE INC	9,543	19,900.00	189,905,700.00
CJ E&M CORP	2,495	97,600.00	243,512,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,680	125,000.00	460,000,000.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,360	111,000.00	150,960,000.00
LOTTE SHOPPING CO	1,167	203,000.00	236,901,000.00
SHINSEGAE INC	882	391,500.00	345,303,000.00
BGF RETAIL CO LTD	933	195,500.00	182,401,500.00
DONGSUH COMPANIES INC	4,963	26,150.00	129,782,450.00
E-MART INC	2,319	239,000.00	554,241,000.00
GS RETAIL CO LTD	2,340	42,250.00	98,865,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	1,032	350,500.00	361,716,000.00
KT&G CORP	13,316	104,000.00	1,384,864,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	2,661	154,000.00	409,794,000.00
OTTOGI CORPORATION	105	860,000.00	90,300,000.00
AMOREPACIFIC CORP	3,659	311,500.00	1,139,778,500.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	1,222	148,000.00	180,856,000.00
AMOREPACIFIC GROUP	3,527	121,000.00	426,767,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	994	1,480,000.00	1,471,120,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	283	761,000.00	215,363,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,774	111,400.00	420,423,600.00
CELLTRION INC	9,054	295,500.00	2,675,457,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,602	89,100.00	142,738,200.00
HANMI PHARM CO LTD	686	423,000.00	290,178,000.00
HANMI SCIENCE CO LTD	1,704	64,700.00	110,248,800.00
MEDY-TOX INC	506	745,800.00	377,374,800.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,868	437,500.00	817,250,000.00
SILLAJEN INC	6,052	72,000.00	435,744,000.00
VIROMED CO LTD	1,441	232,000.00	334,312,000.00
YUHAN CORP	967	219,000.00	211,773,000.00
BNK FINANCIAL GROUP INC	27,737	9,330.00	258,786,210.00
DGB FINANCIAL GROUP INC	20,041	10,200.00	204,418,200.00
HANA FINANCIAL GROUP	34,578	43,250.00	1,495,498,500.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	31,811	15,700.00	499,432,700.00
KB FINANCIAL GROUP INC	45,591	52,900.00	2,411,763,900.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	46,614	43,800.00	2,041,693,200.00

	WOORI BANK	50,333	16,350.00	822,944,550.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,218	83,600.00	352,624,800.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	42,663	8,560.00	365,195,280.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	15,720	14,950.00	235,014,000.00	
	SAMSUNG CARD CO	3,090	37,750.00	116,647,500.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	7,484	34,650.00	259,320,600.00	
	DB INSURANCE CO LTD	6,222	60,600.00	377,053,200.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	27,553	5,530.00	152,368,090.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	6,778	36,400.00	246,719,200.00	
	ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	3,300	42,800.00	141,240,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,642	265,000.00	965,130,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	8,257	100,500.00	829,828,500.00	
	KAKAO CORP	5,242	114,000.00	597,588,000.00	
	NAVER CORP	3,221	723,000.00	2,328,783,000.00	
	NCSOFT CORP	2,004	372,500.00	746,490,000.00	
	NETMARBLE CORP	2,728	155,500.00	424,204,000.00	
	PEARL ABYSS CORP	549	227,600.00	124,952,400.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	4,009	201,000.00	805,809,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	26,276	19,000.00	499,244,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,685	139,000.00	234,215,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	6,546	151,000.00	988,446,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	540,220	47,250.00	25,525,395,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	96,215	37,450.00	3,603,251,750.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	6,397	227,000.00	1,452,119,000.00	
	KT CORP	2,250	27,700.00	62,325,000.00	
	SK TELECOM	2,000	242,000.00	484,000,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	27,405	34,900.00	956,434,500.00	
	KOREA GAS CORPORATION	3,688	61,700.00	227,549,600.00	
	SK HYNIX INC	65,075	89,500.00	5,824,212,500.00	
	韓国ウォン 小計	1,645,385		96,664,549,290.00 (9,502,125,195)	
ニュー台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	132,150	120.00	15,858,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	259,281	33.70	8,737,769.70	
	CHINA STEEL CORP	1,449,947	23.70	34,363,743.90	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	391,430	117.50	45,993,025.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	475,600	109.50	52,078,200.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	544,557	84.60	46,069,522.20	
	TAIWAN CEMENT	413,706	44.60	18,451,287.60	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	13,000	415.00	5,395,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	322,138	28.85	9,293,681.30	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	24,755	340.00	8,416,700.00	
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	238,000	23.10	5,497,800.00	

CHINA AIRLINES LTD	405,000	9.85	3,989,250.00
EVA AIRWAYS CORP	183,142	15.00	2,747,130.00
EVERGREEN MARINE CORP LTD	251,318	14.10	3,543,583.80
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	228,000	23.50	5,358,000.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	221,413	45.10	9,985,726.30
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	23,728	345.50	8,198,024.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	43,926	135.50	5,951,973.00
FORMOSA TAFFETA CO.	111,000	33.70	3,740,700.00
GIANT MANUFACTURING	35,000	126.50	4,427,500.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	19,000	265.00	5,035,000.00
POU CHEN	201,500	35.35	7,123,025.00
RUENTEX INDUSTRIES LTD	47,000	63.00	2,961,000.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	33,000	277.00	9,141,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	68,000	331.00	22,508,000.00
STANDARD FOODS CORP	31,023	62.20	1,929,630.60
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	556,624	76.70	42,693,060.80
TAIMED BIOLOGICS INC	21,000	308.00	6,468,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	549,377	17.70	9,723,972.90
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,530,255	11.05	16,909,317.75
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	2,004,955	21.85	43,808,266.75
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,056,603	20.90	22,083,002.70
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,049,886	20.65	21,680,145.90
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	857,255	17.55	15,044,825.25
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,285,754	26.60	34,201,056.40
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,258,842	11.10	13,973,146.20
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	967,267	14.40	13,928,644.80
TAIWAN BUSINESS BANK	459,578	9.47	4,352,203.66
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	987,311	17.75	17,524,770.25
CHAILEASE HOLDING CO LTD	136,464	105.00	14,328,720.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	725,087	53.70	38,937,171.90
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,149,321	14.00	16,090,494.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	943,366	56.00	52,828,496.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	272,016	31.80	8,650,108.80
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	906,281	11.85	10,739,429.85
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	75,000	45.70	3,427,500.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	91,200	35.70	3,255,840.00
ACER INC	331,168	25.75	8,527,576.00
ADVANTECH CO LTD	36,676	202.00	7,408,552.00
ASUSTEK COMPUTER INC	83,774	274.50	22,995,963.00
AU OPTRONICS CORP	1,008,000	12.95	13,053,600.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	76,000	334.00	25,384,000.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	69,419	69.60	4,831,562.40

COMPAL ELECTRONICS	448,775	19.25	8,638,918.75		
DELTA ELECTRONICS INC	230,220	110.50	25,439,310.00		
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	97,042	73.30	7,113,178.60		
GENERAL INTERFACE SOLUTION	17,000	194.00	3,298,000.00		
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,812,840	82.30	149,196,732.00		
HTC CORP	84,744	56.70	4,804,984.80		
INNOLUX CORP	1,004,112	11.20	11,246,054.40		
INVENTEC CORP	281,429	24.80	6,979,439.20		
LARGAN PRECISION CO LTD	10,820	4,370.00	47,283,400.00		
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	258,160	37.95	9,797,172.00		
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	81,000	100.00	8,100,000.00		
PEGATRON CORP	219,976	65.00	14,298,440.00		
QUANTA COMPUTER INC	312,150	54.50	17,012,175.00		
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	170,193	46.50	7,913,974.50		
WALSIN TECHNOLOGY CORP	34,000	320.50	10,897,000.00		
WISTRON CORP	281,141	22.75	6,395,957.75		
WPG HOLDINGS LTD	171,400	43.85	7,515,890.00		
YAGEO CORPORATION	23,000	942.00	21,666,000.00		
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	40,000	67.90	2,716,000.00		
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	439,000	110.00	48,290,000.00		
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	183,000	77.70	14,219,100.00		
TAIWAN MOBILE CO LTD	191,400	111.00	21,245,400.00		
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	407,294	72.30	29,447,356.20		
GLOBALWAFERS CO LTD	25,000	492.00	12,300,000.00		
MACRONIX INTERNATIONAL	186,000	43.40	8,072,400.00		
MEDIATEK INC	174,236	310.50	54,100,278.00		
NANYA TECHNOLOGY CORP	118,000	92.50	10,915,000.00		
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	63,000	136.50	8,599,500.00		
PHISON ELECTRONICS CORP	21,000	262.50	5,512,500.00		
POWERTECH TECHNOLOGY INC	84,300	87.70	7,393,110.00		
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	57,703	114.50	6,606,993.50		
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,761,000	227.50	628,127,500.00		
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,403,000	17.80	24,973,400.00		
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	110,000	68.50	7,535,000.00		
WIN SEMICONDUCTORS CORP	42,000	233.00	9,786,000.00		
WINBOND ELECTRONICS CORP	303,000	19.30	5,847,900.00		
ニュー台湾ドル 小計	36,802,028		2,112,927,764.41 (7,648,798,507)		
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	87,415	426.35	37,269,385.25	
	COAL INDIA LTD	72,972	264.85	19,326,634.20	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	63,761	311.15	19,839,235.15	
	INDIAN OIL CORP LTD	139,102	170.00	23,647,340.00	



OIL & NATURAL GAS CORP LTD	151,258	159.55	24,133,213.90
PETRONET LNG LTD	79,824	209.90	16,755,057.60
RELIANCE INDUSTRIES LTD	317,998	1,012.50	321,972,975.00
AMBUJA CEMENTS LTD	63,614	204.95	13,037,689.30
ASIAN PAINTS LTD	34,518	1,267.70	43,758,468.60
GRASIM INDUSTRIES LTD	37,029	1,010.40	37,414,101.60
HINDALCO INDUSTRIES LTD	147,848	222.00	32,822,256.00
JSW STEEL LTD	102,461	336.95	34,524,233.95
PIDILITE INDUSTRIES LTD	12,185	1,050.70	12,802,779.50
SHREE CEMENT LTD	895	15,577.80	13,942,131.00
TATA STEEL LTD	44,146	561.85	24,803,430.10
TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,612	140.00	365,680.00
ULTRATECH CEMENT LTD	10,165	3,641.05	37,011,273.25
UPL LTD	40,466	640.20	25,906,333.20
VEDANTA LTD	141,255	228.55	32,283,830.25
ASHOK LEYLAND LTD	130,037	136.40	17,737,046.80
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	80,748	75.00	6,056,100.00
EICHER MOTORS LTD	1,550	29,140.65	45,168,007.50
HAVELLS INDIA LTD	28,929	542.65	15,698,321.85
LARSEN & TOUBRO LTD	52,049	1,299.85	67,655,892.65
SIEMENS LTD	8,272	993.75	8,220,300.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	54,097	365.80	19,788,682.60
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	3,787	1,247.00	4,722,389.00
INTERGLOBE AVIATION LTD	9,318	1,187.25	11,062,795.50
BAJAJ AUTO LTD	9,613	2,832.20	27,225,938.60
BHARAT FORGE LTD	23,964	613.10	14,692,328.40
BOSCH LTD	793	17,959.25	14,241,685.25
HERO MOTOCORP LTD	6,812	3,637.65	24,779,671.80
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	85,140	908.20	77,324,148.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	11,686	8,874.90	103,712,081.40
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	78,936	303.75	23,976,810.00
TATA MOTORS LTD	171,930	308.00	52,954,440.00
TITAN CO LTD	37,730	877.55	33,109,961.50
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	57,513	565.75	32,537,979.75
AVENUE SUPERMARTS LTD	13,344	1,494.25	19,939,272.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,000	5,959.45	17,878,350.00
ITC LTD	396,075	265.15	105,019,286.25
NESTLE INDIA LTD	2,499	9,871.05	24,667,753.95
UNITED SPIRITS LTD	34,060	681.30	23,205,078.00
DABUR INDIA LTD	57,083	385.15	21,985,517.45
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	28,647	1,165.95	33,400,969.65
HINDUSTAN UNILEVER LTD	74,832	1,608.10	120,337,339.20

	MARICO LTD	53,035	333.55	17,689,824.25	
	AUROBINDO PHARMA LTD	27,351	611.10	16,714,196.10	
	CADILA HEALTHCARE LTD	27,181	409.20	11,122,465.20	
	CIPLA LTD	35,859	615.75	22,080,179.25	
	DR. REDDY'S LABORATORIES	12,764	2,336.25	29,819,895.00	
	GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	12,600	599.85	7,558,110.00	
	LUPIN LTD	26,667	902.90	24,077,634.30	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	10,070	2,599.00	26,171,930.00	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	90,100	577.25	52,010,225.00	
	AXIS BANK LTD	208,553	525.65	109,625,884.45	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	176,168	1,906.75	335,908,334.00	
	ICICI BANK LTD	261,211	300.65	78,533,087.15	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	29,780	1,199.65	35,725,577.00	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	31,322	497.40	15,579,562.80	
	STATE BANK OF INDIA	203,291	273.05	55,508,607.55	
	YES BANK LTD	200,926	335.10	67,330,302.60	
	BAJAJ FINANCE LTD	19,368	2,336.05	45,244,616.40	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	33,735	497.35	16,778,102.25	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP	87,685	110.85	9,719,882.25	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	16,355	1,494.00	24,434,370.00	
	BAJAJ FINSERV LTD	4,820	6,176.50	29,770,730.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	66,549	904.80	60,213,535.20	
	INFOSYS LTD	194,068	1,247.85	242,167,753.80	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	104,766	1,809.80	189,605,506.80	
	TECH MAHINDRA LTD	58,108	691.15	40,161,344.20	
	VAKRANGEE LTD	41,800	52.50	2,194,500.00	
	WIPRO LTD	129,679	258.25	33,489,601.75	
	BHARTI AIRTEL LTD	166,097	374.55	62,211,631.35	
	BHARTI INFRATEL LTD	32,521	286.00	9,301,006.00	
	IDEA CELLULAR LTD	247,689	60.55	14,997,568.95	
	GAIL INDIA LTD	71,690	340.00	24,374,600.00	
	NTPC LTD	183,584	157.30	28,877,763.20	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	170,551	197.70	33,717,932.70	
	TATA POWER CO LTD	169,093	76.15	12,876,431.95	
	インドルピー 小計	6,217,004		3,524,306,886.40 (5,744,620,224)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	8,864	916.00	8,119,424.00	
	MONETA MONEY BANK AS	57,129	76.10	4,347,516.90	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	9,494	254.50	2,416,223.00	
	CEZ AS	16,130	553.50	8,927,955.00	
	チェココルナ 小計	91,617		23,811,118.90 (117,865,038)	

コロンビアペソ	ECOPETROL SA	595,972	2,880.00	1,716,399,360.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	50,956	9,600.00	489,177,600.00	
	GRUPO ARGOS SA	32,301	19,000.00	613,719,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	33,198	33,500.00	1,112,133,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	44,628	34,100.00	1,521,814,800.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	400,277	1,190.00	476,329,630.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	22,594	36,500.00	824,681,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	12,909	34,020.00	439,164,180.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	45,615	13,660.00	623,100,900.00	
コロンビアペソ 小計		1,238,450		7,816,519,470.00	(293,901,132)
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	42,150	2,614.00	110,180,100.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	16,549	5,015.00	82,993,235.00	
	OTP BANK PLC	23,750	10,080.00	239,400,000.00	
ハンガリーフォリント 小計		82,449		432,573,335.00	(170,174,349)
アラブディルハム	DUBAI INVESTMENTS PJSC	153,000	2.01	307,530.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	220,831	7.19	1,587,774.89	
	DUBAI ISLAMIC BANK	184,080	5.02	924,081.60	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	153,829	12.05	1,853,639.45	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	353,653	2.02	714,379.06	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	160,000	2.33	372,800.00	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	113,854	5.20	592,040.80	
	EMAAR MALLS PJSC	256,775	2.14	549,498.50	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	420,335	5.20	2,185,742.00	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	208,221	16.10	3,352,358.10	
アラブディルハム 小計		2,224,578		12,439,844.40	(372,075,746)
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	8,810	56.00	493,360.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	36,015	82.80	2,982,042.00	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	185,872	5.68	1,055,752.96	
	GRUPA AZOTY SA	6,391	44.32	283,249.12	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	6,875	80.10	550,687.50	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	15,870	87.00	1,380,690.00	
	CCC SA	3,290	225.40	741,566.00	
	LPP SA	139	9,135.00	1,269,765.00	
	CYFROWY POLSAT SA	26,995	22.68	612,246.60	
	DINO POLSKA SA	4,500	98.15	441,675.00	
	ALIOR BANK SA	10,598	69.00	731,262.00	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	5,658	69.00	390,402.00	
	BANK MILLENNIUM SA	76,012	8.05	611,896.60	
	BANK PEKAO SA	19,394	114.75	2,225,461.50	

	BANK ZACHODNI WBK SA	4,028	344.00	1,385,632.00
	MBANK SA	1,716	402.00	689,832.00
	PKO BANK POLSKI SA	94,133	37.90	3,567,640.70
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	73,269	38.26	2,803,271.94
	CD PROJEKT SA	8,334	166.30	1,385,944.20
	ORANGE POLSKA SA	57,240	4.76	272,462.40
	PLAY COMMUNICATIONS SA	14,900	26.18	390,082.00
	PGE SA	87,510	9.46	827,844.60
	ポーランドズロチ 小計	747,549		25,092,766.12 (741,742,166)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	31,709	124.16	3,936,989.44
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	7,059	330.34	2,331,870.06
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	49,978	110.92	5,543,559.76
	GOLD FIELDS LTD	85,465	47.62	4,069,843.30
	KUMBA IRON ORE LTD	6,900	302.09	2,084,421.00
	MONDI LTD	14,521	358.40	5,204,326.40
	SAPPI LIMITED	65,528	89.45	5,861,479.60
	SASOL LTD	61,425	467.88	28,739,529.00
	BIDVEST GROUP LTD	40,433	203.36	8,222,454.88
	NASPERS LTD-N SHS	49,124	3,307.43	162,474,191.32
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	16,915	206.14	3,486,858.10
	MR PRICE GROUP LTD	29,350	232.73	6,830,625.50
	THE FOSCHINI GROUP LTD	26,717	189.96	5,075,161.32
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	55,343	81.03	4,484,443.29
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	109,873	54.15	5,949,622.95
	BID CORP LTD	40,339	273.08	11,015,774.12
	CLICKS GROUP LTD	26,191	204.02	5,343,487.82
	PICK N PAY STORES LTD	42,191	78.94	3,330,557.54
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	51,165	228.60	11,696,319.00
	SPAR GROUP LIMITED/THE	21,107	186.58	3,938,144.06
	PIONEER FOODS GROUP LTD	17,184	113.07	1,942,994.88
	TIGER BRANDS LTD	17,695	332.59	5,885,180.05
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	142,938	24.78	3,542,003.64
	NETCARE LTD	120,289	27.80	3,344,034.20
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	41,376	259.60	10,741,209.60
	BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	82,422	161.95	13,348,242.90
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	4,393	881.05	3,870,452.65
NEDBANK GROUP LTD	25,687	256.44	6,587,174.28	
STANDARD BANK GROUP LTD	142,739	190.24	27,154,667.36	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	30,502	60.80	1,854,521.60	
FIRSTRAND LTD	384,653	61.40	23,617,694.20	
INVESTEC LTD	30,241	96.39	2,914,929.99	

	PSG GROUP LTD	17,360	217.67	3,778,751.20
	REINET INVESTMENTS SCA	14,360	238.42	3,423,711.20
	REMGRO LTD	55,783	204.50	11,407,623.50
	RMB HOLDINGS LTD	82,310	74.16	6,104,109.60
	DISCOVERY LTD	40,296	150.50	6,064,548.00
	LIBERTY HOLDINGS LTD	17,401	120.29	2,093,166.29
	MMI HOLDINGS LTD	96,670	17.85	1,725,559.50
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	78,513	37.43	2,938,741.59
	SANLAM LTD	185,326	73.07	13,541,770.82
	NEPI ROCKCASTLE PLC	45,385	120.12	5,451,646.20
	MTN GROUP LTD	185,703	107.11	19,890,648.33
	TELKOM SA SOC LTD	24,490	48.50	1,187,765.00
	VODACOM GROUP LTD	71,084	126.82	9,014,872.88
	南アフリカランド 小計	2,786,133		481,045,677.92 (3,925,332,731)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	15,657	113.50	1,777,069.50
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	143,265	10.52	1,507,147.80
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	62,700	4.65	291,555.00
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	18,000	21.14	380,520.00
	KOC HOLDING AS	104,594	14.45	1,511,383.30
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	112,856	4.14	467,223.84
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	14,000	23.00	322,000.00
	TURK HAVA YOLLARI AO	61,133	12.90	788,615.70
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,460	69.75	450,585.00
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	16,554	25.48	421,795.92
	ARCELIK AS	29,629	16.22	480,582.38
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	23,976	68.25	1,636,362.00
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	27,231	24.00	653,544.00
	COCA-COLA ICECEK AS	6,400	33.20	212,480.00
	ULKER BISKUVI SANAYI	23,160	18.72	433,555.20
	AKBANK T.A.S.	243,710	7.37	1,796,142.70
	TURKIYE GARANTI BANKASI	254,553	8.52	2,168,791.56
	TURKIYE HALK BANKASI	56,840	7.43	422,321.20
	TURKIYE IS BANKASI-C	168,876	6.00	1,013,256.00
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	65,670	4.90	321,783.00
	YAPI VE KREDI BANKASI	74,500	2.35	175,075.00
	HACI OMER SABANCI HOLDING	94,696	8.90	842,794.40
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	129,733	11.50	1,491,929.50
	トルコリラ 小計	1,754,193		19,566,513.00 (464,704,683)
ユーロ	TITAN CEMENT CO. S.A.	7,404	22.05	163,258.20
	OPAP SA	23,143	9.40	217,544.20

	FF GROUP	5,889	4.80	28,267.20	
	JUMBO SA	12,381	13.16	162,933.96	
	ALPHA BANK AE	158,150	2.00	316,300.00	
	EUROBANK ERGASIAS SA	203,876	0.95	193,682.20	
	NATIONAL BANK OF GREECE	740,961	0.28	207,469.08	
	PIRAEUS BANK S.A	29,079	3.04	88,574.63	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	25,539	10.54	269,181.06	
	ユーロ 小計	1,206,422		1,647,210.53 (210,546,449)	
カタールリアル	INDUSTRIES QATAR	20,890	107.00	2,235,230.00	
	COMMERCIAL BANK PQSC	21,639	37.40	809,298.60	
	DOHA BANK QPSC	21,586	27.20	587,139.20	
	MASRAF AL RAYAN	38,797	34.70	1,346,255.90	
	QATAR ISLAMIC BANK	13,338	119.00	1,587,222.00	
	QATAR NATIONAL BANK	51,151	154.00	7,877,254.00	
	QATAR INSURANCE CO	16,205	36.44	590,510.20	
	BARWA REAL ESTATE CO	8,300	33.69	279,627.00	
	EZDAN HOLDING GROUP	84,250	8.30	699,275.00	
	OOREDOO QPSC	8,931	70.10	626,063.10	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	5,694	183.88	1,047,012.72	
	カタールリアル 小計	290,781		17,684,887.72 (533,553,062)	
	合 計	604,650,662		65,086,115,798 (65,086,115,798)	

(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	384,800	10,328,032.00	
			384,800	10,328,032.00 (56,494,335)	
南アフリ カランド	投資証券	FORTRESS REIT LTD-A	73,848	1,148,336.40	
		FORTRESS REIT LTD-B	89,509	1,325,628.29	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	330,692	8,647,595.80	
		HYPROP INVESTMENTS LTD	28,577	2,929,714.04	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	568,113	5,970,867.63	
		RESILIENT REIT LTD	30,408	1,686,123.60	
			1,121,147	21,708,265.76	

南アフリカランド合計				(177,139,448)	
トルコリラ	投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	264,620	531,886.20	
トルコリラ合計			264,620	531,886.20	(12,632,297)
合計				246,266,080	(246,266,080)

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 50銘柄	100.00%		12.88%
香港ドル	株式 201銘柄	100.00%		24.38%
マレーシアリングット	株式 47銘柄	100.00%		2.32%
タイバーツ	株式 33銘柄	100.00%		2.21%
フィリピンペソ	株式 23銘柄	100.00%		0.91%
インドネシアルピア	株式 29銘柄	100.00%		1.94%
メキシコペソ	株式 24銘柄	96.88%		2.68%
	投資証券 1銘柄		3.12%	0.09%
ブラジルリアル	株式 54銘柄	100.00%		5.69%
チリペソ	株式 17銘柄	100.00%		1.11%
韓国ウォン	株式 115銘柄	100.00%		14.54%
ニュー台湾ドル	株式 89銘柄	100.00%		11.71%
インドルピー	株式 80銘柄	100.00%		8.79%
チェココルナ	株式 4銘柄	100.00%		0.18%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.00%		0.45%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.00%		0.26%
アラブディルハム	株式 10銘柄	100.00%		0.57%
ポーランドズロチ	株式 22銘柄	100.00%		1.14%
南アフリカランド	株式 45銘柄	95.68%		6.01%
	投資証券 6銘柄		4.32%	0.27%
トルコリラ	株式 23銘柄	97.35%		0.71%
	投資証券 1銘柄		2.65%	0.02%
ユーロ	株式 9銘柄	100.00%		0.32%
カタールリアル	株式 11銘柄	100.00%		0.82%

## 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30年 6月25日現在]	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	5,617,903,501
国債証券	453,016,540,920
地方債証券	30,928,929,558
特殊債証券	39,332,042,171
社債証券	23,579,291,830
派生商品評価勘定	2,095,960
未収利息	767,044,451
前払費用	42,353,846
差入委託証拠金	5,070,000
流動資産合計	553,291,272,237
<b>資産合計</b>	<b>553,291,272,237</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
前受金	1,980,000
未払金	2,434,449,000
未払解約金	200,992,927
未払利息	11,896
流動負債合計	2,637,433,823
<b>負債合計</b>	<b>2,637,433,823</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	413,638,936,898
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	137,014,901,516
元本等合計	550,653,838,414
純資産合計	550,653,838,414
<b>負債純資産合計</b>	<b>553,291,272,237</b>

## 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30年 6月25日現在]
1. 期首	平成29年 8月16日
期首元本額	337,665,927,639円
期中追加設定元本額	240,360,332,879円
期中一部解約元本額	164,387,323,620円
元本の内訳	
ファンド・マネジャー（国内債券）	96,381,917,019円
eMAXIS 国内債券インデックス	9,927,657,801円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	2,316,942,037円
eMAXIS バランス（波乗り型）	213,279,667円
コアバランス	2,555,517円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	97,113,337円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	58,151,706円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	30,102,768円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	1,276,667,531円
国内債券セレクション（ラップ向け）	2,547,566,955円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	1,110,156,472円
つみたて8資産均等バランス	149,143,886円
つみたて4資産均等バランス	33,267,868円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,298,198円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	528,119円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	46,897円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	5,009,269円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	2,967,830円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	2,187,019円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	9,360,850,374円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	3,043,291,695円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	1,568,818,920円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	991,194,825円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	8,729,598,297円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	280,590,884円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	306,677,288円
eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）	71,683,417円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	177,428,609円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	242,316,306円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	176,301,436円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	373,058,217円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	42,722,726円

	[平成30年 6月25日現在]
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	10,052,979円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	114,748,585円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	13,415,981,382円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)	1,504,973,153円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	5,770,058,614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)	186,104,556,806円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)	680,056,011円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投資家限定)	43,211,703円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	29,800,112円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定)	271,261,485円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	63,159,642円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	5,296,020,515円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	3,715,256,794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)	12,840,263,985円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	3,602,300,364円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	1,267,705,864円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	124,473,689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)	23,667,165,876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)	259,317,356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)	1,941,933,251円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	25,301,961円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	38,830,165円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	28,196,210円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	22,476,722円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	168,741,842円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	339,761,352円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	127,110,838円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	277,142,948円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	3,480,108,441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)	1,910,444,557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)	3,705,803,554円

	[平成30年 6月25日現在]
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)	2,041,289,914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)	1,229,337,338円
合計	413,638,936,898円
2. 受益権の総数	413,638,936,898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29年 8月16日 至 平成30年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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30年 6月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。

区分	[平成30年 6月25日現在]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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30年 6月25日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		601,802,630
地方債証券		12,190,007
特殊債券		23,387,284
社債券		4,468,270
合計		641,848,191

（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30年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）	時価（円）		評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,959,070,000		1,961,180,000	2,110,000
	合計	1,959,070,000		1,961,180,000	2,110,000

## （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30年 6月25日現在]	
1口当たり純資産額	1.3312円
(1万口当たり純資産額)	(13,312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378回利付国債（2年）	1,500,000,000	1,503,780,000	
	第381回利付国債（2年）	3,500,000,000	3,510,955,000	
	第382回利付国債（2年）	1,400,000,000	1,404,676,000	
	第383回利付国債（2年）	4,190,000,000	4,204,790,700	
	第384回利付国債（2年）	2,450,000,000	2,459,163,000	
	第385回利付国債（2年）	5,350,000,000	5,371,079,000	
	第386回利付国債（2年）	4,950,000,000	4,970,443,500	
	第387回利付国債（2年）	2,000,000,000	2,008,660,000	
	第388回利付国債（2年）	1,400,000,000	1,406,342,000	
	第120回利付国債（5年）	2,500,000,000	2,510,500,000	
	第121回利付国債（5年）	1,580,000,000	1,584,692,600	
	第122回利付国債（5年）	3,270,000,000	3,281,412,300	
	第123回利付国債（5年）	1,560,000,000	1,566,224,400	
	第124回利付国債（5年）	2,430,000,000	2,441,105,100	
	第125回利付国債（5年）	4,400,000,000	4,422,660,000	
	第126回利付国債（5年）	2,960,000,000	2,976,960,800	
	第127回利付国債（5年）	2,770,000,000	2,787,451,000	
	第128回利付国債（5年）	2,550,000,000	2,567,161,500	
	第129回利付国債（5年）	2,750,000,000	2,770,075,000	
	第130回利付国債（5年）	3,150,000,000	3,174,790,500	
	第131回利付国債（5年）	3,110,000,000	3,136,217,300	
	第132回利付国債（5年）	4,250,000,000	4,287,400,000	
	第133回利付国債（5年）	4,620,000,000	4,663,243,200	
	第134回利付国債（5年）	6,010,000,000	6,069,619,200	
	第135回利付国債（5年）	4,880,000,000	4,931,044,800	
	第1回利付国債（40年）	475,000,000	689,847,250	

第2回利付国債(40年)	680,000,000	956,100,400
第3回利付国債(40年)	733,000,000	1,034,592,850
第4回利付国債(40年)	1,008,000,000	1,427,751,360
第5回利付国債(40年)	1,045,000,000	1,423,478,100
第6回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,428,728,200
第7回利付国債(40年)	1,100,000,000	1,404,370,000
第8回利付国債(40年)	1,140,000,000	1,351,447,200
第9回利付国債(40年)	1,870,000,000	1,608,891,900
第10回利付国債(40年)	2,120,000,000	2,160,322,400
第303回利付国債(10年)	2,325,000,000	2,369,314,500
第304回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,190,849,400
第305回利付国債(10年)	3,258,000,000	3,327,558,300
第306回利付国債(10年)	3,688,000,000	3,786,248,320
第307回利付国債(10年)	1,610,000,000	1,650,089,000
第308回利付国債(10年)	1,374,000,000	1,413,213,960
第309回利付国債(10年)	3,700,000,000	3,790,872,000
第310回利付国債(10年)	2,136,000,000	2,190,104,880
第311回利付国債(10年)	2,100,000,000	2,144,016,000
第312回利付国債(10年)	6,860,000,000	7,088,300,800
第313回利付国債(10年)	3,469,000,000	3,604,950,110
第314回利付国債(10年)	3,390,000,000	3,504,276,900
第315回利付国債(10年)	3,133,000,000	3,257,317,440
第316回利付国債(10年)	2,280,000,000	2,363,630,400
第317回利付国債(10年)	2,157,000,000	2,242,827,030
第318回利付国債(10年)	2,080,000,000	2,156,003,200
第319回利付国債(10年)	5,519,000,000	5,755,599,530
第320回利付国債(10年)	1,980,000,000	2,057,952,600
第321回利付国債(10年)	2,515,000,000	2,620,579,700
第322回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,214,729,100
第323回利付国債(10年)	1,675,000,000	1,743,373,500
第324回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,903,096,000
第325回利付国債(10年)	3,835,000,000	3,985,178,600
第326回利付国債(10年)	730,000,000	756,988,100
第327回利付国債(10年)	2,540,000,000	2,645,359,200
第328回利付国債(10年)	3,700,000,000	3,825,837,000
第329回利付国債(10年)	7,710,000,000	8,061,576,000
第330回利付国債(10年)	2,930,000,000	3,069,585,200
第331回利付国債(10年)	1,060,000,000	1,099,336,600
第332回利付国債(10年)	6,290,000,000	6,530,969,900
第333回利付国債(10年)	4,480,000,000	4,658,080,000
第334回利付国債(10年)	4,280,000,000	4,456,293,200
第335回利付国債(10年)	4,870,000,000	5,046,975,800

第336回利付国債(10年)	4,080,000,000	4,232,877,600	
第337回利付国債(10年)	1,340,000,000	1,372,736,200	
第338回利付国債(10年)	3,030,000,000	3,126,293,400	
第339回利付国債(10年)	4,560,000,000	4,708,747,200	
第340回利付国債(10年)	3,570,000,000	3,689,309,400	
第341回利付国債(10年)	3,670,000,000	3,767,915,600	
第342回利付国債(10年)	3,580,000,000	3,621,671,200	
第343回利付国債(10年)	4,160,000,000	4,206,633,600	
第344回利付国債(10年)	3,160,000,000	3,193,906,800	
第345回利付国債(10年)	5,090,000,000	5,141,867,100	
第346回利付国債(10年)	2,640,000,000	2,665,370,400	
第347回利付国債(10年)	3,450,000,000	3,480,981,000	
第348回利付国債(10年)	3,250,000,000	3,278,470,000	
第349回利付国債(10年)	4,190,000,000	4,223,729,500	
第350回利付国債(10年)	4,350,000,000	4,381,668,000	
第1回利付国債(30年)	76,000,000	99,018,880	
第2回利付国債(30年)	98,000,000	123,895,520	
第3回利付国債(30年)	117,000,000	147,006,990	
第4回利付国債(30年)	127,000,000	169,938,700	
第5回利付国債(30年)	108,000,000	135,928,800	
第6回利付国債(30年)	169,000,000	218,385,180	
第7回利付国債(30年)	164,000,000	210,713,760	
第8回利付国債(30年)	142,000,000	173,332,300	
第9回利付国債(30年)	116,000,000	135,119,120	
第10回利付国債(30年)	185,000,000	207,488,600	
第11回利付国債(30年)	137,000,000	165,809,730	
第12回利付国債(30年)	220,000,000	279,732,200	
第13回利付国債(30年)	205,000,000	257,904,350	
第14回利付国債(30年)	493,000,000	651,460,060	
第15回利付国債(30年)	346,000,000	463,511,980	
第16回利付国債(30年)	302,000,000	405,486,340	
第17回利付国債(30年)	327,000,000	434,864,220	
第18回利付国債(30年)	427,000,000	562,158,310	
第19回利付国債(30年)	303,000,000	399,638,820	
第20回利付国債(30年)	495,000,000	670,170,600	
第21回利付国債(30年)	379,000,000	501,182,020	
第22回利付国債(30年)	570,000,000	774,601,500	
第23回利付国債(30年)	554,000,000	753,600,660	
第24回利付国債(30年)	411,000,000	560,069,700	
第25回利付国債(30年)	742,000,000	986,355,440	
第26回利付国債(30年)	884,000,000	1,192,082,840	
第27回利付国債(30年)	860,000,000	1,178,363,400	

第28回利付国債（30年）	911,000,000	1,252,843,640	
第29回利付国債（30年）	1,050,000,000	1,429,743,000	
第30回利付国債（30年）	1,196,000,000	1,610,976,120	
第31回利付国債（30年）	1,278,000,000	1,701,605,880	
第32回利付国債（30年）	1,639,000,000	2,223,811,590	
第33回利付国債（30年）	2,014,000,000	2,615,904,040	
第34回利付国債（30年）	1,666,000,000	2,239,520,500	
第35回利付国債（30年）	2,089,000,000	2,724,285,790	
第36回利付国債（30年）	1,829,000,000	2,390,722,480	
第37回利付国債（30年）	1,967,000,000	2,534,853,230	
第38回利付国債（30年）	1,385,000,000	1,758,063,600	
第39回利付国債（30年）	1,280,000,000	1,655,923,200	
第40回利付国債（30年）	1,000,000,000	1,271,360,000	
第41回利付国債（30年）	1,070,000,000	1,336,076,900	
第42回利付国債（30年）	1,250,000,000	1,561,700,000	
第43回利付国債（30年）	1,180,000,000	1,475,082,600	
第44回利付国債（30年）	1,120,000,000	1,402,441,600	
第45回利付国債（30年）	1,340,000,000	1,613,762,000	
第46回利付国債（30年）	1,380,000,000	1,662,279,000	
第47回利付国債（30年）	1,720,000,000	2,116,976,000	
第48回利付国債（30年）	1,730,000,000	2,044,410,200	
第49回利付国債（30年）	1,480,000,000	1,749,034,400	
第50回利付国債（30年）	1,540,000,000	1,586,816,000	
第51回利付国債（30年）	1,650,000,000	1,488,580,500	
第52回利付国債（30年）	1,560,000,000	1,484,683,200	
第53回利付国債（30年）	1,380,000,000	1,347,225,000	
第54回利付国債（30年）	1,370,000,000	1,407,812,000	
第55回利付国債（30年）	1,400,000,000	1,437,184,000	
第56回利付国債（30年）	1,360,000,000	1,394,693,600	
第57回利付国債（30年）	1,560,000,000	1,598,126,400	
第58回利付国債（30年）	1,640,000,000	1,678,294,000	
第43回利付国債（20年）	74,000,000	76,783,880	
第44回利付国債（20年）	480,000,000	501,950,400	
第47回利付国債（20年）	114,000,000	119,962,200	
第48回利付国債（20年）	209,000,000	222,716,670	
第49回利付国債（20年）	515,000,000	546,615,850	
第51回利付国債（20年）	200,000,000	212,770,000	
第52回利付国債（20年）	214,000,000	229,444,380	
第54回利付国債（20年）	480,000,000	518,966,400	
第55回利付国債（20年）	241,000,000	260,164,320	
第56回利付国債（20年）	449,000,000	487,003,360	
第58回利付国債（20年）	147,000,000	159,606,720	



第59回利付国債(20年)	589,000,000	637,191,980
第61回利付国債(20年)	289,000,000	304,328,560
第63回利付国債(20年)	442,000,000	484,303,820
第64回利付国債(20年)	441,000,000	487,419,660
第65回利付国債(20年)	318,000,000	352,976,820
第66回利付国債(20年)	500,000,000	552,240,000
第68回利付国債(20年)	846,000,000	957,333,600
第70回利付国債(20年)	422,000,000	485,067,900
第71回利付国債(20年)	160,000,000	181,987,200
第72回利付国債(20年)	534,000,000	606,949,740
第73回利付国債(20年)	620,000,000	703,830,200
第74回利付国債(20年)	318,000,000	363,070,140
第75回利付国債(20年)	575,000,000	659,387,000
第76回利付国債(20年)	200,000,000	226,646,000
第77回利付国債(20年)	210,000,000	239,400,000
第78回利付国債(20年)	410,000,000	466,354,500
第79回利付国債(20年)	50,000,000	57,223,000
第80回利付国債(20年)	315,000,000	362,713,050
第81回利付国債(20年)	350,000,000	402,248,000
第82回利付国債(20年)	662,000,000	765,636,100
第83回利付国債(20年)	413,000,000	479,711,890
第84回利付国債(20年)	670,000,000	773,186,700
第85回利付国債(20年)	490,000,000	571,766,300
第86回利付国債(20年)	515,000,000	608,930,850
第87回利付国債(20年)	450,000,000	528,583,500
第88回利付国債(20年)	804,000,000	954,677,640
第89回利付国債(20年)	410,000,000	483,554,000
第90回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,302,510,000
第91回利付国債(20年)	468,000,000	558,024,480
第92回利付国債(20年)	1,432,000,000	1,690,017,760
第93回利付国債(20年)	390,000,000	458,503,500
第94回利付国債(20年)	615,000,000	728,399,850
第95回利付国債(20年)	1,017,000,000	1,227,132,540
第96回利付国債(20年)	320,000,000	380,368,000
第97回利付国債(20年)	343,000,000	412,498,660
第98回利付国債(20年)	470,000,000	560,893,300
第99回利付国債(20年)	1,345,000,000	1,610,597,150
第100回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,283,808,400
第101回利付国債(20年)	573,000,000	705,110,880
第102回利付国債(20年)	530,000,000	654,698,400
第103回利付国債(20年)	640,000,000	784,217,600
第104回利付国債(20年)	300,000,000	361,632,000

第105回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,233,557,400	
第106回利付国債(20年)	891,000,000	1,086,627,960	
第107回利付国債(20年)	567,000,000	687,873,060	
第108回利付国債(20年)	800,000,000	953,864,000	
第109回利付国債(20年)	800,000,000	956,440,000	
第110回利付国債(20年)	976,000,000	1,187,665,120	
第111回利付国債(20年)	711,000,000	875,113,020	
第112回利付国債(20年)	1,140,000,000	1,390,720,200	
第113回利付国債(20年)	1,782,000,000	2,180,401,740	
第114回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,252,335,600	
第115回利付国債(20年)	954,000,000	1,182,139,560	
第116回利付国債(20年)	546,000,000	678,557,880	
第117回利付国債(20年)	1,860,000,000	2,290,013,400	
第118回利付国債(20年)	776,000,000	948,900,560	
第119回利付国債(20年)	660,000,000	790,983,600	
第120回利付国債(20年)	1,010,000,000	1,186,588,400	
第121回利付国債(20年)	1,269,000,000	1,540,451,790	
第122回利付国債(20年)	760,000,000	913,406,000	
第123回利付国債(20年)	1,448,000,000	1,797,344,480	
第124回利付国債(20年)	800,000,000	983,184,000	
第125回利付国債(20年)	934,000,000	1,173,935,260	
第126回利付国債(20年)	640,000,000	787,910,400	
第127回利付国債(20年)	840,000,000	1,023,640,800	
第128回利付国債(20年)	1,424,000,000	1,739,145,440	
第129回利付国債(20年)	650,000,000	785,583,500	
第130回利付国債(20年)	1,012,000,000	1,225,521,880	
第131回利付国債(20年)	880,000,000	1,054,275,200	
第132回利付国債(20年)	1,187,000,000	1,424,530,570	
第133回利付国債(20年)	1,340,000,000	1,625,781,800	
第134回利付国債(20年)	885,000,000	1,075,673,250	
第135回利付国債(20年)	600,000,000	721,242,000	
第136回利付国債(20年)	800,000,000	950,952,000	
第137回利付国債(20年)	762,000,000	916,853,640	
第138回利付国債(20年)	750,000,000	882,030,000	
第139回利付国債(20年)	380,000,000	452,059,400	
第140回利付国債(20年)	2,127,000,000	2,563,290,240	
第141回利付国債(20年)	1,550,000,000	1,870,695,000	
第142回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,331,751,100	
第143回利付国債(20年)	1,560,000,000	1,863,186,000	
第144回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,297,197,000	
第145回利付国債(20年)	2,560,000,000	3,098,342,400	
第146回利付国債(20年)	2,310,000,000	2,799,535,200	

第147回利付国債(20年)	2,460,000,000	2,946,292,800	
第148回利付国債(20年)	2,360,000,000	2,793,815,200	
第149回利付国債(20年)	2,570,000,000	3,045,013,100	
第150回利付国債(20年)	2,440,000,000	2,853,311,600	
第151回利付国債(20年)	2,590,000,000	2,946,876,100	
第152回利付国債(20年)	2,590,000,000	2,947,264,600	
第153回利付国債(20年)	2,910,000,000	3,358,547,400	
第154回利付国債(20年)	2,540,000,000	2,888,589,600	
第155回利付国債(20年)	2,530,000,000	2,789,451,500	
第156回利付国債(20年)	2,180,000,000	2,178,190,600	
第157回利付国債(20年)	2,390,000,000	2,300,136,000	
第158回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,450,709,800	
第159回利付国債(20年)	2,070,000,000	2,128,436,100	
第160回利付国債(20年)	2,340,000,000	2,443,170,600	
第161回利付国債(20年)	2,190,000,000	2,243,523,600	
第162回利付国債(20年)	2,190,000,000	2,238,245,700	
第163回利付国債(20年)	2,080,000,000	2,122,577,600	
第164回利付国債(20年)	2,960,000,000	2,960,000,000	
第14回ポーランド共和国円貨債券(2013)	100,000,000	100,128,000	
国債証券 合計	416,506,000,000	453,016,540,920	
地方債証券			
第1回東京都公募公債(20年)	20,000,000	21,503,600	
第7回東京都公募公債(30年)	10,000,000	13,434,500	
第8回東京都公募公債(30年)	80,000,000	103,251,200	
第16回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,653,000	
第20回東京都公募公債(20年)	80,000,000	96,300,800	
第21回東京都公募公債(20年)	80,000,000	97,440,000	
第22回東京都公募公債(20年)	120,000,000	143,155,200	
第24回東京都公募公債(20年)	70,000,000	84,699,300	
第28回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,795,000	
第678回東京都公募公債	100,000,000	102,007,000	
第680回東京都公募公債	100,000,000	102,353,000	
第681回東京都公募公債	100,000,000	102,370,000	
第686回東京都公募公債	100,000,000	102,082,000	
第687回東京都公募公債	100,000,000	102,432,000	
第693回東京都公募公債	100,000,000	103,684,000	
第705回東京都公募公債	170,000,000	176,521,200	
第709回東京都公募公債	100,000,000	102,986,000	
第726回東京都公募公債	100,000,000	103,806,000	
第752回東京都公募公債	100,000,000	100,416,000	
第754回東京都公募公債	120,000,000	119,815,200	
第755回東京都公募公債	300,000,000	299,538,000	
第758回東京都公募公債	300,000,000	298,572,000	

第765回東京都公募公債	300,000,000	302,358,000	
第768回東京都公募公債	200,000,000	200,976,000	
第769回東京都公募公債	200,000,000	201,420,000	
平成21年度第12回北海道公募公債	100,000,000	102,085,000	
平成21年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,493,000	
平成22年度第8回北海道公募公債	100,000,000	102,179,000	
平成25年度第4回北海道公募公債	100,000,000	104,048,000	
平成25年度第7回北海道公募公債	150,000,000	155,853,000	
平成25年度第9回北海道公募公債	300,000,000	310,404,000	
平成27年度第1回北海道公募公債	100,000,000	102,344,000	
平成27年度第9回北海道公募公債	200,000,000	205,630,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,837,000	
第29回1号宮城県公募公債	100,000,000	103,406,000	
第2回神奈川県公募公債(20年)	80,000,000	90,788,800	
第2回神奈川県公募公債(30年)	80,000,000	111,205,600	
第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,182,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,345,000	
第165回神奈川県公募公債	54,660,000	55,587,033	
第171回神奈川県公募公債	100,000,000	102,392,000	
第191回神奈川県公募公債	100,000,000	103,185,000	
第226回神奈川県公募公債	300,000,000	301,446,000	
第228回神奈川県公募公債	200,000,000	200,974,000	
第5回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	121,481,000	
第11回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	235,998,000	
第331回大阪府公募公債	100,000,000	101,855,000	
第332回大阪府公募公債	71,600,000	73,180,212	
第343回大阪府公募公債	70,000,000	71,556,100	
第348回大阪府公募公債	10,000,000	10,356,000	
第351回大阪府公募公債	100,000,000	103,582,000	
第358回大阪府公募公債	56,000,000	57,934,240	
第359回大阪府公募公債	56,000,000	58,018,240	
第376回大阪府公募公債	106,000,000	110,308,900	
第385回大阪府公募公債	200,000,000	206,998,000	
第388回大阪府公募公債	400,000,000	411,712,000	
第389回大阪府公募公債	100,000,000	102,874,000	
第393回大阪府公募公債	110,000,000	112,827,000	
第418回大阪府公募公債	100,000,000	100,569,000	
平成21年度第5回京都府公募公債	20,000,000	20,395,400	
平成23年度第9回京都府公募公債	140,000,000	145,101,600	
平成24年度第3回京都府公募公債(20年)	200,000,000	234,004,000	
平成24年度第10回京都府公募公債	100,000,000	103,029,000	
平成25年度第2回京都府公募公債(15年)	100,000,000	108,360,000	

第1回兵庫県公募公債(18年)	200,000,000	222,980,000	
第2回兵庫県公募公債(30年)	40,000,000	52,927,200	
第4回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	110,346,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	110,848,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	108,725,000	
第15回兵庫県公募公債(20年)	300,000,000	350,040,000	
第16回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	117,703,000	
平成21年度第25回兵庫県公募公債	100,000,000	102,121,000	
平成27年度第6回兵庫県公募公債	200,000,000	206,602,000	
第3回静岡県公募公債(15年)	100,000,000	111,071,000	
平成21年度第4回静岡県公募公債	52,920,000	53,853,508	
平成22年度第1回静岡県公募公債	101,700,000	104,335,047	
平成22年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	102,380,000	
平成22年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	102,228,000	
平成25年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	102,650,000	
平成25年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	104,546,000	
平成25年度第8回静岡県公募公債	130,000,000	134,557,800	
平成27年度第3回静岡県公募公債	121,000,000	124,894,990	
平成27年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	103,495,000	
平成23年度第7回愛知県公募公債	100,000,000	103,337,000	
平成23年度第9回愛知県公募公債	100,000,000	103,225,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債	100,000,000	103,346,000	
平成23年度第17回愛知県公募公債	100,000,000	103,476,000	
平成24年度第13回愛知県公募公債	100,000,000	103,284,000	
平成24年度第14回愛知県公募公債(15年)	300,000,000	332,289,000	
平成26年度第9回愛知県公募公債	100,000,000	103,171,000	
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5回愛知県公募公債	100,000,000	103,227,000	
平成27年度第18回愛知県公募公債	100,000,000	100,910,000	
平成28年度第1回愛知県公募公債	100,000,000	99,805,000	
平成28年度第8回愛知県公募公債	108,000,000	107,518,320	
平成28年度第16回愛知県公募公債	100,000,000	101,017,000	
平成22年度第8回広島県公募公債	26,650,000	27,601,138	
平成23年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,386,000	
平成27年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,261,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	100,000,000	102,844,000	
平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	99,908,000	
第4回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	237,114,000	
平成21年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	101,905,000	
平成23年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,801,000	
平成23年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	103,609,000	
平成24年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	103,339,000	

平成26年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	101,736,000	
平成27年度第6回埼玉県公募公債	200,000,000	206,062,000	
平成29年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,908,000	
平成29年度第8回埼玉県公募公債	200,000,000	201,414,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	70,000,000	95,141,900	
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	80,000,000	103,971,200	
平成21年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	102,355,000	
平成22年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	102,336,000	
平成22年度第5回福岡県公募公債	20,000,000	20,426,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	111,381,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	102,433,000	
平成26年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	103,583,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,786,000	
第2回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	117,493,000	
第9回千葉県公募公債(20年)	80,000,000	94,777,600	
平成22年度第11回千葉県公募公債	80,000,000	82,542,400	
平成23年度第9回千葉県公募公債	20,000,000	20,726,200	
平成24年度第1回千葉県公募公債	20,000,000	20,781,000	
平成24年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	103,442,000	
平成25年度第1回千葉県公募公債	82,500,000	84,689,550	
平成25年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	103,377,000	
平成28年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	100,118,000	
平成28年度第8回千葉県公募公債	200,000,000	201,312,000	
平成29年度第1回千葉県公募公債	120,000,000	120,266,400	
平成29年度第3回千葉県公募公債	100,000,000	100,581,000	
平成21年度第1回新潟県公募公債	23,000,000	23,349,140	
平成28年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	100,381,000	
第15回群馬県公募公債	200,000,000	199,154,000	
平成28年度第1回岐阜県公募公債	100,000,000	99,459,000	
平成24年度第1回大分県公募公債	100,260,000	103,613,697	
第77回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,175,300	
第78回共同発行市場公募地方債	130,000,000	132,212,600	
第79回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,494,000	
第81回共同発行市場公募地方債	109,500,000	111,619,920	
第90回共同発行市場公募地方債	30,000,000	30,735,900	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,127,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,336,000	
第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,627,000	
第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,226,000	
第103回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,229,000	
第107回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,186,000	
第109回共同発行市場公募地方債	170,000,000	176,638,500	

第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,363,000	
第113回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,079,000	
第114回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,348,000	
第117回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,192,000	
第120回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,080,000	
第126回共同発行市場公募地方債	210,000,000	218,530,200	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,406,000	
第129回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,298,000	
第130回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,955,000	
第132回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,992,000	
第135回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,224,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,624,000	
第142回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,598,000	
第144回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,360,000	
第145回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,245,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,566,000	
第150回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,189,000	
第153回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,823,000	
第163回共同発行市場公募地方債	500,000,000	497,305,000	
第166回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,140,000	
第172回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,252,000	
第178回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,130,000	
平成24年度第2回堺市公募公債	200,000,000	206,136,000	
平成25年度第1回長崎県公募公債	200,000,000	208,134,000	
平成23年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	103,394,000	
平成25年度第1回栃木県公募公債	100,000,000	103,277,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債	50,000,000	51,667,500	
平成28年度第1回熊本市公募公債	100,000,000	99,576,000	
平成22年度第1回新潟市公募公債	54,980,000	56,599,710	
平成26年度第1回新潟市公募公債	100,000,000	102,531,000	
平成23年度第1回浜松市公募公債	38,200,000	39,524,012	
平成25年度第1回浜松市公募公債	161,000,000	167,419,070	
第1回大阪市公募公債（15年）	200,000,000	226,252,000	
第5回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	122,842,000	
平成21年度第6回大阪市公募公債	125,000,000	127,730,000	
平成23年度第10回大阪市公募公債	10,000,000	10,332,200	
平成26年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	103,322,000	
第1回名古屋市公募公債（12年）	100,000,000	106,657,000	
第1回名古屋市公募公債（20年）	200,000,000	221,294,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	400,000,000	477,572,000	
第10回名古屋市公募公債（20年）	80,000,000	97,594,400	
第477回名古屋市公募公債	100,000,000	103,497,000	

第1回京都市公募公債(20年)	200,000,000	226,810,000	
第5回京都市公募公債(20年)	50,000,000	59,349,500	
平成23年度第2回京都市公募公債	100,000,000	103,226,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,329,000	
平成20年度第24回神戸市公募公債(20年)	300,000,000	357,750,000	
平成22年度第4回神戸市公募公債	100,000,000	119,081,000	
平成22年度第9回神戸市公募公債(20年)	80,000,000	97,423,200	
平成29年度第6回神戸市公募公債	300,000,000	301,647,000	
第7回横浜市公募公債(20年)	200,000,000	229,378,000	
第17回横浜市公募公債(20年)	80,000,000	95,317,600	
第20回横浜市公募公債(20年)	80,000,000	96,342,400	
平成24年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	103,627,000	
第25回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	118,197,000	
平成27年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	206,840,000	
第27回横浜市公募公債(20年)	60,000,000	70,166,400	
平成21年度第5回札幌市公募公債	112,000,000	113,843,520	
平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)	80,000,000	104,989,600	
平成27年度第9回札幌市公募公債	100,000,000	100,743,000	
第3回川崎市公募公債(15年)	100,000,000	104,454,000	
第44回川崎市公募公債(5年)	130,400,000	130,741,648	
第82回川崎市公募公債	100,000,000	101,844,000	
第17回北九州市公募公債(20年)	100,000,000	116,352,000	
平成25年度第3回北九州市公募公債	300,000,000	311,250,000	
平成22年度第9回福岡市公募公債	106,500,000	110,271,165	
平成23年度第6回福岡市公募公債	100,000,000	103,237,000	
平成24年度第4回福岡市公募公債	200,000,000	206,690,000	
平成25年度第4回福岡市公募公債	50,000,000	51,702,000	
平成26年度第6回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	113,937,000	
平成25年度第2回広島市公募公債	100,000,000	103,707,000	
平成22年度第2回千葉市公募公債	100,000,000	102,068,000	
平成24年度第1回相模原市公募公債	200,000,000	206,094,000	
平成22年度第1回三重県公募公債	87,050,000	89,221,027	
平成23年度第1回三重県公募公債	98,410,000	101,753,971	
平成24年度第4回福井県公募公債	100,000,000	102,076,000	
平成27年度第4回福井県公募公債	200,000,000	199,688,000	
平成23年度第1回徳島県公募公債	100,000,000	103,394,000	
平成26年度第1回徳島県公募公債	100,000,000	102,752,000	
平成24年度第1回山梨県公募公債	200,000,000	206,678,000	
平成26年度第1回岡山市公募公債	100,000,000	101,705,000	
平成28年度第1回岡山市公募公債	100,000,000	100,381,000	
平成28年度第1回秋田県公募公債	100,000,000	100,526,000	
第4回京都市保証京都市土地開発公社債券	200,000,000	199,762,000	



	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	120,926,000	
	第132回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	102,797,000	
地方債証券 合計		29,323,330,000	30,928,929,558	
特殊債券	第7回政府保証日本政策投資銀行	100,000,000	102,367,000	
	第19回政府保証日本政策投資銀行	400,000,000	413,196,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行	20,000,000	20,771,000	
	第39回政府保証日本政策投資銀行	106,000,000	106,604,200	
	第47回政府保証日本政策投資銀行	1,100,000,000	1,101,089,000	
	第78回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	200,000,000	200,878,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	20,000,000	23,551,600	
	第9回道路債券(財投機関債)	100,000,000	133,626,000	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	600,000,000	707,346,000	
	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	44,981,400	
	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	147,106,000	
	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	188,558,500	
	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	119,745,000	
	第28回道路債券(財投機関債)	400,000,000	540,576,000	
	第33回道路債券(財投機関債)	200,000,000	274,192,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	300,000,000	364,848,000	
	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	184,227,000	
	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	60,617,500	
	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	241,166,000	
	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	59,996,500	
	第85回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,576,000	
	第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	179,000,000	182,025,100	
	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	117,591,000	
	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	120,990,000	
	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	121,087,000	
	第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	139,000,000	141,586,790	
	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	214,494,000	

第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	132,753,000	
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	51,156,000	
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	307,953,000	
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	121,635,000	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	444,000,000	455,948,040	
第112回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	141,000,000	144,361,440	
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	102,346,000	
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	306,588,000	
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	409,104,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	71,000,000	73,201,710	
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	121,307,000	
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	415,216,000	
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	94,031,210	
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	683,212,200	
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	126,022,340	
第145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	231,856,000	
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	103,465,000	
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	238,816,000	
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	140,836,160	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券 （財投機関債）	100,000,000	125,827,000	
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	219,301,280	
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	112,804,100	
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,872,000	
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	118,945,000	
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	248,078,000	
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	12,445,920	

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	311,914,260	
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	103,706,000	
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	103,303,000	
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	114,651,000	
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	157,196,790	
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	104,552,000	
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	233,594,730	
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	104,325,000	
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	207,556,000	
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	230,309,460	
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	103,602,000	
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	115,047,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,324,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,931,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,975,000	
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	204,994,000	
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,426,000	
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,538,000	
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	132,808,000	
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	100,803,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,546,000	
第344回政府保証道路債券	100,000,000	103,362,000	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）	300,000,000	305,955,000	
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	60,734,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	25,000,000	25,375,500	
第2回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	80,000,000	81,198,400	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,508,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）	400,000,000	407,276,000	
第3回公営企業債券（20年）（財投機関債）	20,000,000	20,926,600	

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	109,496,000	
第4回政府保証公営企業債券(15年)	100,000,000	107,772,000	
第5回政府保証公営企業債券(15年)	300,000,000	327,090,000	
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	100,000,000	110,654,000	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,100,000	
第9回政府保証地方公共団体金融機構債券	149,000,000	152,508,950	
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	50,000,000	56,942,000	
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,290,000	
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	100,000,000	121,455,000	
第13回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	102,488,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,340,000	
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	98,422,400	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,301,000	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	200,000,000	201,084,000	
第16回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	102,538,000	
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	95,192,800	
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	119,405,000	
第19回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	50,000,000	51,566,000	
第20回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	103,254,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	30,000,000	31,087,200	
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	234,922,000	
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	352,158,000	
F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	70,000,000	75,383,000	
第25回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,672,000	
第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	50,000,000	59,549,000	
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	21,000,000	21,720,930	
第30回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	300,000,000	310,146,000	
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	50,000,000	51,972,000	
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,683,000	
第39回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,444,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	17,000,000	17,561,510	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	36,000,000	37,110,240	
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	160,000,000	166,168,000	
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,577,000	
F77回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	200,000,000	222,494,000	
第77回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	102,737,000	
第89回政府保証地方公共団体金融機構債券	203,000,000	201,987,030	

F 8 9 回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	300,000,000	338,568,000	
第9 4 回政府保証地方公共団体金融機構債券	104,000,000	104,592,800	
第9 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	114,000,000	114,555,180	
第9 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,712,000	
第9 9 回政府保証地方公共団体金融機構債券	400,000,000	402,172,000	
第1 0 0 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,954,000	
F 1 2 3 回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	114,927,000	
F 1 2 4 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	221,890,000	
F 1 3 1 回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	115,120,000	
F 1 4 7 回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	150,000,000	164,550,000	
F 1 9 7 回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	500,000,000	539,820,000	
F 2 2 6 回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	108,686,000	
第2 回政府保証公営企業債券(15年)	100,000,000	106,001,000	
第5 回政府保証日本政策金融公庫債券	123,000,000	125,019,660	
第1 0 回日本政策金融公庫(財投機関債)	80,000,000	97,091,200	
第1 5 回日本政策金融公庫(財投機関債)	80,000,000	95,172,000	
第2 5 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	103,950,000	
第2 7 回政府保証日本政策金融公庫債券	200,000,000	200,936,000	
第3 7 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,885,000	
第7 8 回都市再生債券(財投機関債)	400,000,000	443,716,000	
第2 1 1 回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,447,000	
第1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,759,000	17,597,452	
第1 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,859,000	17,812,039	
第2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,058,000	19,092,542	
第2 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,235,000	18,326,664	
第4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,717,000	18,755,570	
第5 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,834,000	15,383,451	
第6 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,481,000	16,340,195	
第6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,299,000	18,194,050	
第6 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,890,000	18,878,422	
第6 回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	200,000,000	240,408,000	
第7 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,573,000	16,431,383	
第8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,532,000	11,712,706	
第8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,802,000	19,796,249	
第9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,134,000	11,288,651	
第9 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	16,306,000	17,230,061	
第9 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,168,000	20,398,585	
第1 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,166,000	24,583,105	
第1 0 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	16,817,000	17,784,145	

第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,955,000	21,138,131	
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,551,000	12,819,465	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,854,000	20,397,403	
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	22,385,000	23,115,422	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	22,689,000	23,477,896	
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	68,655,000	70,788,797	
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,353,000	14,831,385	
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,906,000	15,595,551	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,532,000	61,437,846	
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,033,000	15,476,924	
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,454,000	34,659,347	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,137,000	18,829,107	
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,976,000	37,388,644	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,028,000	39,412,603	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,674,000	39,979,272	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,583,000	18,370,190	
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,350,000	42,565,618	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,886,000	17,600,277	
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	361,515,000	
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,522,000	44,500,548	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,423,000	19,423,184	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,599,000	17,547,466	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,705,000	51,652,139	
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,110,000	51,396,875	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,923,000	43,583,813	
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,118,000	39,642,024	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	115,323,000	123,206,480	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,745,000	40,112,366	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,195,000	40,457,671	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,450,000	17,360,343	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,391,000	43,879,840	
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,295,000	46,775,520	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,361,000	48,931,253	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,838,000	53,627,481	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	151,506,000	159,938,823	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,805,000	54,712,296	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,126,000	56,901,040	
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,691,000	58,297,338	
第62回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	50,000,000	60,887,500	
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,159,000	57,464,094	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,856,000	60,339,758	

第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,020,000	55,576,624	
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,986,000	62,163,575	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	80,000,000	97,208,800	
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	362,593,000	379,442,696	
第77回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	30,000,000	33,802,200	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,397,000	56,620,205	
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	117,646,000	122,495,368	
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,190,000	60,600,229	
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,887,000	63,334,657	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	122,874,000	127,639,053	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	125,330,000	130,286,801	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	100,000,000	119,289,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,821,000	69,241,924	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	201,924,000	208,353,260	
第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	137,060,000	141,207,435	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,661,000	71,372,570	
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,662,000	148,023,181	
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	244,803,000	252,093,233	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	245,616,000	254,445,895	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,564,000	170,282,599	
第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	100,000,000	119,994,000	
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	425,925,000	440,397,931	
第105回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	600,000,000	668,214,000	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	281,247,000	282,644,797	
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	285,228,000	287,983,302	
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	170,258,400	
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	118,943,000	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	584,514,000	587,512,556	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,213,000	98,722,725	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,722,000	99,511,776	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,176,000	99,657,995	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,890,000	199,466,781	
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,602,000	200,166,873	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,870,000	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,232,000	
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	205,248,000	
第203回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1,100,000,000	1,105,764,000	

	第6回沖縄振興開発金融公庫債券(財投機関債)	50,000,000	56,690,000	
	い第773号商工債券	100,000,000	100,133,000	
	い第775号商工債券	600,000,000	600,900,000	
	い第776号商工債券	100,000,000	100,111,000	
	い第781号商工債券	100,000,000	100,260,000	
	い第774号農林債券	100,000,000	100,277,000	
	第304回信金中金債	200,000,000	200,648,000	
	第310回信金中金債	200,000,000	200,696,000	
	第311回信金中金債	200,000,000	200,746,000	
	第315回信金中金債	200,000,000	200,026,000	
	第322回信金中金債	400,000,000	399,212,000	
	第325回信金中金債	100,000,000	99,825,000	
	第327回信金中金債	200,000,000	199,780,000	
	第332回信金中金債	300,000,000	299,754,000	
	第336回信金中金債	200,000,000	199,910,000	
	第338回信金中金債	200,000,000	200,000,000	
	第11号商工債券(10年)	100,000,000	102,518,000	
	第17回韓国輸出入銀行	100,000,000	100,009,000	
	第18回韓国輸出入銀行	100,000,000	100,024,000	
	第7回国際協力機構債券(財投機関債)	70,000,000	84,405,300	
	第11回国際協力機構債券(財投機関債)	30,000,000	31,149,300	
	第39回東日本高速道路	300,000,000	299,685,000	
	第33回中日本高速道路	50,000,000	51,641,500	
	第27回西日本高速道路	200,000,000	206,042,000	
	第29回西日本高速道路	400,000,000	404,372,000	
	第30回西日本高速道路	300,000,000	299,763,000	
特殊債券 合計		36,942,323,000	39,332,042,171	
社債券	第14回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	202,554,000	
	第19回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	209,348,000	
	第5回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	100,000,000	100,358,000	
	第7回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	100,000,000	100,474,000	
	第12回新関西国際空港	300,000,000	325,722,000	
	第347回東京交通債券	100,000,000	110,928,000	
	第38回関西国際空港	50,000,000	51,821,500	
	第18回成田国際空港	100,000,000	102,913,000	
	第15回GEキャピタルコーポレーション	100,000,000	104,890,000	
	第9回ナショナル・オーストラリア銀行	100,000,000	100,195,000	
	第11回ナショナル・オーストラリア銀行	100,000,000	100,217,000	
	第8回オーストラリア・コモンウェルス銀行	300,000,000	300,708,000	
	第9回ラボバンク・ネダーランド	100,000,000	104,164,000	
	第23回ラボバンク・ネダーランド	100,000,000	100,229,000	
	第27回ラボバンク・ネダーランド	100,000,000	100,456,000	



第7回大和ハウス工業	200,000,000	199,536,000	
第5回日揮	200,000,000	200,230,000	
第7回明治ホールディングス	100,000,000	100,013,000	
第10回アサヒグループホールディングス	100,000,000	100,107,000	
第11回アサヒグループホールディングス	100,000,000	100,219,000	
第3回コカ・コーラウエスト	300,000,000	304,641,000	
第24回味の素	100,000,000	100,112,000	
第6回J・フロント リテイリング	200,000,000	201,096,000	
第4回トヨタ紡織	300,000,000	299,946,000	
第22回森ビル	200,000,000	200,160,000	
第11回セブン&アイ・ホールディングス	300,000,000	303,330,000	
第31回東レ	100,000,000	100,269,000	
第4回野村総合研究所	100,000,000	100,021,000	
第3回富士フイルムホールディングス	100,000,000	103,214,000	
第4回富士フイルムホールディングス	500,000,000	499,275,000	
第9回資生堂	100,000,000	99,853,000	
第23回ジェイ エフ イー ホールディングス	300,000,000	299,265,000	
第1回リクルートホールディングス	300,000,000	299,802,000	
第19回豊田自動織機	100,000,000	103,164,000	
第5回日本電産	300,000,000	299,661,000	
第15回パナソニック	300,000,000	300,549,000	
第12回デンソー	100,000,000	99,692,000	
第18回デンソー	200,000,000	200,188,000	
第29回三菱重工業	300,000,000	307,629,000	
第1回日本生命2012基金	100,000,000	100,083,000	
第1回明治安田生命2014基金	100,000,000	100,323,000	
第7回JA三井リース	200,000,000	199,724,000	
第9回JA三井リース	100,000,000	100,123,000	
第1回日本生命2015基金	100,000,000	100,234,000	
第1回日本生命2017基金	100,000,000	100,111,000	
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	200,320,000	
第13回アイシン精機	100,000,000	103,557,000	
第20回ニコン	100,000,000	101,676,000	
第78回三菱商事	100,000,000	103,614,000	
第8回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)	100,000,000	104,656,000	
第9回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)	100,000,000	114,376,000	
第28回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	100,000,000	103,573,000	
第30回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	100,000,000	121,673,000	
第57回三菱東京UFJ銀行	200,000,000	218,226,000	
第6回住友信託銀行(劣後特約付)	100,000,000	118,152,000	
第8回三井住友信託銀行(社債間限定同順位特約付)	500,000,000	501,040,000	

第13回住友信託銀行(劣後特約付)	100,000,000	114,971,000	
第22回三井住友銀行(劣後特約付)	100,000,000	102,856,000	
第23回三井住友銀行(劣後特約付)	100,000,000	103,576,000	
第25回三井住友銀行(劣後特約付)	200,000,000	227,788,000	
第5回みずほ銀行(劣後特約付)	100,000,000	115,519,000	
第9回みずほ銀行(劣後特約付)	100,000,000	117,767,000	
第18回みずほ銀行(劣後特約付)	100,000,000	113,676,000	
第13回芙蓉総合リース	200,000,000	200,158,000	
第20回東京センチュリーリース	100,000,000	99,817,000	
第23回東京センチュリーリース	100,000,000	100,034,000	
第29回ホンダファイナンス	200,000,000	201,690,000	
第38回ホンダファイナンス	300,000,000	299,121,000	
第77回トヨタファイナンス	200,000,000	200,060,000	
第23回リコーリース	200,000,000	199,334,000	
第30回リコーリース	200,000,000	200,192,000	
第47回日立キャピタル	100,000,000	102,833,000	
第52回日立キャピタル	200,000,000	201,360,000	
第62回日立キャピタル	300,000,000	299,574,000	
第188回オリックス	100,000,000	99,861,000	
第36回三菱UFJリース	100,000,000	100,647,000	
第41回三菱UFJリース	200,000,000	199,338,000	
第48回三菱UFJリース	100,000,000	99,918,000	
第27回野村ホールディングス	100,000,000	112,678,000	
第50回野村ホールディングス	200,000,000	200,304,000	
第58回三井不動産	300,000,000	300,099,000	
第105回三菱地所	100,000,000	103,718,000	
第116回三菱地所	100,000,000	102,552,000	
第120回三菱地所	100,000,000	99,757,000	
第125回三菱地所	300,000,000	299,646,000	
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発	100,000,000	103,042,000	
第17回エヌ・ティ・ティ都市開発	100,000,000	101,912,000	
第36回京王電鉄	100,000,000	100,200,000	
第38回京王電鉄	100,000,000	100,112,000	
第19回東日本旅客鉄道	100,000,000	108,405,000	
第26回東日本旅客鉄道	100,000,000	104,940,000	
第39回東日本旅客鉄道	500,000,000	566,070,000	
第83回東日本旅客鉄道	100,000,000	112,099,000	
第100回東日本旅客鉄道	100,000,000	125,495,000	
第9回西日本旅客鉄道	123,000,000	133,161,030	
第9回東海旅客鉄道	100,000,000	107,034,000	
第11回東海旅客鉄道	100,000,000	104,761,000	
第53回東海旅客鉄道	100,000,000	117,317,000	

第56回東海旅客鉄道	100,000,000	121,493,000	
第74回東海旅客鉄道	100,000,000	118,685,000	
第8回東京地下鉄	200,000,000	239,070,000	
第11回東京地下鉄	100,000,000	103,849,000	
第16回三菱倉庫	200,000,000	199,964,000	
第5回関西高速鉄道	100,000,000	102,439,000	
第8回関西高速鉄道	200,000,000	206,802,000	
第63回日本電信電話	100,000,000	102,466,000	
第21回KDDI	100,000,000	102,085,000	
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	100,000,000	102,839,000	
第534回東京電力	100,000,000	102,536,000	
第559回東京電力	60,000,000	60,975,600	
第563回東京電力	100,000,000	102,251,000	
第567回東京電力	100,000,000	112,706,000	
第568回東京電力	100,000,000	102,018,000	
第490回中部電力	70,000,000	71,070,300	
第499回中部電力	50,000,000	52,522,500	
第500回中部電力	100,000,000	103,762,000	
第518回中部電力	200,000,000	200,136,000	
第496回関西電力	100,000,000	103,903,000	
第499回関西電力	200,000,000	205,100,000	
第508回関西電力	200,000,000	201,034,000	
第510回関西電力	100,000,000	100,832,000	
第512回関西電力	200,000,000	200,186,000	
第381回中国電力	100,000,000	104,101,000	
第385回中国電力	100,000,000	103,146,000	
第402回中国電力	200,000,000	199,936,000	
第304回北陸電力	100,000,000	104,136,000	
第307回北陸電力	100,000,000	105,857,000	
第310回北陸電力	200,000,000	206,566,000	
第322回北陸電力	200,000,000	200,522,000	
第481回東北電力	200,000,000	207,120,000	
第490回東北電力	100,000,000	100,069,000	
第494回東北電力	100,000,000	100,478,000	
第253回四国電力	100,000,000	104,033,000	
第371回九州電力	100,000,000	105,524,000	
第429回九州電力	200,000,000	207,602,000	
第430回九州電力	100,000,000	101,410,000	
第437回九州電力	100,000,000	102,701,000	
第310回北海道電力	50,000,000	51,453,500	
第316回北海道電力	400,000,000	408,536,000	
第319回北海道電力	200,000,000	201,160,000	

第344回北海道電力	200,000,000	199,872,000	
第19回沖縄電力	80,000,000	82,058,400	
第38回電源開発	100,000,000	104,009,000	
第39回電源開発	100,000,000	103,771,000	
第40回電源開発	200,000,000	207,442,000	
第4回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,146,000	
第6回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,577,000	
第7回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,414,000	
第13回東京電力パワーグリッド	200,000,000	200,774,000	
第23回東京ガス	200,000,000	208,974,000	
第3回ファーストリテイリング	100,000,000	101,188,000	
第4回ファーストリテイリング	100,000,000	103,189,000	
社債券 合計	22,883,000,000	23,579,291,830	
合計	505,654,653,000	546,856,804,479	

## 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30年 6月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	397,232,932
コール・ローン	152,558,523
国債証券	116,303,640,910
派生商品評価勘定	11,620
未収利息	897,946,073
前払費用	37,585,312
流動資産合計	117,788,975,370
資産合計	117,788,975,370
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	92,730
未払解約金	68,332,817
未払利息	323
流動負債合計	68,425,870
負債合計	68,425,870
純資産の部	
元本等	
元本	58,941,525,763

[平成30年 6月25日現在]

剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	58,779,023,737
元本等合計	117,720,549,500
純資産合計	117,720,549,500
負債純資産合計	117,788,975,370

## 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 「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30年 6月25日現在]
1. 期首	平成29年 8月16日
期首元本額	62,650,873,283円
期中追加設定元本額	10,305,048,123円
期中一部解約元本額	14,014,395,643円
元本の内訳	
ファンド・マネジャー（海外債券）	983,941,207円
eMAXIS 先進国債券インデックス	7,930,291,684円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,671,464,741円
eMAXIS バランス（波乗り型）	243,133,482円
コアバランス	1,316,874円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	5,037,549円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	4,606,058円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	3,332,089円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	995,319,323円
海外債券セレクション（ラップ向け）	1,095,012,960円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	801,593,086円
つみたて8資産均等バランス	107,648,793円
つみたて4資産均等バランス	23,007,422円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	519,060円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	146,472円

	[平成30年 6月25日現在]
eMAXIS マイマネージャー 1990s	31,119円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	325,570円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	282,087円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	278,180円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	8,083,925,728円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	122,902,156円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	93,840,136円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	55,270,007円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	82,534,690円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	11,346,153円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	6,672,244円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	64,484,983円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	2,989,302,218円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	1,924,050,211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)	21,853,269,460円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)	912,093,450円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投資家限定)	43,464,264円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	10,047,125円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定)	103,073,791円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	28,141,003円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	2,482,130,684円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	115,021,465円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	155,692,001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)	93,868,823円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	9,959,998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)	274,374,749円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	2,926,855円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	6,121,654円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	5,879,624円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	2,768,285円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	55,712,368円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	44,898,540円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	75,411,952円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	62,633,780円

	[平成30年 6月25日現在]
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	110,913,079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）	1,818,694,229円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,996,707,523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）	222,433,027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）	581,781,861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）	420,764,219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）	151,125,672円
合計	58,941,525,763円
2. 受益権の総数	58,941,525,763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29年 8月16日 至 平成30年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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30年 6月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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30年 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	166,565,962
合計	166,565,962

(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30年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	24,205,500		24,129,600	75,900
	イギリスポンド	4,377,330		4,360,500	16,830
	ユーロ	21,716,888		21,727,700	10,812
	売建				
	アメリカドル	4,387,040		4,386,800	240
イギリスポンド	2,907,108		2,907,000	108	
ユーロ	5,112,860		5,112,400	460	
	合計	62,706,726		62,624,000	81,110



## （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30年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	1.9972円
(1万口当たり純資産額)	(19,972円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
アメリカ ドル	国債証券	0.75 T-NOTE 190715	3,000,000.00	2,948,789.06	
		0.75 T-NOTE 190815	2,300,000.00	2,256,964.84	
		0.875 T-NOTE 190615	1,600,000.00	1,577,312.49	
		0.875 T-NOTE 190731	700,000.00	688,515.62	
		0.875 T-NOTE 190915	3,200,000.00	3,140,374.99	
		1 T-NOTE 190630	1,100,000.00	1,085,003.90	
		1 T-NOTE 190831	600,000.00	590,085.93	
		1 T-NOTE 190930	1,200,000.00	1,178,203.12	
		1 T-NOTE 191015	1,400,000.00	1,373,585.93	

1 T-NOTE 191115	2,500,000.00	2,449,511.71
1 T-NOTE 191130	1,500,000.00	1,468,828.12
1.125 T-NOTE 190531	1,100,000.00	1,087,667.96
1.125 T-NOTE 191231	1,600,000.00	1,567,312.49
1.125 T-NOTE 200331	1,300,000.00	1,268,414.06
1.125 T-NOTE 200430	1,500,000.00	1,461,796.87
1.125 T-NOTE 210228	2,600,000.00	2,499,046.87
1.125 T-NOTE 210630	2,000,000.00	1,911,250.00
1.125 T-NOTE 210731	1,600,000.00	1,526,875.00
1.125 T-NOTE 210831	2,200,000.00	2,095,843.75
1.125 T-NOTE 210930	2,100,000.00	1,997,789.06
1.25 T-NOTE 190630	2,500,000.00	2,472,167.96
1.25 T-NOTE 190831	1,000,000.00	986,289.06
1.25 T-NOTE 191031	1,200,000.00	1,180,546.87
1.25 T-NOTE 200131	1,600,000.00	1,568,625.00
1.25 T-NOTE 200229	1,350,000.00	1,321,681.63
1.25 T-NOTE 210331	1,000,000.00	963,046.87
1.25 T-NOTE 211031	2,000,000.00	1,907,812.50
1.25 T-NOTE 230731	1,800,000.00	1,668,515.62
1.375 T-NOTE 190930	2,800,000.00	2,762,046.87
1.375 T-NOTE 191215	3,100,000.00	3,050,230.46
1.375 T-NOTE 200115	300,000.00	294,785.15
1.375 T-NOTE 200131	1,150,000.00	1,129,695.31
1.375 T-NOTE 200215	1,500,000.00	1,472,402.34
1.375 T-NOTE 200229	2,000,000.00	1,962,187.50
1.375 T-NOTE 200331	3,250,000.00	3,185,000.00
1.375 T-NOTE 200430	2,000,000.00	1,958,125.00
1.375 T-NOTE 200531	1,700,000.00	1,662,281.25
1.375 T-NOTE 200831	1,400,000.00	1,364,343.75
1.375 T-NOTE 200915	800,000.00	779,218.74
1.375 T-NOTE 200930	1,900,000.00	1,849,531.25
1.375 T-NOTE 201031	2,550,000.00	2,478,878.90
1.375 T-NOTE 210131	2,200,000.00	2,131,078.12
1.375 T-NOTE 210430	2,400,000.00	2,316,937.50
1.375 T-NOTE 210531	2,400,000.00	2,313,562.50
1.375 T-NOTE 230630	2,100,000.00	1,961,859.37
1.375 T-NOTE 230831	2,150,000.00	2,003,027.34
1.375 T-NOTE 230930	2,100,000.00	1,953,820.31
1.5 T-NOTE 190531	2,300,000.00	2,282,121.09
1.5 T-NOTE 191031	2,200,000.00	2,171,898.43
1.5 T-NOTE 191130	2,900,000.00	2,859,785.15
1.5 T-NOTE 200415	1,750,000.00	1,717,939.45

1.5 T-NOTE 200531	2,000,000.00	1,960,312.50
1.5 T-NOTE 200615	2,600,000.00	2,547,289.06
1.5 T-NOTE 200815	2,000,000.00	1,955,390.62
1.5 T-NOTE 220131	2,300,000.00	2,204,226.56
1.5 T-NOTE 230228	2,300,000.00	2,172,242.18
1.5 T-NOTE 230331	3,250,000.00	3,066,171.87
1.5 T-NOTE 260815	4,250,000.00	3,822,675.78
1.625 T-NOTE 190630	4,250,000.00	4,218,457.03
1.625 T-NOTE 190731	1,200,000.00	1,190,015.62
1.625 T-NOTE 190831	2,500,000.00	2,476,660.15
1.625 T-NOTE 191231	1,900,000.00	1,875,359.37
1.625 T-NOTE 200315	2,800,000.00	2,757,234.37
1.625 T-NOTE 200630	1,900,000.00	1,865,265.62
1.625 T-NOTE 200731	2,200,000.00	2,157,375.00
1.625 T-NOTE 201015	1,200,000.00	1,173,984.37
1.625 T-NOTE 201130	1,900,000.00	1,856,062.50
1.625 T-NOTE 220815	1,700,000.00	1,625,492.18
1.625 T-NOTE 220831	5,100,000.00	4,874,484.37
1.625 T-NOTE 221115	1,300,000.00	1,239,417.96
1.625 T-NOTE 230430	2,450,000.00	2,322,523.43
1.625 T-NOTE 230531	1,500,000.00	1,420,312.50
1.625 T-NOTE 231031	1,500,000.00	1,412,460.93
1.625 T-NOTE 260215	3,700,000.00	3,382,609.37
1.625 T-NOTE 260515	3,150,000.00	2,871,175.78
1.75 T-NOTE 190930	2,300,000.00	2,279,156.25
1.75 T-NOTE 201031	2,200,000.00	2,157,375.00
1.75 T-NOTE 201115	2,200,000.00	2,156,773.43
1.75 T-NOTE 201231	1,600,000.00	1,566,375.00
1.75 T-NOTE 211130	3,500,000.00	3,391,445.31
1.75 T-NOTE 220228	1,900,000.00	1,835,726.56
1.75 T-NOTE 220331	2,100,000.00	2,026,992.18
1.75 T-NOTE 220430	1,100,000.00	1,060,640.62
1.75 T-NOTE 220515	1,400,000.00	1,349,414.06
1.75 T-NOTE 220531	1,700,000.00	1,637,843.75
1.75 T-NOTE 220630	5,450,000.00	5,245,625.00
1.75 T-NOTE 220930	1,800,000.00	1,727,578.12
1.75 T-NOTE 230131	2,700,000.00	2,581,875.00
1.75 T-NOTE 230515	3,050,000.00	2,907,031.25
1.875 T-NOTE 200630	2,420,000.00	2,387,575.78
1.875 T-NOTE 201215	3,200,000.00	3,144,124.99
1.875 T-NOTE 211130	2,300,000.00	2,238,367.18
1.875 T-NOTE 220131	2,550,000.00	2,476,886.71
1.875 T-NOTE 220228	2,100,000.00	2,038,148.43

1.875 T-NOTE 220331	2,450,000.00	2,375,542.96
1.875 T-NOTE 220430	400,000.00	387,531.25
1.875 T-NOTE 220531	2,000,000.00	1,936,093.75
1.875 T-NOTE 220731	3,000,000.00	2,898,750.00
1.875 T-NOTE 220831	1,500,000.00	1,448,203.12
1.875 T-NOTE 220930	2,000,000.00	1,929,687.50
1.875 T-NOTE 221031	2,700,000.00	2,603,179.68
1.875 T-NOTE 240831	2,200,000.00	2,081,750.00
2 T-NOTE 200731	1,400,000.00	1,383,703.12
2 T-NOTE 200930	1,600,000.00	1,579,250.00
2 T-NOTE 201130	1,100,000.00	1,084,273.43
2 T-NOTE 210115	2,900,000.00	2,855,707.02
2 T-NOTE 210228	1,300,000.00	1,278,671.87
2 T-NOTE 210531	1,700,000.00	1,668,789.06
2 T-NOTE 210831	1,850,000.00	1,811,482.42
2 T-NOTE 211031	1,700,000.00	1,662,148.43
2 T-NOTE 211115	2,650,000.00	2,590,685.54
2 T-NOTE 211231	2,750,000.00	2,684,902.34
2 T-NOTE 220215	2,200,000.00	2,145,859.37
2 T-NOTE 220731	1,200,000.00	1,165,406.25
2 T-NOTE 221031	2,000,000.00	1,938,281.25
2 T-NOTE 221130	2,700,000.00	2,615,414.06
2 T-NOTE 230215	3,050,000.00	2,948,968.75
2 T-NOTE 240430	1,500,000.00	1,433,554.68
2 T-NOTE 240531	1,000,000.00	954,453.12
2 T-NOTE 240630	1,600,000.00	1,526,875.00
2 T-NOTE 250215	3,600,000.00	3,414,937.50
2 T-NOTE 250815	3,050,000.00	2,880,343.75
2 T-NOTE 261115	5,150,000.00	4,807,605.46
2.125 T-NOTE 200831	1,900,000.00	1,881,445.31
2.125 T-NOTE 210131	1,610,000.00	1,589,749.21
2.125 T-NOTE 210630	2,050,000.00	2,018,449.21
2.125 T-NOTE 210815	500,000.00	491,660.15
2.125 T-NOTE 210930	2,200,000.00	2,161,500.00
2.125 T-NOTE 211231	4,060,000.00	3,981,337.50
2.125 T-NOTE 220630	1,800,000.00	1,757,953.12
2.125 T-NOTE 221231	1,650,000.00	1,605,527.34
2.125 T-NOTE 231130	1,700,000.00	1,641,429.68
2.125 T-NOTE 240229	1,350,000.00	1,301,062.50
2.125 T-NOTE 240331	1,900,000.00	1,829,937.50
2.125 T-NOTE 240731	1,750,000.00	1,680,820.31
2.125 T-NOTE 240930	2,250,000.00	2,157,890.62

2.125 T-NOTE 241130	1,900,000.00	1,819,695.31
2.125 T-NOTE 250515	4,900,000.00	4,675,671.87
2.25 T-BOND 460815	2,450,000.00	2,083,648.43
2.25 T-NOTE 200229	2,400,000.00	2,389,218.74
2.25 T-NOTE 210215	1,200,000.00	1,188,421.87
2.25 T-NOTE 210331	1,600,000.00	1,583,375.00
2.25 T-NOTE 210430	1,800,000.00	1,780,593.75
2.25 T-NOTE 210731	1,400,000.00	1,382,718.75
2.25 T-NOTE 231231	1,900,000.00	1,845,671.87
2.25 T-NOTE 240131	1,300,000.00	1,262,117.18
2.25 T-NOTE 241031	2,000,000.00	1,931,250.00
2.25 T-NOTE 241115	4,650,000.00	4,488,339.84
2.25 T-NOTE 241231	2,500,000.00	2,411,718.75
2.25 T-NOTE 251115	3,350,000.00	3,211,289.06
2.25 T-NOTE 270215	5,750,000.00	5,466,093.75
2.25 T-NOTE 270815	2,900,000.00	2,748,656.25
2.25 T-NOTE 271115	3,500,000.00	3,312,695.31
2.375 T-NOTE 200430	2,000,000.00	1,993,828.12
2.375 T-NOTE 201231	800,000.00	795,312.50
2.375 T-NOTE 210315	1,000,000.00	993,164.06
2.375 T-NOTE 210415	3,500,000.00	3,474,433.59
2.375 T-NOTE 240815	3,800,000.00	3,701,437.50
2.375 T-NOTE 270515	3,150,000.00	3,021,785.15
2.5 T-BOND 450215	2,800,000.00	2,523,937.50
2.5 T-BOND 460215	1,700,000.00	1,527,476.56
2.5 T-BOND 460515	3,050,000.00	2,738,089.84
2.5 T-NOTE 230815	3,400,000.00	3,352,718.75
2.5 T-NOTE 240515	4,350,000.00	4,272,855.46
2.5 T-NOTE 250131	2,200,000.00	2,154,625.00
2.625 T-NOTE 200815	2,300,000.00	2,301,886.71
2.625 T-NOTE 201115	3,200,000.00	3,201,374.99
2.625 T-NOTE 210515	2,300,000.00	2,298,292.96
2.625 T-NOTE 230228	2,200,000.00	2,186,937.50
2.625 T-NOTE 250331	1,700,000.00	1,676,226.56
2.75 T-BOND 420815	750,000.00	713,730.46
2.75 T-BOND 421115	1,550,000.00	1,474,316.40
2.75 T-BOND 470815	1,840,000.00	1,734,631.24
2.75 T-BOND 471115	1,500,000.00	1,413,632.80
2.75 T-NOTE 231115	3,050,000.00	3,042,136.71
2.75 T-NOTE 240215	3,200,000.00	3,189,250.00
2.75 T-NOTE 250228	550,000.00	546,734.37
2.75 T-NOTE 280215	4,400,000.00	4,343,281.23
2.875 T-BOND 430515	2,800,000.00	2,720,156.25

2.875 T-BOND 450815	2,800,000.00	2,713,593.75
2.875 T-BOND 461115	3,300,000.00	3,193,781.25
2.875 T-NOTE 250430	2,600,000.00	2,603,453.12
2.875 T-NOTE 280515	3,300,000.00	3,293,296.87
3 T-BOND 420515	950,000.00	945,621.09
3 T-BOND 441115	3,550,000.00	3,525,039.06
3 T-BOND 450515	2,750,000.00	2,729,804.68
3 T-BOND 451115	2,750,000.00	2,728,730.46
3 T-BOND 470215	3,300,000.00	3,272,929.68
3 T-BOND 470515	1,950,000.00	1,933,089.84
3 T-BOND 480215	3,150,000.00	3,122,191.39
3.125 T-BOND 411115	800,000.00	813,875.00
3.125 T-BOND 420215	900,000.00	915,539.06
3.125 T-BOND 430215	1,700,000.00	1,726,031.25
3.125 T-BOND 440815	2,700,000.00	2,741,554.68
3.125 T-BOND 480515	1,500,000.00	1,524,023.43
3.125 T-NOTE 210515	600,000.00	607,945.31
3.375 T-BOND 440515	2,200,000.00	2,332,000.00
3.375 T-NOTE 191115	3,000,000.00	3,036,210.93
3.5 T-BOND 390215	1,000,000.00	1,080,078.12
3.5 T-NOTE 200515	2,100,000.00	2,136,421.87
3.625 T-BOND 430815	2,350,000.00	2,591,425.78
3.625 T-BOND 440215	2,950,000.00	3,256,984.37
3.625 T-NOTE 190815	2,200,000.00	2,229,734.37
3.625 T-NOTE 200215	2,900,000.00	2,950,750.00
3.625 T-NOTE 210215	2,900,000.00	2,972,726.56
3.75 T-BOND 410815	1,000,000.00	1,121,562.50
3.75 T-BOND 431115	2,900,000.00	3,262,726.56
3.875 T-BOND 400815	1,000,000.00	1,140,312.50
4.25 T-BOND 390515	500,000.00	598,085.93
4.25 T-BOND 401115	350,000.00	420,628.90
4.375 T-BOND 380215	450,000.00	544,218.75
4.375 T-BOND 391115	500,000.00	608,906.25
4.375 T-BOND 400515	1,250,000.00	1,525,195.31
4.375 T-BOND 410515	1,300,000.00	1,591,789.06
4.5 T-BOND 360215	950,000.00	1,153,433.59
4.5 T-BOND 380515	410,000.00	504,267.96
4.5 T-BOND 390815	400,000.00	494,531.25
4.625 T-BOND 400215	1,700,000.00	2,139,742.18
4.75 T-BOND 410215	1,000,000.00	1,284,843.75
5 T-BOND 370515	450,000.00	583,277.33
5.25 T-BOND 281115	400,000.00	483,468.75

		5.25 T-BOND 290215	300,000.00	363,773.43
		5.375 T-BOND 310215	900,000.00	1,132,453.12
		5.5 T-BOND 280815	600,000.00	735,796.87
		6 T-BOND 260215	400,000.00	485,656.25
		6.125 T-BOND 271115	600,000.00	758,460.93
		6.25 T-BOND 230815	1,130,000.00	1,317,067.96
		6.25 T-BOND 300515	550,000.00	733,326.17
		6.5 T-BOND 261115	1,200,000.00	1,522,968.75
		8 T-BOND 211115	600,000.00	702,890.62
		8.125 T-BOND 190815	600,000.00	638,039.06
		8.75 T-BOND 200815	800,000.00	902,218.74
アメリカドル合計			477,020,000.00	469,449,482.26 (51,493,913,709)
カナダドル	国債証券	0.5 CAN GOVT 220301	1,100,000.00	1,044,758.00
		0.75 CAN GOVT 190801	600,000.00	594,150.00
		0.75 CAN GOVT 200901	1,650,000.00	1,612,132.50
		0.75 CAN GOVT 210301	850,000.00	825,341.50
		0.75 CAN GOVT 210901	1,000,000.00	964,780.00
		1 CAN GOVT 220901	1,050,000.00	1,010,247.00
		1 CAN GOVT 270601	950,000.00	864,538.00
		1.25 CAN GOVT 191101	900,000.00	894,411.00
		1.25 CAN GOVT 200201	1,420,000.00	1,408,441.20
		1.5 CAN GOVT 200301	1,000,000.00	995,480.00
		1.5 CAN GOVT 230601	850,000.00	830,577.50
		1.5 CAN GOVT 260601	800,000.00	765,768.00
		1.75 CAN GOVT 190901	1,850,000.00	1,851,332.00
		1.75 CAN GOVT 200501	700,000.00	699,440.00
		1.75 CAN GOVT 230301	800,000.00	792,000.00
		2 CAN GOVT 280601	390,000.00	385,729.50
		2 CAN GOVT 511201	250,000.00	238,370.00
		2.25 CAN GOVT 250601	650,000.00	657,637.50
		2.5 CAN GOVT 240601	1,000,000.00	1,025,830.00
		2.75 CAN GOVT 220601	850,000.00	876,273.50
		2.75 CAN GOVT 481201	980,000.00	1,098,188.00
		2.75 CANADA GOVER 641201	310,000.00	362,479.90
		3.25 CAN GOVT 210601	800,000.00	831,008.00
		3.5 CAN GOVT 200601	900,000.00	928,773.00
		3.5 CAN GOVT 451201	1,050,000.00	1,326,685.50
		3.75 CAN GOVT 190601	1,050,000.00	1,070,632.50
4 CAN GOVT 410601	850,000.00	1,120,623.00		
5 CAN GOVT 370601	850,000.00	1,215,483.00		
5.75 CAN GOVT 290601	850,000.00	1,147,899.50		

		5.75 CAN GOVT 330601	800,000.00	1,164,680.00
		8 CAN GOVT 270601	500,000.00	738,650.00
カナダドル合計			27,600,000.00	29,342,339.60 (2,420,449,593)
オーストラリアドル	国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	1,650,000.00	1,637,983.51
		2 AUST GOVT 211221	1,150,000.00	1,143,621.20
		2.25 AUST GOVT 221121	300,000.00	299,709.50
		2.25 AUST GOVT 280521	1,450,000.00	1,399,718.29
		2.75 AUST GOVT 191021	1,200,000.00	1,211,585.76
		2.75 AUST GOVT 240421	1,550,000.00	1,578,063.52
		2.75 AUST GOVT 271121	1,950,000.00	1,968,018.39
		2.75 AUST GOVT 281121	1,400,000.00	1,411,834.34
		2.75 AUST GOVT 291121	930,000.00	935,407.20
		2.75 AUST GOVT 350621	500,000.00	487,485.24
		3 AUST GOVT 470321	740,000.00	719,478.80
		3.25 AUST GOVT 250421	1,550,000.00	1,622,209.85
		3.25 AUST GOVT 290421	1,550,000.00	1,635,557.21
		3.25 AUST GOVT 390621	350,000.00	361,544.50
		3.75 AUST GOVT 370421	800,000.00	889,528.16
		4.25 AUST GOVT 260421	2,200,000.00	2,460,861.48
		4.5 AUST GOVT 200415	1,750,000.00	1,826,206.20
		4.5 AUST GOVT 330421	850,000.00	1,021,358.89
		4.75 AUST GOVT 270421	1,820,000.00	2,125,116.81
5.5 AUST GOVT 230421	1,550,000.00	1,774,829.36		
5.75 AUST GOVT 210515	2,060,000.00	2,269,659.38		
5.75 AUST GOVT 220715	1,500,000.00	1,705,105.05		
オーストラリアドル合計			28,800,000.00	30,484,882.64 (2,480,859,749)
イギリスポンド	国債証券	0.5 GILT 220722	1,500,000.00	1,474,143.90
		0.75 GILT 230722	750,000.00	738,462.00
		1.25 GILT 270722	1,350,000.00	1,336,974.66
		1.5 GILT 210122	1,720,000.00	1,751,703.04
		1.5 GILT 260722	1,810,000.00	1,843,213.50
		1.5 GILT 470722	1,040,000.00	975,425.76
		1.75 GILT 190722	1,000,000.00	1,011,300.00
		1.75 GILT 220907	1,540,000.00	1,591,103.82
		1.75 GILT 370907	620,000.00	617,559.80
		1.75 GILT 570722	610,000.00	627,509.44
		2 GILT 200722	2,050,000.00	2,102,492.30
		2 GILT 250907	650,000.00	687,375.00
		2.25 GILT 230907	1,200,000.00	1,272,770.40
		2.5 GILT 650722	1,350,000.00	1,753,215.30



		2.75 GILT 240907	1,150,000.00	1,261,671.90	
		3.25 GILT 440122	1,850,000.00	2,399,228.00	
		3.5 GILT 450122	1,770,000.00	2,406,385.80	
		3.5 GILT 680722	1,310,000.00	2,165,985.44	
		3.75 GILT 190907	1,300,000.00	1,347,736.00	
		3.75 GILT 200907	1,200,000.00	1,279,557.60	
		3.75 GILT 210907	900,000.00	983,208.60	
		3.75 GILT 520722	1,270,000.00	1,939,564.06	
		4 GILT 220307	450,000.00	501,662.47	
		4 GILT 600122	910,000.00	1,561,784.40	
		4.25 GILT 271207	750,000.00	945,217.50	
		4.25 GILT 320607	1,100,000.00	1,462,612.14	
		4.25 GILT 360307	1,405,000.00	1,947,639.10	
		4.25 GILT 390907	750,000.00	1,079,340.00	
		4.25 GILT 401207	990,000.00	1,444,380.30	
		4.25 GILT 461207	1,100,000.00	1,704,490.70	
		4.25 GILT 491207	820,000.00	1,315,288.20	
		4.25 GILT 551207	1,020,000.00	1,754,400.40	
		4.5 GILT 340907	1,210,000.00	1,692,393.12	
		4.5 GILT 421207	1,100,000.00	1,692,979.20	
		4.75 GILT 200307	1,200,000.00	1,282,665.60	
		4.75 GILT 301207	920,000.00	1,255,432.00	
		4.75 GILT 381207	800,000.00	1,213,142.40	
		5 GILT 250307	950,000.00	1,186,413.77	
		6 GILT 281207	840,000.00	1,215,518.13	
		8 GILT 210607	900,000.00	1,089,703.44	
イギリスポンド合計			45,155,000.00	55,911,649.19	(8,127,317,326)
スイスフラン	国債証券	2 SWISS GOVT 210428	260,000.00	280,386.34	
		2.25 SWISS GOVT 200706	220,000.00	233,759.70	
		4 SWISS GOVT 230211	300,000.00	363,720.00	
		4 SWISS GOVT 280408	370,000.00	517,241.50	
スイスフラン合計			1,150,000.00	1,395,107.54	(154,856,936)
シンガポール	国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 211001	200,000.00	194,740.00	
		1.625 SINGAPORGOV 191001	450,000.00	449,057.12	
		1.75 SINGAPORGOVT 220401	100,000.00	98,580.00	
		1.75 SINGAPORGOVT 230201	250,000.00	245,268.84	
		2 SINGAPORGOVT 200701	150,000.00	150,125.25	
		2.125 SINGAPORGOV 260601	80,000.00	78,200.00	
		2.25 SINGAPORGOVT 210601	420,000.00	422,100.00	
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	50,000.00	45,663.25	

		2.375 SINGAPORGOV 250601	300,000.00	299,250.00	
		2.5 SINGAPORGOVT 190601	500,000.00	503,502.30	
		2.625 SINGAPORGOV 280501	100,000.00	100,691.10	
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	450,000.00	460,131.75	
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	290,000.00	282,170.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	320,000.00	309,864.00	
		2.875 SINGAPORGOV 290701	100,000.00	102,650.00	
		2.875SINGAPORGOVT 300901	300,000.00	306,300.00	
		3 SINGAPORGOVT 240901	350,000.00	362,950.00	
		3.125SINGAPORGOVT 220901	300,000.00	311,850.00	
		3.25 SINGAPORGOVT 200901	370,000.00	380,027.07	
		3.375 SINGAPORGOV 330901	310,000.00	331,718.60	
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	500,000.00	539,900.00	
		シンガポールドル合計	5,890,000.00	5,974,739.28 (481,623,733)	
マレーシア アリン ギット	国債証券	3.418MALAYSIAGOVT 220815	900,000.00	883,152.56	
		3.48 MALAYSIAGOVT 230315	1,200,000.00	1,177,412.08	
		3.492 MALAYSIAGOV 200331	500,000.00	499,622.26	
		3.502MALAYSIAGOVT 270531	300,000.00	280,910.80	
		3.659 MALAYSIAGOV 201015	1,000,000.00	1,002,061.10	
		3.733 MALAYSIAGO 280615	600,000.00	576,172.45	
		3.795 MALAYSIAGOV 220930	500,000.00	498,936.18	
		3.8 MALAYSIAGOVT 230817	200,000.00	198,367.06	
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	600,000.00	542,099.11	
		3.882 MALAYSIAGOV 220310	500,000.00	501,613.25	
		3.889 MALAYSIAGO 200731	700,000.00	705,014.80	
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	500,000.00	482,351.76	
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	500,000.00	483,118.45	
		3.9 MALAYSIAGOVT 261130	500,000.00	484,478.52	
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	800,000.00	783,902.00	
		4.048 MALAYSIA 210930	900,000.00	910,109.07	
		4.127 MALAYSIA 320415	600,000.00	563,544.12	
		4.16 MALAYSIAGOVT 210715	1,050,000.00	1,063,491.97	
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	500,000.00	501,309.10	
		4.232MALAYSIAGOVT 310630	800,000.00	764,751.60	
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	350,000.00	322,296.97	
		4.378MALAYSIAGOVT 191129	1,450,000.00	1,467,864.58	
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	1,000,000.00	1,004,690.30	
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	900,000.00	884,554.10	
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	1,050,000.00	1,017,771.70	
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	1,100,000.00	1,089,353.28	
4.935 MALAYSIAGOV 430930	350,000.00	352,564.55			

		5.248 MALAYSIA 280915	200,000.00	211,993.76
		5.734MALAYSIAGOVT 190730	300,000.00	307,426.62
マレーシアリングット合計			19,850,000.00	19,560,934.10 (534,795,938)
スウェーデンクローネ	国債証券	0.75 SWD GOVT 280512	3,450,000.00	3,537,332.26
		1 SWD GOVT 261112	3,960,000.00	4,190,076.00
		1.5 SWD GOVT 231113	5,000,000.00	5,441,675.00
		2.5 SWD GOVT 250512	3,830,000.00	4,466,325.39
		3.5 SWD GOVT 220601	6,500,000.00	7,490,704.00
		3.5 SWD GOVT 390330	3,050,000.00	4,367,884.87
		5 SWD GOVT 201201	6,100,000.00	6,942,688.16
スウェーデンクローネ合計			31,890,000.00	36,436,685.68 (451,450,535)
ノルウェークローネ	国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	2,560,000.00	2,530,816.00
		1.75 NORWE GOVT 250313	2,800,000.00	2,827,194.16
		1.75 NORWE GOVT 270217	1,750,000.00	1,751,382.32
		2 NORWE GOVT 230524	4,750,000.00	4,884,787.90
		3 NORWE GOVT 240314	3,150,000.00	3,408,659.10
		3.75 NORWE GOVT 210525	4,750,000.00	5,104,274.00
ノルウェークローネ合計			19,760,000.00	20,507,113.48 (277,461,245)
デンマーククローネ	国債証券	0.25 DMK GOVT 201115	1,900,000.00	1,938,793.44
		0.5 DMK GOVT 271115	3,350,000.00	3,396,280.58
		1.5 DMK GOVT 231115	3,150,000.00	3,432,973.95
		1.75 DMK GOVT 251115	5,350,000.00	6,004,947.00
		3 DMK GOVT 211115	6,170,000.00	6,902,136.51
		4 DMK GOVT 191115	4,750,000.00	5,059,704.75
		4.5 DMK GOVT 391115	8,300,000.00	14,172,412.67
デンマーククローネ合計			32,970,000.00	40,907,248.90 (701,559,318)
メキシコペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	17,300,000.00	19,274,795.00
		10 MEXICAN BONOS 361120	4,100,000.00	4,967,765.00
		5 MEXICAN BONOS 191211	17,050,000.00	16,386,073.00
		5.75 MEXICAN BONO 260305	9,700,000.00	8,575,091.00
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	25,700,000.00	24,826,714.00
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	13,400,000.00	12,802,226.00
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	12,450,000.00	12,245,571.00
		7.75 MEXICAN BONO 310529	9,450,000.00	9,416,736.00
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7,000,000.00	6,959,540.00
		7.75 MEXICAN BONO 421113	13,240,000.00	13,119,516.00
		8 MEXICAN BONOS 200611	15,000,000.00	15,075,750.00
		8 MEXICAN BONOS 231207	6,350,000.00	6,405,118.00

		8 MEXICAN BONOS 471107	4,350,000.00	4,426,259.85
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	5,500,000.00	5,794,690.00
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	6,200,000.00	6,624,700.00
メキシコペソ合計			166,790,000.00	166,900,544.85 (912,945,980)
ポーランドズロチ	国債証券	1.5 POLAND 200425	2,200,000.00	2,199,120.00
		1.75 POLAND 210725	1,900,000.00	1,891,260.00
		2 POLAND 210425	1,800,000.00	1,809,180.00
		2.25 POLAND 220425	1,250,000.00	1,254,250.00
		2.5 POLAND 230125	700,000.00	704,760.00
		2.5 POLAND 260725	2,650,000.00	2,547,312.50
		2.5 POLAND 270725	2,050,000.00	1,949,755.00
		2.75 POLAND 280425	450,000.00	435,307.50
		3.25 POLAND 190725	1,000,000.00	1,020,780.00
		3.25 POLAND 250725	1,750,000.00	1,786,662.50
		4 POLAND 231025	1,800,000.00	1,933,110.00
		5.25 POLAND 201025	700,000.00	757,330.00
		5.5 POLAND 191025	1,650,000.00	1,739,430.00
		5.75 POLAND 211025	1,700,000.00	1,905,955.00
		5.75 POLAND 220923	1,550,000.00	1,768,178.00
		5.75 POLAND 290425	520,000.00	645,860.80
		POLAND 200725	700,000.00	677,775.00
ポーランドズロチ合計			24,370,000.00	25,026,026.30 (739,769,337)
南アフリカランド	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	13,100,000.00	14,335,330.00
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6,950,000.00	5,036,882.74
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	7,200,000.00	5,128,920.00
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	3,000,000.00	2,921,250.00
		7 SOUTH AFRICA 310228	7,500,000.00	6,218,625.00
		7.25 SOUTH AFRICA 200115	1,700,000.00	1,695,121.00
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	5,000,000.00	4,906,600.00
		8 SOUTH AFRICA 300131	6,500,000.00	5,925,366.85
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	5,800,000.00	5,282,712.90
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	6,500,000.00	5,902,830.50
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	6,550,000.00	5,982,150.22
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	11,500,000.00	10,408,827.10
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	4,550,000.00	4,301,921.71
9 SOUTH AFRICA 400131	5,000,000.00	4,712,143.29		
南アフリカランド合計			90,850,000.00	82,758,681.31 (675,310,839)
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 220920	400,000.00	405,271.60
		0 AUSTRIA GOVT 230715	350,000.00	351,957.20

0 BUND 260815	1,900,000.00	1,878,153.80
0 FINNISH GOVT 220415	250,000.00	253,263.87
0 FINNISH GOVT 230915	500,000.00	502,833.85
0 IRISH GOVT 221018	250,000.00	251,719.50
0 NETH GOVT 220115	550,000.00	558,446.24
0 NETH GOVT 240115	650,000.00	653,092.76
0 O.A.T 200225	1,500,000.00	1,514,468.40
0 O.A.T 200525	1,550,000.00	1,566,494.01
0 O.A.T 210225	600,000.00	607,338.00
0 O.A.T 210525	1,700,000.00	1,722,397.67
0 O.A.T 220525	1,750,000.00	1,771,291.90
0 O.A.T 230325	400,000.00	403,081.60
0 OBL 200417	1,450,000.00	1,468,438.20
0 OBL 210409	1,250,000.00	1,271,087.50
0 OBL 211008	1,000,000.00	1,017,860.00
0 OBL 220408	1,000,000.00	1,018,048.00
0 OBL 221007	900,000.00	915,291.90
0 SCHATS 190614	500,000.00	503,405.00
0 SCHATS 190913	200,000.00	201,773.86
0 SCHATS 191213	800,000.00	808,412.00
0.05 ITALY GOVT 191015	800,000.00	795,060.00
0.2 BEL GOVT 231022	200,000.00	202,540.60
0.2 ITALY GOVT 201015	900,000.00	883,928.70
0.25 AUSTRIA GOVT 191018	400,000.00	404,447.20
0.25 BUND 270215	1,250,000.00	1,254,556.25
0.25 NETH GOVT 200115	800,000.00	812,038.64
0.25 NETH GOVT 250715	900,000.00	908,291.79
0.25 O.A.T 201125	1,200,000.00	1,222,454.40
0.25 O.A.T 261125	2,000,000.00	1,971,930.00
0.25 OBL 191011	1,500,000.00	1,518,730.35
0.25 OBL 201016	1,350,000.00	1,378,495.80
0.35 ITALY GOVT 200615	550,000.00	544,597.35
0.35 ITALY GOVT 211101	400,000.00	388,039.67
0.375 FINNISH GOV 200915	400,000.00	408,716.00
0.4 SPAIN GOVT 220430	1,500,000.00	1,517,233.50
0.45 ITALY GOVT 210601	1,100,000.00	1,078,230.97
0.45 SPAIN GOVT 221031	550,000.00	555,506.05
0.5 AUSTRIA GOVT 270420	400,000.00	399,996.80
0.5 BEL GOVT 241022	300,000.00	306,348.60
0.5 BUND 250215	1,250,000.00	1,295,836.25
0.5 BUND 260215	1,900,000.00	1,961,189.50
0.5 BUND 270815	1,450,000.00	1,480,294.70

0.5 BUND 280215	950,000.00	965,049.90
0.5 FINNISH GOVT 260415	400,000.00	405,673.20
0.5 FINNISH GOVT 270915	200,000.00	199,931.72
0.5 NETH GOVT 260715	1,000,000.00	1,019,990.49
0.5 O.A.T 191125	1,250,000.00	1,269,325.00
0.5 O.A.T 250525	2,150,000.00	2,196,157.49
0.5 O.A.T 260525	1,400,000.00	1,417,204.60
0.65 ITALY GOVT 201101	600,000.00	595,274.14
0.65 ITALY GOVT 231015	900,000.00	843,615.90
0.7 ITALY GOVT 200501	1,050,000.00	1,046,931.90
0.75 AUSTRIA GOVT 261020	800,000.00	821,408.80
0.75 AUSTRIA GOVT 280220	450,000.00	455,828.13
0.75 FINNISH GOVT 310415	250,000.00	248,093.75
0.75 NETH GOVT 270715	780,000.00	805,419.10
0.75 NETH GOVT 280715	450,000.00	461,358.45
0.75 O.A.T 280525	800,000.00	807,945.60
0.75 SPAIN GOVT 210730	1,300,000.00	1,332,227.00
0.8 BEL GOVT 250622	1,300,000.00	1,348,063.60
0.8 BEL GOVT 270622	700,000.00	712,298.30
0.8 BEL GOVT 280622	500,000.00	503,371.00
0.8 IRISH GOVT 220315	500,000.00	519,861.25
0.875 FINNISH GOV 250915	100,000.00	104,691.40
0.9 IRISH GOVT 280515	300,000.00	301,641.09
0.9 ITALY GOVT 220801	450,000.00	437,281.17
0.95 ITALY GOVT 230315	1,900,000.00	1,830,469.54
1 BEL GOVT 260622	1,100,000.00	1,148,914.80
1 BEL GOVT 310622	650,000.00	649,565.80
1 BUND 240815	1,150,000.00	1,229,206.25
1 BUND 250815	1,550,000.00	1,660,437.50
1 IRISH GOVT 260515	600,000.00	621,412.14
1 O.A.T 251125	2,170,000.00	2,287,563.00
1 O.A.T 270525	2,050,000.00	2,138,420.60
1.05 ITALY GOVT 191201	1,500,000.00	1,509,666.00
1.125 FINNISH GOV 340415	200,000.00	203,666.60
1.15 SPAIN GOVT 200730	1,300,000.00	1,337,625.64
1.2 AUSTRIA GOVT 251020	800,000.00	854,155.20
1.2 ITALY GOVT 220401	900,000.00	889,875.36
1.25 BEL GOVT 330422	60,000.00	60,815.28
1.25 BUND 480815	430,000.00	445,013.45
1.25 ITALY GOVT 261201	1,300,000.00	1,183,512.52
1.25 O.A.T 340525	300,000.00	305,611.20
1.25 O.A.T 360525	1,450,000.00	1,449,824.05
1.3 IRISH GOVT 330515	300,000.00	298,212.60

1.3 SPAIN GOVT 261031	1,300,000.00	1,319,449.69
1.35 ITALY GOVT 220415	1,150,000.00	1,141,983.74
1.4 SPAIN GOVT 200131	1,550,000.00	1,591,854.65
1.4 SPAIN GOVT 280430	1,300,000.00	1,304,778.54
1.45 BEL GOVT 370622	190,000.00	191,537.48
1.45 ITALY GOVT 220915	900,000.00	892,237.00
1.45 ITALY GOVT 241115	400,000.00	382,080.00
1.45 ITALY GOVT 250515	600,000.00	567,844.13
1.45 SPAIN GOVT 271031	1,300,000.00	1,319,259.50
1.5 AUSTRIA GOVT 470220	310,000.00	311,150.41
1.5 AUSTRIA GOVT 861102	150,000.00	133,542.24
1.5 BUND 220904	1,300,000.00	1,405,942.20
1.5 BUND 230215	1,000,000.00	1,087,173.00
1.5 BUND 230515	1,200,000.00	1,307,695.20
1.5 BUND 240515	1,150,000.00	1,262,725.30
1.5 FINNISH GOVT 230415	250,000.00	270,519.00
1.5 ITALY GOVT 250601	1,100,000.00	1,043,757.00
1.5 O.A.T 310525	2,300,000.00	2,461,213.90
1.5 SPAIN GOVT 270430	1,050,000.00	1,074,492.30
1.6 BEL GOVT 470622	500,000.00	485,456.30
1.6 ITALY GOVT 260601	1,200,000.00	1,130,638.90
1.6 SPAIN GOVT 250430	1,500,000.00	1,580,617.50
1.625 FINNISH GOV 220915	300,000.00	324,748.95
1.65 AUSTRIA GOVT 241021	700,000.00	769,396.60
1.65 ITALY GOVT 320301	1,360,000.00	1,171,354.40
1.7 IRISH GOVT 370515	350,000.00	360,843.70
1.75 AUSTRIA GOVT 231020	800,000.00	878,927.20
1.75 BUND 220704	1,600,000.00	1,743,360.00
1.75 BUND 240215	1,150,000.00	1,276,877.20
1.75 NETH GOVT 230715	1,000,000.00	1,100,421.50
1.75 O.A.T 230525	2,050,000.00	2,243,222.75
1.75 O.A.T 241125	2,500,000.00	2,763,862.50
1.75 O.A.T 390625	640,000.00	683,425.85
1.75 O.A.T 660525	600,000.00	575,971.68
1.85 ITALY GOVT 240515	850,000.00	837,155.76
1.9 BEL GOVT 380622	400,000.00	430,852.00
1.95 AUSTRIA GOVT 190618	500,000.00	512,414.00
1.95 SPAIN GOVT 260430	1,400,000.00	1,495,305.00
1.95 SPAIN GOVT 300730	1,150,000.00	1,190,423.65
2 BUND 220104	1,700,000.00	1,851,760.70
2 BUND 230815	1,550,000.00	1,732,548.15
2 FINNISH GOVT 240415	200,000.00	223,580.66

2 IRISH GOVT 450218	500,000.00	528,263.00
2 ITALY GOVT 251201	1,200,000.00	1,170,631.69
2 ITALY GOVT 280201	400,000.00	377,376.40
2 NETH GOVT 240715	950,000.00	1,067,640.87
2 O.A.T 480525	1,090,000.00	1,175,301.22
2.05 ITALY GOVT 270801	1,100,000.00	1,047,887.50
2.1 AUSTRIA GOVT 170920	250,000.00	272,287.50
2.15 BEL GOVT 660622	250,000.00	260,405.00
2.15 ITALY GOVT 211215	1,000,000.00	1,026,622.20
2.15 SPAIN GOVT 251031	1,300,000.00	1,410,895.20
2.2 ITALY GOVT 270601	1,100,000.00	1,066,197.00
2.25 BEL GOVT 230622	820,000.00	918,495.94
2.25 BEL GOVT 570622	170,000.00	184,820.60
2.25 BUND 200904	1,000,000.00	1,064,762.30
2.25 BUND 210904	800,000.00	872,143.20
2.25 ITALY GOVT 360901	1,250,000.00	1,108,943.86
2.25 NETH GOVT 220715	900,000.00	997,632.45
2.25 O.A.T 221025	2,350,000.00	2,607,724.26
2.25 O.A.T 240525	2,300,000.00	2,604,115.20
2.35 SPAIN GOVT 330730	290,000.00	306,077.60
2.4 AUSTRIA GOVT 340523	350,000.00	418,944.75
2.4 IRISH GOVT 300515	600,000.00	689,812.20
2.45 ITALY GOVT 330901	100,000.00	93,062.84
2.5 BUND 210104	1,500,000.00	1,620,494.40
2.5 BUND 440704	1,400,000.00	1,867,758.90
2.5 BUND 460815	1,640,000.00	2,210,877.44
2.5 ITALY GOVT 241201	1,800,000.00	1,832,551.20
2.5 NETH GOVT 330115	800,000.00	989,529.44
2.5 O.A.T 201025	2,400,000.00	2,570,488.80
2.5 O.A.T 300525	2,150,000.00	2,558,407.76
2.6 BEL GOVT 240622	1,300,000.00	1,496,237.60
2.625 FINNISH GOV 420704	300,000.00	393,498.42
2.7 ITALY GOVT 470301	900,000.00	796,407.30
2.7 SPAIN GOVT 481031	500,000.00	514,751.50
2.75 FINNISH GOVT 280704	300,000.00	363,940.50
2.75 NETH GOVT 470115	850,000.00	1,190,741.20
2.75 O.A.T 271025	2,450,000.00	2,945,169.50
2.75 SPAIN GOVT 241031	1,550,000.00	1,748,105.50
2.8 ITALY GOVT 670301	410,000.00	351,790.66
2.9 SPAIN GOVT 461031	1,130,000.00	1,222,565.08
2.95 ITALY GOVT 380901	700,000.00	669,753.43
3 BEL GOVT 190928	750,000.00	783,630.00
3 BEL GOVT 340622	200,000.00	251,991.20



3 BUND 200704	2,000,000.00	2,150,373.40	
3 O.A.T 220425	3,000,000.00	3,387,168.00	
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	450,000.00	624,284.55	
3.25 BUND 200104	1,200,000.00	1,273,759.20	
3.25 BUND 210704	1,800,000.00	2,010,661.20	
3.25 BUND 420704	950,000.00	1,414,195.74	
3.25 ITALY GOVT 460901	1,150,000.00	1,126,100.70	
3.25 NETH GOVT 210715	1,600,000.00	1,787,792.80	
3.25 O.A.T 211025	2,600,000.00	2,920,424.00	
3.25 O.A.T 450525	1,690,000.00	2,316,476.24	
3.375 FINNISH GOV 200415	450,000.00	482,843.70	
3.4 AUSTRIA GOVT 221122	650,000.00	756,514.20	
3.4 IRISH GOVT 240318	600,000.00	713,375.40	
3.45 ITALY GOVT 480301	670,000.00	667,783.64	
3.45 SPAIN GOVT 660730	480,000.00	558,431.52	
3.5 AUSTRIA GOVT 210915	850,000.00	960,937.75	
3.5 BUND 190704	1,150,000.00	1,199,786.95	
3.5 FINNISH GOVT 210415	400,000.00	445,356.60	
3.5 ITALY GOVT 300301	1,400,000.00	1,474,921.28	
3.5 NETH GOVT 200715	750,000.00	815,062.80	
3.5 O.A.T 200425	2,800,000.00	3,009,151.88	
3.5 O.A.T 260425	2,650,000.00	3,313,626.25	
3.65 AUSTRIA GOVT 220420	600,000.00	692,683.80	
3.75 BEL GOVT 200928	1,200,000.00	1,317,631.44	
3.75 BEL GOVT 450622	770,000.00	1,120,539.42	
3.75 ITALY GOVT 210301	1,900,000.00	2,030,212.89	
3.75 ITALY GOVT 210501	1,800,000.00	1,928,007.00	
3.75 ITALY GOVT 210801	2,100,000.00	2,257,466.40	
3.75 ITALY GOVT 240901	1,200,000.00	1,306,351.20	
3.75 NETH GOVT 230115	300,000.00	356,141.61	
3.75 NETH GOVT 420115	1,000,000.00	1,575,335.89	
3.75 O.A.T 191025	2,150,000.00	2,274,469.95	
3.75 O.A.T 210425	2,200,000.00	2,464,903.10	
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	230,000.00	388,000.80	
3.8 SPAIN GOVT 240430	1,300,000.00	1,537,814.20	
3.9 AUSTRIA GOVT 200715	820,000.00	896,284.60	
3.9 IRISH GOVT 230320	400,000.00	476,292.00	
4 BEL GOVT 220328	750,000.00	874,335.00	
4 BEL GOVT 320328	620,000.00	858,582.82	
4 BUND 370104	1,450,000.00	2,241,907.35	
4 FINNISH GOVT 250704	550,000.00	696,757.05	
4 ITALY GOVT 200901	1,450,000.00	1,544,830.00	

4 ITALY GOVT 370201	1,500,000.00	1,677,082.35
4 NETH GOVT 190715	1,100,000.00	1,155,038.50
4 NETH GOVT 370115	950,000.00	1,457,119.50
4 O.A.T 381025	1,700,000.00	2,525,329.26
4 O.A.T 550425	1,000,000.00	1,603,727.50
4 O.A.T 600425	800,000.00	1,311,300.95
4 SPAIN GOVT 200430	1,200,000.00	1,293,228.00
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	900,000.00	1,353,532.50
4.2 SPAIN GOVT 370131	1,700,000.00	2,264,377.56
4.25 BEL GOVT 210928	1,150,000.00	1,327,685.35
4.25 BEL GOVT 220928	1,100,000.00	1,314,812.40
4.25 BEL GOVT 410328	1,050,000.00	1,599,106.95
4.25 BUND 390704	900,000.00	1,478,410.20
4.25 ITALY GOVT 190901	1,100,000.00	1,148,646.40
4.25 ITALY GOVT 200301	1,650,000.00	1,744,122.27
4.25 O.A.T 231025	2,950,000.00	3,639,128.85
4.3 SPAIN GOVT 191031	1,500,000.00	1,594,960.50
4.375 FINNISH GOV 190704	200,000.00	210,413.40
4.4 SPAIN GOVT 231031	1,350,000.00	1,629,645.48
4.5 BEL GOVT 260328	500,000.00	658,622.00
4.5 IRISH GOVT 200418	850,000.00	928,824.07
4.5 ITALY GOVT 200201	2,100,000.00	2,224,341.00
4.5 ITALY GOVT 230501	1,300,000.00	1,458,406.30
4.5 ITALY GOVT 240301	1,350,000.00	1,523,272.50
4.5 ITALY GOVT 260301	1,450,000.00	1,662,891.17
4.5 O.A.T 410425	2,320,000.00	3,719,071.36
4.6 SPAIN GOVT 190730	900,000.00	949,376.70
4.65 SPAIN GOVT 250730	1,550,000.00	1,954,925.10
4.7 SPAIN GOVT 410730	1,160,000.00	1,660,794.27
4.75 BUND 280704	600,000.00	862,284.00
4.75 BUND 340704	1,300,000.00	2,093,942.50
4.75 BUND 400704	1,000,000.00	1,765,849.88
4.75 ITALY GOVT 210901	3,000,000.00	3,323,295.00
4.75 ITALY GOVT 230801	1,700,000.00	1,934,906.00
4.75 ITALY GOVT 280901	1,500,000.00	1,755,864.00
4.75 ITALY GOVT 440901	1,270,000.00	1,542,221.96
4.75 O.A.T 350425	1,730,000.00	2,695,637.56
4.8 SPAIN GOVT 240131	1,100,000.00	1,358,005.00
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	550,000.00	744,511.90
4.85 SPAIN GOVT 201031	1,650,000.00	1,843,889.68
4.9 SPAIN GOVT 400730	1,100,000.00	1,608,596.99
5 BEL GOVT 350328	1,520,000.00	2,383,053.41
5 IRISH GOVT 201018	750,000.00	846,722.10

	5 ITALY GOVT 220301	1,500,000.00	1,686,355.50	
	5 ITALY GOVT 250301	1,350,000.00	1,579,127.40	
	5 ITALY GOVT 340801	2,150,000.00	2,666,322.50	
	5 ITALY GOVT 390801	1,300,000.00	1,618,442.28	
	5 ITALY GOVT 400901	1,300,000.00	1,608,268.22	
	5.15 SPAIN GOVT 281031	950,000.00	1,289,452.10	
	5.15 SPAIN GOVT 441031	800,000.00	1,223,608.00	
	5.25 ITALY GOVT 291101	1,600,000.00	1,960,535.04	
	5.4 IRISH GOVT 250313	700,000.00	935,901.75	
	5.4 SPAIN GOVT 230131	1,350,000.00	1,666,318.50	
	5.5 BEL GOVT 280328	1,300,000.00	1,902,537.00	
	5.5 BUND 310104	1,200,000.00	1,928,278.08	
	5.5 ITALY GOVT 220901	1,150,000.00	1,326,799.85	
	5.5 ITALY GOVT 221101	1,000,000.00	1,156,260.00	
	5.5 NETH GOVT 280115	850,000.00	1,259,547.00	
	5.5 O.A.T 290425	1,900,000.00	2,854,745.25	
	5.5 SPAIN GOVT 210430	1,700,000.00	1,970,068.97	
	5.625 BUND 280104	950,000.00	1,428,870.87	
	5.75 ITALY GOVT 330201	1,350,000.00	1,770,034.95	
	5.75 O.A.T 321025	2,140,000.00	3,517,973.82	
	5.75 SPAIN GOVT 320730	1,350,000.00	2,026,445.85	
	5.85 SPAIN GOVT 220131	1,850,000.00	2,236,971.90	
	5.9 IRISH GOVT 191018	350,000.00	379,463.77	
	5.9 SPAIN GOVT 260730	1,300,000.00	1,785,016.22	
	6 ITALY GOVT 310501	1,950,000.00	2,567,964.75	
	6 O.A.T 251025	2,300,000.00	3,276,328.38	
	6 SPAIN GOVT 290131	1,850,000.00	2,681,406.65	
	6.25 AUSTRIA GOVT 270715	550,000.00	833,259.35	
	6.25 BUND 240104	700,000.00	951,771.10	
	6.25 BUND 300104	600,000.00	993,756.00	
	6.5 BUND 270704	800,000.00	1,250,383.84	
	6.5 ITALY GOVT 271101	2,000,000.00	2,630,773.59	
	7.25 ITALY GOVT 261101	750,000.00	1,017,576.37	
	7.5 NETH GOVT 230115	650,000.00	883,854.98	
	8.5 O.A.T 191025	550,000.00	616,928.12	
	8.5 O.A.T 230425	1,000,000.00	1,422,561.00	
	9 ITALY GOVT 231101	1,200,000.00	1,626,649.56	
ユーロ合計		318,860,000.00	366,541,438.53 (46,851,326,672)	
合計			116,303,640,910 (116,303,640,910)	

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

## 外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 232銘柄	100.00%	44.28%
カナダドル	国債証券 31銘柄	100.00%	2.08%
オーストラリアドル	国債証券 22銘柄	100.00%	2.13%
イギリスポンド	国債証券 40銘柄	100.00%	6.99%
スイスフラン	国債証券 4銘柄	100.00%	0.13%
シンガポールドル	国債証券 21銘柄	100.00%	0.41%
マレーシアリングgit	国債証券 29銘柄	100.00%	0.46%
スウェーデンクローネ	国債証券 7銘柄	100.00%	0.39%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	100.00%	0.24%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.00%	0.60%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.00%	0.78%
ポーランドズロチ	国債証券 17銘柄	100.00%	0.64%
南アフリカランド	国債証券 14銘柄	100.00%	0.58%
ユーロ	国債証券 294銘柄	100.00%	40.28%

## 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30年 6月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	326,429,198
コール・ローン	43,027,006
国債証券	16,164,498,888
派生商品評価勘定	55,790
未収利息	244,223,418
前払費用	33,606,216
流動資産合計	16,811,840,516
資産合計	16,811,840,516
負債の部	

[平成30年 6月25日現在]

流動負債	
派生商品評価勘定	131,346
未払金	80,294,769
未払解約金	4,559,467
未払利息	91
流動負債合計	84,985,673
負債合計	84,985,673
純資産の部	
元本等	
元本	12,929,911,417
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,796,943,426
元本等合計	16,726,854,843
純資産合計	16,726,854,843
負債純資産合計	16,811,840,516

## 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 「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30年 6月25日現在]
1. 期首	平成29年 8月16日
期首元本額	10,612,604,971円
期中追加設定元本額	3,145,693,126円
期中一部解約元本額	828,386,680円
元本の内訳	
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,540,155,690円
eMAXIS バランス(波乗り型)	370,048,838円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	371,894,404円
コアバランス	1,634,740円
海外債券セレクション(ラップ向け)	143,814,068円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	1,240,194,973円
つみたて8資産均等バランス	166,454,704円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	828,220円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,170,765円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	95,002円

	[平成30年 6月25日現在]
e M A X I S 新興国債券インデックス	4,253,275,390円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	3,514,779,533円
新興国債券インデックスファンド（ラップ向け）	5,348,991円
e M A X I S 最適化バランス（マイディフェンダー）	20,104,611円
e M A X I S 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	127,469,610円
e M A X I S 最適化バランス（マイフォワード）	105,183,713円
e M A X I S 最適化バランス（マイストライカー）	20,545,183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）	11,973,804円
合計	12,929,911,417円
2. 受益権の総数	12,929,911,417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29年 8月16日 至 平成30年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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30年 6月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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30年 6月25日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		567,002,697
合計		567,002,697

(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30年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	7,701,750		7,677,600	24,150
	マレーシアリンギット	8,265,765		8,263,739	2,026
	メキシコペソ	4,357,800		4,368,000	10,200
	チェココルナ	2,477,500		2,475,000	2,500
	ハンガリーフォリント	5,887,500		5,899,500	12,000
	ポーランドズロチ	2,951,110		2,955,000	3,890
	南アフリカランド	2,447,280		2,445,000	2,280

	ロシアルーブル	3,486,000		3,440,000	46,000
	ルーマニアレイ	2,750,000		2,742,000	8,000
	トルコリラ	1,159,350		1,186,500	27,150
	売建 南アフリカランド	6,476,160		6,520,000	43,840
	合計	47,960,215		47,972,339	75,556

## (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30年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	1.2937円
(1万口当たり純資産額)	(12,937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 アリン ギット	国債証券	3.492 MALAYSIAGOV 200331	2,000,000.00	1,998,489.03	
		3.62 MALAYSIAGOV 211130	3,400,000.00	3,399,931.15	
		3.654 MALAYSIAGOV 191031	1,800,000.00	1,804,558.50	



		3.659 MALAYSIAGOV 201015	2,500,000.00	2,505,152.75
		3.8 MALAYSIAGOV 230817	1,900,000.00	1,884,487.08
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3,400,000.00	3,285,205.48
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	2,000,000.00	1,937,914.08
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3,500,000.00	3,429,571.25
		4.059 MALAYSIAGOV 240930	3,100,000.00	3,085,935.14
		4.16 MALAYSIAGOV 210715	2,400,000.00	2,430,838.80
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	1,600,000.00	1,604,189.12
		4.378MALAYSIAGOV 191129	3,600,000.00	3,644,353.44
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	2,300,000.00	2,277,738.69
マレーシアリングット合計			33,500,000.00	33,288,364.51 (910,103,885)
タイバーツ	国債証券	1.875 THAILAND 220617	39,700,000.00	39,471,478.46
		2 THAILAND 221217	15,500,000.00	15,442,707.81
		2.125 THAILAND 261217	25,400,000.00	24,412,282.90
		2.55 THAILAND 200626	12,900,000.00	13,104,345.03
		3.4 THAILAND 360617	28,500,000.00	28,893,077.70
		3.625 THAILAND 230616	42,400,000.00	45,195,186.08
		3.65 THAILAND 211217	62,200,000.00	65,809,652.60
		3.65 THAILAND 310620	28,100,000.00	29,660,777.97
		3.775 THAILAND 320625	25,000,000.00	26,708,775.00
		3.85 THAILAND 251212	46,500,000.00	50,683,698.00
		4.875 THAILAND 290622	38,200,000.00	45,236,260.46
タイバーツ合計			364,400,000.00	384,618,242.01 (1,280,778,745)
フィリピンペソ	国債証券	4.95 PHILIPPI (GL) 210115	10,000,000.00	9,887,500.00
		6.25 PHILIPPI (GL) 360114	10,000,000.00	10,675,000.00
フィリピンペソ合計			20,000,000.00	20,562,500.00 (42,358,750)
インドネシアルピア	国債証券	10.5 INDONESIA 300815	4,550,000,000.00	5,452,037,500.00
		11 INDONESIA 201115	3,050,000,000.00	3,301,625,000.00
		11 INDONESIA 250915	3,450,000,000.00	4,066,687,500.00
		12.8 INDONESIA 210615	2,590,000,000.00	2,968,787,500.00
		5.625 INDONESIA 230515	6,800,000,000.00	6,341,000,000.00
		6.125 INDONESIA 280515	9,650,000,000.00	8,733,250,000.00
		6.625 INDONESIA 330515	6,400,000,000.00	5,654,400,000.00
		7 INDONESIA 220515	7,450,000,000.00	7,371,775,000.00
		7 INDONESIA 270515	11,850,000,000.00	11,331,562,500.00
		7.5 INDONESIA 320815	8,900,000,000.00	8,486,150,000.00
		7.5 INDONESIA 380515	6,500,000,000.00	6,158,750,000.00
		8.25 INDONESIA 210715	17,700,000,000.00	18,169,050,000.00
		8.25 INDONESIA 320615	7,000,000,000.00	7,009,353,400.00

		8.25 INDONESIA 360515	12,200,000,000.00	12,261,000,000.00	
		8.375 INDONESIA 240315	22,000,000,000.00	22,819,500,000.00	
		8.375 INDONESIA 260915	18,130,000,000.00	18,832,537,500.00	
		8.375 INDONESIA 340315	12,200,000,000.00	12,480,600,000.00	
		8.75 INDONESIA 310515	6,800,000,000.00	7,157,284,920.00	
		9 INDONESIA 290315	14,900,000,000.00	16,241,000,000.00	
		9.5 INDONESIA 310715	4,150,000,000.00	4,608,616,915.00	
インドネシアルピア合計			186,270,000,000.00	189,444,967,735.00	(1,477,670,748)
アルゼンチンペソ	国債証券	15.5 REPUBLIC OF 261017	18,500,000.00	17,459,375.00	
		16 REPUBLIC OF AR 231017	6,000,000.00	5,677,500.00	
		18.2 REPUBLIC OF 211003	12,000,000.00	11,310,000.00	
アルゼンチンペソ合計			36,500,000.00	34,446,875.00	(139,854,312)
メキシコペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	35,400,000.00	39,440,910.00	
		10 MEXICAN BONOS 361120	9,000,000.00	10,904,850.00	
		5 MEXICAN BONOS 191211	23,700,000.00	22,777,122.00	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	17,700,000.00	15,647,331.00	
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	36,900,000.00	35,646,138.00	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	30,700,000.00	29,330,473.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	21,200,000.00	20,851,896.00	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	16,200,000.00	16,142,976.00	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	13,100,000.00	13,024,282.00	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	22,100,000.00	21,898,890.00	
		8 MEXICAN BONOS 200611	36,000,000.00	36,181,800.00	
		8 MEXICAN BONOS 231207	8,500,000.00	8,573,780.00	
		8 MEXICAN BONOS 471107	8,200,000.00	8,343,754.20	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	9,300,000.00	9,798,294.00	
8.5 MEXICAN BONOS 381118	11,000,000.00	11,753,500.00			
メキシコペソ合計			299,000,000.00	300,315,996.20	(1,642,728,499)
ブラジルリアル	国債証券	10 (IN)BRAZIL NT 270101	6,270,000.00	5,945,358.21	
		10 (IN)BRAZIL NTN 250101	6,750,000.00	6,589,059.75	
		10(IN)BRAZIL NTN-F210101	9,600,000.00	10,121,625.60	
		10(IN)BRAZIL NTN-F230101	7,900,000.00	7,993,717.70	
		BRAZIL-LTN 200101	7,600,000.00	6,701,870.00	
		BRAZIL-LTN 200701	18,000,000.00	15,087,654.00	
		BRAZIL-LTN 210701	6,200,000.00	4,640,786.80	
ブラジルリアル合計			62,320,000.00	57,080,072.06	(1,653,609,687)
チリペソ	国債証券	5.5 CHILE (GL) 200805	2,380,000,000.00	2,473,795,800.00	
			2,380,000,000.00	2,473,795,800.00	

チリペソ合計				(425,987,636)
チェココ ルナ	国債証券	0 CZECH REPUBLIC 200210	5,000,000.00	4,955,171.60
		0.25 CZECH REPUB 270210	9,700,000.00	8,360,478.50
		0.95 CZECH REPUB 300515	8,400,000.00	7,155,960.00
		1.5 CZECH REPUB 191029	5,000,000.00	5,051,950.00
		2.4 CZECH REPUB 250917	21,800,000.00	22,556,896.00
		2.5 CZECH REPUB 280825	17,700,000.00	18,197,370.00
		3.75 CZECH REPUB 200912	19,600,000.00	20,748,952.00
		3.85 CZECH REPUB 210929	17,600,000.00	19,151,528.00
		4.7 CZECH REPUB 220912	10,200,000.00	11,578,020.00
		5.7 CZECH REPUB 240525	19,800,000.00	24,516,459.00
チェココルナ合計			134,800,000.00	142,272,785.10 (704,250,286)
コロンビ アペソ	国債証券	10 TITULOS DE TES 240724	5,350,000,000.00	6,376,103,250.00
		11 TITULOS DE TES 200724	4,020,000,000.00	4,481,978,400.00
		4.375 COLOMBI (GL) 230321	1,680,000,000.00	1,610,736,960.00
		6 TITULOS DE TESO 280428	1,850,000,000.00	1,778,564,100.00
		7 TITULOS DE TESO 190911	550,000,000.00	564,271,950.00
		7 TITULOS DE TESO 220504	4,410,000,000.00	4,611,259,170.00
		7 TITULOS DE TESO 320630	2,400,000,000.00	2,392,701,600.00
		7.5 TITULOS DE TE 260826	5,520,000,000.00	5,857,603,200.00
		7.75 COLOMBI (GL) 210414	1,000,000,000.00	1,055,300,000.00
		7.75 TITULOS DE T 300918	2,720,000,000.00	2,925,544,960.00
		9.85 COLOMBI (GL) 270628	1,290,000,000.00	1,623,271,500.00
コロンビアペソ合計			30,790,000,000.00	33,277,335,090.00 (1,251,227,799)
ハンガ リーフォ リント	国債証券	1 HUNGARY 200923	21,000,000.00	20,831,013.00
		1.75 HUNGARY 221026	165,000,000.00	162,279,956.85
		2 HUNGARY 191030	20,000,000.00	20,365,956.00
		2.5 HUNGARY 211027	60,000,000.00	61,108,614.00
		2.75 HUNGARY 261222	60,000,000.00	57,507,050.40
		3 HUNGARY 240626	134,000,000.00	136,510,583.80
		3 HUNGARY 271027	169,000,000.00	162,601,406.50
		3.5 HUNGARY 200624	214,000,000.00	223,711,320.00
		5.5 HUNGARY 250624	215,000,000.00	251,001,750.00
		6 HUNGARY 231124	203,000,000.00	239,803,900.00
		7 HUNGARY 220624	254,500,000.00	302,485,975.00
		7.5 HUNGARY 201112	197,000,000.00	225,206,144.80
ハンガリーフォリント合計			1,712,500,000.00	1,863,413,670.35 (733,066,937)
ペルーヌ エボソル	国債証券	5.7 PERU 240812	1,600,000.00	1,652,123.20
		6.15 PERU 320812	2,400,000.00	2,434,958.40

		6.35 PERU 280812	2,300,000.00	2,404,617.80
		6.9 PERU 370812	1,400,000.00	1,488,447.80
		6.95 PERU 310812	2,000,000.00	2,169,770.00
		7.84 PERU 200812	750,000.00	828,858.75
		8.2 PERU 260812	2,200,000.00	2,583,721.80
ペルーヌエボソル合計			12,650,000.00	13,562,497.75 (454,886,174)
ポーランドズロチ	国債証券	1.5 POLAND 200425	5,300,000.00	5,297,880.00
		1.75 POLAND 210725	5,700,000.00	5,673,780.00
		2 POLAND 210425	3,100,000.00	3,115,810.00
		2.25 POLAND 220425	4,100,000.00	4,113,940.00
		2.5 POLAND 230125	1,800,000.00	1,812,240.00
		2.5 POLAND 260725	5,000,000.00	4,806,250.00
		2.5 POLAND 270725	4,900,000.00	4,660,390.00
		2.75 POLAND 280425	600,000.00	580,410.00
		3.25 POLAND 190725	800,000.00	816,624.00
		3.25 POLAND 250725	3,800,000.00	3,879,610.00
		4 POLAND 231025	4,200,000.00	4,510,590.00
		5.25 POLAND 201025	2,800,000.00	3,029,320.00
		5.5 POLAND 191025	3,100,000.00	3,268,020.00
		5.75 POLAND 211025	2,000,000.00	2,242,300.00
		5.75 POLAND 220923	2,500,000.00	2,851,900.00
ポーランドズロチ合計			49,700,000.00	50,659,064.00 (1,497,481,931)
南アフリカランド	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	25,600,000.00	28,014,080.00
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	12,100,000.00	8,769,249.08
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	12,800,000.00	9,118,080.00
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	9,500,000.00	9,250,625.00
		7 SOUTH AFRICA 310228	14,000,000.00	11,608,100.00
		7.25 SOUTH AFRICA 200115	2,000,000.00	1,994,260.00
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	8,100,000.00	7,948,692.00
		8 SOUTH AFRICA 300131	13,200,000.00	12,033,052.68
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	11,500,000.00	10,474,344.54
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	14,900,000.00	13,531,103.76
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	15,000,000.00	13,699,580.70
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	23,100,000.00	20,908,165.74
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	8,800,000.00	8,320,200.24
9 SOUTH AFRICA 400131	7,600,000.00	7,162,457.78		
南アフリカランド合計			178,200,000.00	162,831,991.52 (1,328,709,050)
ウルグアイペソ	国債証券	8.5 URUGUAY(GL) 280315	5,000,000.00	4,343,750.00
		9.875 URUGUAY(GL) 220620	5,000,000.00	4,990,925.00

ウルグアイペソ合計			10,000,000.00	9,334,675.00 (32,671,362)
ロシア ルーブル	国債証券	6.4 RUSSIA OFZ 200527	46,100,000.00	45,648,450.50
		6.8 RUSSIA GOVT 191211	10,300,000.00	10,288,721.50
		7 RUSSIA GOVT 230125	36,500,000.00	36,010,900.00
		7 RUSSIA GOVT BON 230816	62,000,000.00	61,197,100.00
		7 RUSSIA OFZ 211215	40,000,000.00	39,736,000.00
		7.05 RUSSIA GOVT 280119	55,000,000.00	53,239,450.00
		7.1 RUSSIA OFZ 241016	61,400,000.00	60,399,794.00
		7.4 RUSSIA OFZ 221207	50,100,000.00	50,320,440.00
		7.5 RUSSIA OFZ 210818	48,900,000.00	49,437,900.00
		7.6 RUSSIA GOVT 210414	29,000,000.00	29,383,293.00
		7.6 RUSSIA GOVT 220720	31,000,000.00	31,382,230.00
		7.7 RUSSIA OFZ 330323	69,700,000.00	70,229,720.00
		7.75 RUSSIA OFZ 260916	75,400,000.00	76,532,508.00
		8.15 RUSSIA GOVT 270203	55,500,000.00	57,645,352.50
8.5 RUSSIA OFZ 310917	38,000,000.00	40,909,280.00		
ロシアルーブル合計			708,900,000.00	712,361,139.50 (1,232,384,771)
ドミニカ ペソ	国債証券	8.9 DOMINICAN 230215	8,000,000.00	8,200,320.00
ドミニカペソ合計			8,000,000.00	8,200,320.00 (18,122,707)
ルーマニ アレイ	国債証券	3.4 ROMANIA GOVER 220308	1,200,000.00	1,155,234.00
		3.5 ROMANIA GOVER 221219	1,400,000.00	1,335,320.00
		4.75 ROMANIA GOVE 250224	3,100,000.00	3,079,741.50
		5.75 ROMANIA GOVE 200429	3,600,000.00	3,728,826.00
		5.8 ROMANIA GOV 270726	1,300,000.00	1,372,462.00
		5.85 ROMANIA GOVE 230426	2,900,000.00	3,045,101.50
		5.95 ROMANIA 210611	1,200,000.00	1,254,834.00
ルーマニアレイ合計			14,700,000.00	14,971,519.00 (410,668,766)
トルコリ ラ	国債証券	10.4 TURKEY GOVT 240320	1,000,000.00	785,000.00
		10.5 TURKEY GOVT 200115	1,600,000.00	1,442,800.00
		10.5 TURKEY GOVT 270811	3,800,000.00	2,816,275.00
		10.6 TURKEY GOVT 260211	4,100,000.00	3,122,150.00
		10.7 TURKEY GOVT 210217	3,900,000.00	3,334,500.00
		10.7 TURKEY GOVT 220817	3,800,000.00	3,123,600.00
		11 TURKEY GOVT 220302	2,900,000.00	2,424,400.00
		11 TURKEY GOVT 270224	2,300,000.00	1,759,500.00
		7.1 TURKEY GOVT 230308	3,900,000.00	2,730,000.00
		7.4 TURKEY GOVT 200205	2,000,000.00	1,712,000.00
		8 TURKEY GOVT 250312	3,400,000.00	2,274,600.00

	8.5 TURKEY GOVT 190710	1,900,000.00	1,734,700.00	
	8.5 TURKEY GOVT 220914	3,400,000.00	2,573,800.00	
	8.8 TURKEY GOVT 230927	2,400,000.00	1,768,800.00	
	9 TURKEY GOVT 240724	2,000,000.00	1,472,500.00	
	9.2 TURKEY GOVT 210922	2,200,000.00	1,771,000.00	
	9.4 TURKEY GOVT 200708	2,800,000.00	2,403,800.00	
	9.5 TURKEY GOVT 220112	2,300,000.00	1,821,600.00	
トルコリラ合計		49,700,000.00	39,071,025.00 (927,936,843)	
合計			16,164,498,888 (16,164,498,888)	

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
マレーシアリングット	国債証券 13銘柄	100.00%	5.63%
タイバーツ	国債証券 11銘柄	100.00%	7.92%
フィリピンペソ	国債証券 2銘柄	100.00%	0.26%
インドネシアルピア	国債証券 20銘柄	100.00%	9.14%
アルゼンチンペソ	国債証券 3銘柄	100.00%	0.87%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.00%	10.16%
ブラジルリアル	国債証券 7銘柄	100.00%	10.23%
チリペソ	国債証券 1銘柄	100.00%	2.64%
チェココルナ	国債証券 10銘柄	100.00%	4.36%
コロンビアペソ	国債証券 11銘柄	100.00%	7.74%
ハンガリーフォリント	国債証券 12銘柄	100.00%	4.54%
ペルーヌエボソル	国債証券 7銘柄	100.00%	2.81%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.00%	9.26%
南アフリカランド	国債証券 14銘柄	100.00%	8.22%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.00%	0.20%
ロシアルーブル	国債証券 15銘柄	100.00%	7.62%
ドミニカペソ	国債証券 1銘柄	100.00%	0.11%
ルーマニアレイ	国債証券 7銘柄	100.00%	2.54%
トルコリラ	国債証券 18銘柄	100.00%	5.74%

#### 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30年 6月25日現在]	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	182,957,250
投資証券	22,203,321,585
派生商品評価勘定	1,658,320
未収入金	56,365,449
未収配当金	102,629,755
差入委託証拠金	4,710,000
流動資産合計	22,551,642,359
資産合計	22,551,642,359
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	205,416
前受金	3,487,800
未払解約金	77,705,152
未払利息	387
流動負債合計	81,398,755
負債合計	81,398,755
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	8,199,459,366
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	14,270,784,238
元本等合計	22,470,243,604
純資産合計	22,470,243,604
負債純資産合計	22,551,642,359

## 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30年 6月25日現在]
1. 期首	平成29年 8月16日

	[平成30年 6月25日現在]
期首元本額	6,545,766,531円
期中追加設定元本額	2,871,210,596円
期中一部解約元本額	1,217,517,761円
元本の内訳	
eMAXIS 国内リートインデックス	3,970,160,413円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,231,514,368円
eMAXIS バランス（波乗り型）	178,587,885円
三菱UFJ <DC> J - REITインデックスファンド	929,656円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	135,467,338円
J - REITインデックスファンド（ラップ向け）	1,704,402,020円
オルタナティブ資産セレクション（ラップ向け）	151,178,742円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	586,819,382円
つみたて8資産均等バランス	78,730,828円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	299,855円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	440,388円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	91,663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）	33,915,347円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	4,900,769円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	9,563,372円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	45,508,338円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	37,437,845円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	19,634,109円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	4,361,649円
合計	8,199,459,366円
2. 受益権の総数	8,199,459,366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29年 8月16日 至 平成30年 6月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。



区分	自 平成29年 8月16日 至 平成30年 6月25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。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、不動産投信指数先物取引を利用してあります。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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30年 6月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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30年 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	46,985,326
合計	46,985,326

(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30年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	263,309,600		264,766,500	1,456,900
	合計	263,309,600		264,766,500	1,456,900

## （注）時価の算定方法

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	[平成30年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	2.7405円
(1万口当たり純資産額)	(27,405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	897	448,500,000	

MCUBS MidCity投資法人	3,013	250,079,000	
森ヒルズリート投資法人	2,901	409,331,100	
産業ファンド投資法人	3,137	379,577,000	
アドバンス・レジデンス投資法人	2,501	704,781,800	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,374	227,397,000	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,222	615,888,000	
GLP投資法人	5,607	653,215,500	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,024	265,625,600	
日本プロロジスリート投資法人	3,600	821,880,000	
星野リゾート・リート投資法人	427	243,390,000	
Oneリート投資法人	295	74,871,000	
イオンリート投資法人	2,565	315,238,500	
ヒューリックリート投資法人	1,834	314,897,800	
日本リート投資法人	727	238,456,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	15,914	235,368,060	
日本ヘルスケア投資法人	131	22,139,000	
積水ハウス・リート投資法人	6,767	490,607,500	
トーセイ・リート投資法人	434	48,868,400	
ケネディクス商業リート投資法人	982	239,215,200	
ヘルスケア&メディカル投資法人	333	36,663,300	
サムティ・レジデンシャル投資法人	469	45,070,900	
野村不動産マスターファンド投資法人	7,993	1,238,115,700	
いちごホテルリート投資法人	423	56,978,100	
ラサールロジポート投資法人	2,038	223,976,200	
スターアジア不動産投資法人	633	68,933,700	
マリモ地方創生リート投資法人	216	25,423,200	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	511	173,229,000	
大江戸温泉リート投資法人	453	39,320,400	
さくら総合リート投資法人	649	60,032,500	
投資法人みらい	394	74,466,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	585	86,580,000	
三菱地所物流リート投資法人	250	67,100,000	
CREロジスティクスファンド投資法人	270	30,699,000	
ザイマックス・リート投資法人	249	28,510,500	
日本ビルファンド投資法人	2,615	1,634,375,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,687	1,547,712,000	
日本リテールファンド投資法人	5,100	1,020,000,000	
オリックス不動産投資法人	5,359	942,112,200	
日本プライムリアルティ投資法人	1,705	688,820,000	
プレミア投資法人	2,439	270,241,200	
東急リアル・エステート投資法人	1,811	271,106,700	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,715	188,650,000	

ユナイテッド・アーバン投資法人	5,957	1,022,221,200	
森トラスト総合リート投資法人	1,930	306,484,000	
インヴィンシブル投資法人	7,407	373,312,800	
フロンティア不動産投資法人	919	413,090,500	
平和不動産リート投資法人	1,682	182,665,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,799	404,595,100	
福岡リート投資法人	1,397	241,681,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	833	570,605,000	
いちごオフィスリート投資法人	2,091	178,989,600	
大和証券オフィス投資法人	582	371,898,000	
阪急リート投資法人	1,179	159,754,500	
スタートアップリート投資法人	426	69,310,200	
大和ハウスリート投資法人	3,143	817,808,600	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	7,795	650,103,000	
日本賃貸住宅投資法人	3,038	265,825,000	
ジャパンエクセレント投資法人	2,419	349,545,500	
日本リート投資法人（新）	25	7,990,325	
合計	136,871	22,203,321,585	

## 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30年 6月25日現在]

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	138,879,346
コール・ローン	7,203,179
投資証券	19,426,296,488
派生商品評価勘定	193,200
未収入金	150,660
未収配当金	45,968,937
流動資産合計	19,618,691,810
資産合計	19,618,691,810
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	420
未払解約金	54,214,043

[平成30年 6月25日現在]

未払利息	15
流動負債合計	54,214,478
負債合計	54,214,478
純資産の部	
元本等	
元本	12,110,179,646
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,454,297,686
元本等合計	19,564,477,332
純資産合計	19,564,477,332
負債純資産合計	19,618,691,810

## 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 「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30年 6月25日現在]
1. 期首	平成29年 8月16日
期首元本額	11,225,225,095円
期中追加設定元本額	2,373,321,439円
期中一部解約元本額	1,488,366,888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)	181,941,917円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	128,176,717円
三菱UFJ 資産設計ファンド(分配型)	33,239,531円
三菱UFJ 資産設計ファンド(バランス型)	64,219,511円
三菱UFJ 資産設計ファンド(株式重視型)	29,015,929円
ファンド・マネジャー(海外リート)	46,461,312円
eMAXIS 先進国リートインデックス	5,565,948,698円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,127,053,546円
eMAXIS バランス(波乗り型)	307,343,286円
三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド	1,578,155,140円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	234,694,595円
オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け)	289,708,352円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	1,005,771,949円

	[平成30年 6月25日現在]
つみたて8資産均等バランス	134,649,863円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	751,371円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	942,516円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	314,365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）	56,370,996円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	12,528,341円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	24,530,616円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	116,820,497円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	85,237,087円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	67,188,740円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	7,556,446円
合計	12,110,179,646円
2. 受益権の総数	12,110,179,646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29年 8月16日 至 平成30年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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30年 6月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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30年 6月25日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		196,451,178
合計		196,451,178

(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30年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	7,677,320		7,676,900	420
	売建				
	アメリカドル	61,614,000		61,420,800	193,200
合計		69,291,320		69,097,700	192,780

## (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30年 6月25日現在 ]
1口当たり純資産額	1.6155円
(1万口当たり純資産額)	(16,155円)

附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

( 単位 : 円 )

通貨	種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
アメリカ ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	12,532	355,783.48	
		AGREE REALTY CORP	5,030	270,261.90	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	10,303	224,811.46	
		ALEXANDER'S INC	579	222,915.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	15,921	2,023,240.68	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	6,560	251,772.80	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	21,038	906,317.04	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	39,500	863,075.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST	7,200	160,272.00	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24,434	1,035,757.26	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	31,891	588,388.95	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	7,100	107,849.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15,040	109,190.40	



AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,441	3,662,766.03
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,512	31,467.52
BOSTON PROPERTIES INC	23,969	3,010,506.40
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4,550	49,322.00
BRANDYWINE REALTY TRUST	26,963	450,282.10
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	47,825	871,371.50
CAMDEN PROPERTY TRUST	14,347	1,322,649.93
CARETRUST REIT INC	11,858	200,993.10
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	24,483	151,549.77
CEDAR REALTY TRUST INC	10,860	53,322.60
CHATHAM LODGING TRUST	6,700	139,963.00
CHESAPEAKE LODGING TRUST	9,610	312,228.90
CITY OFFICE REIT INC	6,040	76,949.60
CLIPPER REALTY INC	2,958	25,586.70
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	76,835	492,512.35
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	19,011	430,599.15
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,800	82,292.00
CORECIVIC INC	18,465	432,450.30
CORESITE REALTY CORP	5,395	588,702.40
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	15,285	435,928.20
COUSINS PROPERTIES INC	64,413	621,585.45
CUBESMART	28,584	910,400.40
CYRUSONE INC	15,327	886,666.95
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	14,549	956,451.26
DDR CORP	23,934	430,812.00
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	29,928	369,311.52
DIGITAL REALTY TRUST INC	31,905	3,442,230.45
DOUGLAS EMMETT INC	24,787	998,420.36
DUKE REALTY CORP	55,560	1,597,905.60
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	6,544	127,477.12
EASTGROUP PROPERTIES INC	5,491	520,327.16
EDUCATION REALTY TRUST INC	11,701	477,751.83
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	20,337	348,576.18
EPR PROPERTIES	10,088	662,579.84
EQUITY COMMONWEALTH	19,645	620,389.10
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	13,839	1,267,652.40
EQUITY RESIDENTIAL	57,202	3,610,590.24
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,269	2,417,117.22
EXTRA SPACE STORAGE INC	19,651	1,950,754.77
FARMLAND PARTNERS INC	4,300	39,044.00
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,324	1,422,407.64
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	18,556	616,059.20

FOREST CITY REALTY TRUST- A	41,409	943,711.11
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	9,349	223,721.57
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,870	133,308.00
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	30,934	1,094,135.58
GEO GROUP INC/THE	19,102	505,820.96
GETTY REALTY CORP	4,857	134,247.48
GGP INC	97,446	2,012,259.90
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,490	85,534.50
GLADSTONE LAND CORP	2,561	32,601.53
GLOBAL MEDICAL REIT INC	3,461	32,983.33
GLOBAL NET LEASE INC	9,758	196,135.80
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	14,650	220,189.50
GRAMERCY PROPERTY TRUST	24,423	675,051.72
HCP INC	71,796	1,781,976.72
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	19,287	552,186.81
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	32,132	846,356.88
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,987	129,498.81
HIGHWOODS PROPERTIES INC	15,766	794,606.40
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	25,358	727,013.86
HOST HOTELS & RESORTS INC	113,146	2,423,587.32
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	24,007	841,685.42
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	13,709	140,243.07
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	3,000	67,710.00
INFREIT INC	5,353	114,607.73
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	17,450	103,653.00
INVITATION HOMES INC	43,395	980,727.00
IRON MOUNTAIN INC	43,081	1,507,835.00
ISTAR INC	10,178	112,263.34
JBG SMITH PROPERTIES	14,723	542,689.78
KILROY REALTY CORP	15,316	1,149,159.48
KIMCO REALTY CORP	66,575	1,191,692.50
KITE REALTY GROUP TRUST	13,202	231,299.04
LASALLE HOTEL PROPERTIES	17,867	622,128.94
LEXINGTON REALTY TRUST	34,461	309,804.39
LIBERTY PROPERTY TRUST	22,691	1,005,438.21
LIFE STORAGE INC	7,069	682,087.81
LTC PROPERTIES INC	6,190	262,517.90
MACERICH CO/THE	16,659	962,057.25
MACK-CALI REALTY CORP	13,529	279,779.72
MANULIFE US REAL ESTATE INV	184,220	159,350.30
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	5,766	61,061.94
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	56,707	800,135.77
MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,405	1,733,189.90

MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	11,376	180,195.84
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	23,860	1,043,397.80
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	7,289	216,410.41
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,520	484,370.80
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	11,900	89,607.00
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,150	86,814.00
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	8,757	127,764.63
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	30,472	971,142.64
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,310	61,353.60
PARAMOUNT GROUP INC	32,266	502,381.62
PARK HOTELS & RESORTS INC	31,542	980,009.94
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	10,319	408,838.78
PENN REAL ESTATE INVEST TST	9,960	115,934.40
PHYSICIANS REALTY TRUST	28,157	451,638.28
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	19,840	395,212.80
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	5,600	87,920.00
PROLOGIS INC	82,685	5,317,472.35
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,142	399,913.76
PUBLIC STORAGE	23,246	5,252,666.16
QTS REALTY TRUST INC-CL A	7,722	306,949.50
QUALITY CARE PROPERTIES	14,873	324,380.13
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	13,160	171,211.60
REALTY INCOME CORP	43,820	2,356,639.60
REGENCY CENTERS CORP	23,209	1,454,740.12
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	17,174	335,236.48
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	34,451	451,652.61
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	12,053	376,776.78
RLJ LODGING TRUST	26,771	598,867.27
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,848	659,938.32
SABRA HEALTH CARE REIT INC	27,407	587,057.94
SAUL CENTERS INC	2,060	109,798.00
SELECT INCOME REIT	10,300	228,660.00
SENIOR HOUSING PROP TRUST	37,362	679,988.40
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	3,980	172,652.40
SIMON PROPERTY GROUP INC	47,877	8,275,539.45
SL GREEN REALTY CORP	13,675	1,389,243.25
SPIRIT MTA REIT	6,989	72,825.38
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	69,890	575,893.60
STAG INDUSTRIAL INC	14,568	395,084.16
STORE CAPITAL CORP	26,642	725,461.66
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	16,150	232,721.50
SUN COMMUNITIES INC	12,174	1,184,286.72

		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	35,657	600,820.45
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	14,127	337,917.84
		TAUBMAN CENTERS INC	9,396	571,370.76
		TERRENO REALTY CORP	8,819	330,977.07
		TIER REIT INC	6,965	167,438.60
		UDR INC	41,444	1,542,960.12
		UMH PROPERTIES INC	4,224	63,064.32
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,832	121,040.24
		URBAN EDGE PROPERTIES	16,282	372,857.80
		URSTADT BIDDLE - CLASS A	4,540	104,102.20
		VENTAS INC	54,875	3,055,988.75
		VEREIT INC	152,089	1,146,751.06
		VORNADO REALTY TRUST	26,885	1,980,080.25
		WASHINGTON PRIME GROUP INC	29,375	243,225.00
		WASHINGTON REIT	12,465	369,836.55
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	18,454	584,807.26
		WELLTOWER INC	57,542	3,397,855.10
		WHEELER REAL ESTATE INVESTME	1,347	5,374.53
		WHITESTONE REIT	5,510	68,819.90
		WP CAREY INC	16,707	1,110,347.22
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	16,920	419,954.40
アメリカドル合計			3,640,305	127,075,873.58 (13,938,952,572)
カナダドル	投資証券	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	2,100	28,371.00
		ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7,300	306,089.00
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	12,290	165,177.60
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,810	177,203.10
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	10,380	448,416.00
		CHOICE PROPERTIES REIT	18,387	222,850.44
		COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	14,470	186,373.60
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,730	87,490.00
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	5,400	70,200.00
		DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	14,300	207,779.00
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	4,700	48,457.00
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,310	125,953.20
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,300	177,672.00
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	21,709	441,995.24
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	8,000	87,840.00
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	6,500	96,915.00
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2,600	40,092.00
		MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	3,500	46,725.00
		NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	3,550	92,016.00

		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	8,100	92,583.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	24,970	607,769.80	
		SLATE OFFICE REIT	5,600	43,064.00	
		SLATE RETAIL REIT - U	2,500	32,475.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	9,700	295,753.00	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	5,200	45,344.00	
カナダドル合計			210,406	4,174,603.98	(344,363,082)
オーストラリアドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	50,911	200,589.34	
		ARENA REIT	45,017	99,487.57	
		BWP TRUST	70,400	234,432.00	
		CHARTER HALL GROUP	71,692	473,167.20	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	30,000	132,000.00	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	47,236	205,476.60	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	254,970	285,566.40	
		DEXUS	155,115	1,546,496.55	
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	30,661	82,171.48	
		GDI PROPERTY GROUP	75,226	99,298.32	
		GOODMAN GROUP	249,905	2,461,564.25	
		GPT GROUP	275,606	1,433,151.20	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	36,560	134,906.40	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	24,700	80,028.00	
		INDUSTRIA REIT	11,950	30,831.00	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	26,871	74,701.38	
		INVESTA OFFICE FUND	77,196	404,507.04	
		MIRVAC GROUP	574,847	1,293,405.75	
		NATIONAL STORAGE REIT	87,273	143,127.72	
		PROPERTYLINK GROUP	87,700	94,277.50	
		RURAL FUNDS GROUP	35,545	76,066.30	
		SCENTRE GROUP	828,425	3,620,217.25	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	106,446	272,501.76	
STOCKLAND	373,446	1,564,738.74			
VICINITY CENTRES	493,354	1,341,922.88			
VIVA ENERGY REIT	73,240	159,663.20			
オーストラリアドル合計			4,194,292	16,544,295.83	(1,346,374,794)
イギリス ポンド	投資証券	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	10,000	9,160.00	
		ASSURA PLC	356,220	206,607.60	
		BIG YELLOW GROUP PLC	23,550	224,196.00	
		BRITISH LAND CO PLC	155,022	1,065,931.27	
		CAPITAL & REGIONAL PLC	75,688	39,509.13	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	28,000	29,260.00	

		DERWENT LONDON PLC	17,157	529,979.73	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	86,400	75,859.20	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	42,702	305,959.83	
		HAMMERSON PLC	122,982	656,231.95	
		HANSTEEN HOLDINGS PLC	58,000	61,886.00	
		INTU PROPERTIES PLC	135,828	260,586.01	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	116,033	1,105,214.32	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	104,000	194,480.00	
		LXI REIT PLC	35,000	38,675.00	
		NEWRIVER REIT PLC	47,483	128,678.93	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	112,520	129,848.08	
		RDI REIT PLC	225,076	79,114.21	
		REGIONAL REIT LTD	51,527	48,950.65	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	32,563	174,212.05	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	74,320	46,450.00	
		SEGRO PLC	155,049	1,026,734.47	
		SHAFTESBURY PLC	37,747	353,311.92	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	226,420	348,686.80	
		UNITE GROUP PLC	41,194	348,295.27	
		WORKSPACE GROUP PLC	18,681	207,732.72	
イギリス債券合計			2,389,162	7,695,551.14	(1,118,625,313)
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	328,000	1,754,800.00	
		FORTUNE REIT	215,000	1,999,500.00	
		LINK REIT	334,000	23,380,000.00	
		PROSPERITY REIT	178,000	571,380.00	
		SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	154,000	514,360.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	163,000	891,610.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	189,000	1,014,930.00	
香港ドル合計			1,561,000	30,126,580.00	(421,169,588)
シンガポールドル	投資証券	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	83,400	114,258.00	
		ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	121,000	93,170.00	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	377,700	982,020.00	
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	188,400	201,588.00	
		CACHE LOGISTICS TRUST	169,000	127,595.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	404,000	662,560.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	420,900	854,427.00	
		CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	97,800	144,744.00	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	111,300	179,193.00	
		ESR-REIT	231,500	113,435.00	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	143,000	90,090.00	

		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	94,200	126,228.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	96,000	210,240.00	
		FRASERS COMMERCIAL TRUST	106,100	145,357.00	
		FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	247,600	255,028.00	
		KEPPEL DC REIT	144,000	194,400.00	
		KEPPEL REIT	267,500	296,925.00	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	281,200	88,578.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	291,100	457,027.00	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	194,500	369,550.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	312,600	384,498.00	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	330,500	376,770.00	
		QUE HOSPITALITY TRUST	175,500	137,767.50	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	55,500	144,300.00	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	133,000	57,190.00	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	105,000	68,250.00	
		SPH REIT	105,700	104,643.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	232,000	150,800.00	
		SUNTEC REIT	344,100	581,529.00	
シンガポールドル合計			5,864,100	7,712,160.50	(621,677,257)
ニュー ジーラン ドドル	投資証券	ARGOSY PROPERTY LTD	126,325	137,062.62	
		GOODMAN PROPERTY TRUST	153,990	222,515.55	
		INVESTORE PROPERTY LTD	30,492	45,128.16	
		KIWI PROPERTY GROUP LTD	219,350	297,219.25	
		PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	141,990	189,556.65	
		STRIDE PROPERTY GROUP	52,240	96,121.60	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	49,034	99,293.85	
ニュージーランドドル合計			773,421	1,086,897.68	(82,397,713)
イスラエ ルシェケ ル	投資証券	REIT 1 LTD	28,880	409,807.20	
イスラエルシェケル合計			28,880	409,807.20	(12,466,335)
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	2,730	215,397.00	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	21,203	275,426.97	
		ALTAREA	575	116,725.00	
		AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	1,500	26,190.00	
		BEFIMMO	3,683	193,357.50	
		BENI STABILI SPA	147,262	110,225.60	
		COFINIMMO	3,102	322,918.20	
		COFINIMMO-RTS	3,102	2,208.62	
		COVVIVIO	8,363	743,052.55	

	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	7,712	281,488.00	
	GECINA SA	7,521	1,078,511.40	
	GREEN REIT PLC	101,737	154,640.24	
	HAMBORNER REIT AG	13,230	120,260.70	
	HIBERNIA REIT PLC	109,250	169,774.50	
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	16,540	301,193.40	
	ICADE	6,881	557,016.95	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	8,678	61,353.46	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	50,200	476,147.00	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	2,650	57,770.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	53,000	73,352.00	
	KLEPIERRE	32,370	1,067,886.30	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14,680	137,992.00	
	MERCIALYS	8,165	123,046.55	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	51,811	650,228.05	
	NSI NV	2,568	91,292.40	
	RETAIL ESTATES	1,280	98,176.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	20,887	3,982,106.55	
	VASTNED RETAIL NV	2,476	100,154.20	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,400	260,160.00	
	WERELDHAVE NV	6,041	202,252.68	
ユーロ合計		711,597	12,050,303.82 (1,540,269,834)	
	合計		19,426,296,488 (19,426,296,488)	

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 161銘柄	100.00%	71.75%
カナダドル	投資証券 25銘柄	100.00%	1.77%
オーストラリアドル	投資証券 26銘柄	100.00%	6.93%
イギリスポンド	投資証券 26銘柄	100.00%	5.76%
香港ドル	投資証券 7銘柄	100.00%	2.17%
シンガポールドル	投資証券 29銘柄	100.00%	3.20%
ニュージーランドドル	投資証券 7銘柄	100.00%	0.42%
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 30銘柄	100.00%	7.93%



## 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】

## 【つみたて8資産均等バランス】

## 【純資産額計算書】

平成30年 6月29日現在

（単位：円）

資産総額	1,803,044,201
負債総額	478,154
純資産総額（ - ）	1,802,566,047
発行済口数	1,743,951,418口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.0336
（10,000口当たり）	（10,336）

（参考）

## TOPIXマザーファンド

## 純資産額計算書

平成30年 6月29日現在

（単位：円）

資産総額	311,687,181,687
負債総額	42,942,383,084
純資産総額（ - ）	268,744,798,603
発行済口数	146,189,534,708口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.8383
（10,000口当たり）	（18,383）

## 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30年 6月29日現在

（単位：円）

資産総額	342,863,975,329
負債総額	5,852,200,531
純資産総額（ - ）	337,011,774,798
発行済口数	126,898,633,732口

1口当たり純資産価額（ / ）	2.6558
（10,000口当たり）	（26,558）

## 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30年 6月29日現在

（単位：円）

資産総額	69,098,616,139
負債総額	830,333,071
純資産総額（ - ）	68,268,283,068
発行済口数	28,340,207,922口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.4089
（10,000口当たり）	（24,089）

## 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30年 6月29日現在

（単位：円）

資産総額	567,562,267,329
負債総額	12,961,106,336
純資産総額（ - ）	554,601,160,993
発行済口数	416,608,690,340口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.3312
（10,000口当たり）	（13,312）

## 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30年 6月29日現在

（単位：円）

資産総額	118,858,177,576
負債総額	328,833,769
純資産総額（ - ）	118,529,343,807
発行済口数	59,000,056,520口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.0090

( 10,000口当たり )	( 20,090 )
----------------	------------

## 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30年 6月29日現在

( 単位：円 )

資産総額	17,598,324,628
負債総額	448,528,848
純資産総額 ( - )	17,149,795,780
発行済口数	13,291,733,186口
1口当たり純資産価額 ( / )	1.2903
( 10,000口当たり )	( 12,903 )

## 東証REIT指数マザーファンド

## 純資産額計算書

平成30年 6月29日現在

( 単位：円 )

資産総額	22,740,267,795
負債総額	74,604,066
純資産総額 ( - )	22,665,663,729
発行済口数	8,182,059,492口
1口当たり純資産価額 ( / )	2.7702
( 10,000口当たり )	( 27,702 )

## MUAM G-REITマザーファンド

## 純資産額計算書

平成30年 6月29日現在

( 単位：円 )

資産総額	19,791,381,791
負債総額	19,579,279
純資産総額 ( - )	19,771,802,512
発行済口数	12,150,191,066口
1口当たり純資産価額 ( / )	1.6273
( 10,000口当たり )	( 16,273 )

#### 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るときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

##### （5）受益権の譲渡の対抗要件

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

##### （6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額等

平成30年6月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

###### (2) 委託会社の機構

###### ・会社の意思決定機構

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

###### ・投資運用の意思決定機構

###### 投資環境見通しの策定

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

###### 運用戦略の決定

運用戦略委員会において、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。

平成30年6月29日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	864	12,127,521
追加型公社債投資信託	16	1,301,252
単位型株式投資信託	58	309,078
単位型公社債投資信託	1	6,001
合計	939	13,743,851

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

### 3【委託会社等の経理状況】

#### (1) 財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJ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。

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。

#### (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)		第33期 (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 (平成29年3月31日現在)	第33期 (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 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
評価・換算差額等		
その他有価証券 評価差額金	1,494,586	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 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 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 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第33期 (自 平成29年4月1日 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								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		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		利益剰余金合計	
						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	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
株主資本以外の項目の当期変動額(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
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
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 項目の当期変動額 (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			
						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	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 項目の当期変動額 (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 有価証券 評価差額金	評価・換算 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 項目の当期変動額 (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 (平成29年3月31日現在)	第33期 (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 (平成29年3月31日現在)	第33期 (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 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 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 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第33期 (自 平成29年4月1日 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 （遊休資産）	ソフトウェア 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つのグループニ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ニ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 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	211,581	-	-	211,581
合計	211,581	-	-	211,581

#### 2. 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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 (平成29年3月31日現在)	第33期 (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 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 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 (平成29年3月31日現在)	第33期 (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 5年以内	5年超 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 5年以内	5年超 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 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	17,778,798	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 が取得原価を超え 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 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	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 が取得原価を超え 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 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）	第33期 （自平成29年4月1日 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 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）	第33期 （自平成29年4月1日 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 (平成29年3月31日現在)	第33期 (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 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 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 (平成29年3月31日現在)	第33期 (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 (平成29年3月31日現在)	第33期 (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 (平成29年3月31日現在)	第33期 (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	2,141,513百万円	銀行持株会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税 役員の兼任	連結納税に伴う支払	4,204,969千円	その他未払金	2,071,256千円
親	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279百万円	信託業、銀行業	被所有 直接 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	5,983,874千円	未払手数料	716,117千円

会社						投資の助言 役員の兼任	投資助言料	662,992 千円	未払費用	352,297 千円
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 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 千円	未払手数料	1,276,937 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 百万円	銀行持株会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税	連結納税に伴う支払	3,851,587 千円	その他未払金	3,850,734 千円
親会社	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、銀行業	被所有 直接 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 千円	未払手数料	665,262 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料	664,152 千円	未払費用	348,142 千円
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 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 千円	未払手数料	921,796 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おります。

## (2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第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
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	6,532,238 千円	未払手数料	933,908 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
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	6,263,571 千円	未払手数料	907,290 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おります。

## 2.親会社に関する注記

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

三菱UFJ信託銀行株式会社(非上場)



## （ 1 株当たり情報）

	第32期 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	第33期 （自 平成29年4月1日 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、記載しておりません。

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 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	第33期 （自 平成29年4月1日 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（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

## 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（平成30年3月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

## (2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成30年3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。
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。
株式会社秋田銀行	14,100 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。
株式会社七十七銀行	24,658 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社群馬銀行	48,652 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。
株式会社横浜銀行	215,628 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。
株式会社八十二銀行	52,243 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。
株式会社十六銀行	36,839 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。
株式会社京都銀行	42,103 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社紀陽銀行	80,096 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。
株式会社阿波銀行	23,452 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社百十四銀行	37,322 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社伊予銀行	20,948 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。
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。
株式会社あおぞら銀行	100,000 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社大光銀行	10,000 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社福岡中央銀行	2,500 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。
京都信用金庫	12,382 百万円	金融業務を営んでいます。
株式会社ゆうちょ銀行	3,500,000 百万円	銀行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。
いちよし証券株式会社	14,577 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。
四国アライアンス証券株式会社	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。

宇都宮証券株式会社	301 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。
エース証券株式会社	8,831 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。
静銀ティーエム証券株式会社	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。
高木証券株式会社	11,069 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。
むさし証券株式会社	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。
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。
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。
野村證券株式会社	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。
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。
FFG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。
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。
丸八証券株式会社	3,751 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。

京都信用金庫の資本金の額は「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。（平成30年6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 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 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30年7月25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」に掲げられているつみたて8資産均等バランスの平成29年8月16日から平成30年6月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

**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、つみたて8資産均等バランスの平成30年6月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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。