

【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】	2026年9月24日提出
【発行者名】	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 川上 豊
【本店の所在の場所】	東京都港区東新橋一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【電話番号】	03-4223-3037
【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】	ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）
【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】

ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）（「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ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

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

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

（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。

（７）【申込期間】

2026年 9月25日から2027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。

販売会社は、下記にてご確認ください。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

（１１）【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

当ファンドは、ラップ口座に係る契約[※]に基づいてラップ口座の資金を運用するためのファンドであり、当ファンドの取得申込者は、販売会社にラップ口座を開設のうえ申込みを行うものとします。

※同様の権利義務関係を規定する契約の名称は販売会社によって異なります。

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、値上がり益の獲得および利子収益の確保をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000億円です。

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

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

商品分類表

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

属性区分表

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

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

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

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

商品分類の定義

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

※上記定義は一般社団法人資産運用業協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

属性区分の定義

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

有価証券届出書（内国投資信託）

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

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

※上記定義は一般社団法人資産運用業協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

日本を含む先進国の株式および公社債等を実質的な主要投資対象とし、値上がり利益の獲得および利子収益の確保をめざします。

ファンドの特色

特色

1

日本を含む先進国の株式および公社債等に投資を行います。

※実際の運用は各マザーファンドへの投資を通じて行います。

<投資対象とするマザーファンドと運用目標>

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

*為替ヘッジを行うマザーファンドです。

1 上記の他、短期金融資産に投資することがあります。

特色

2

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

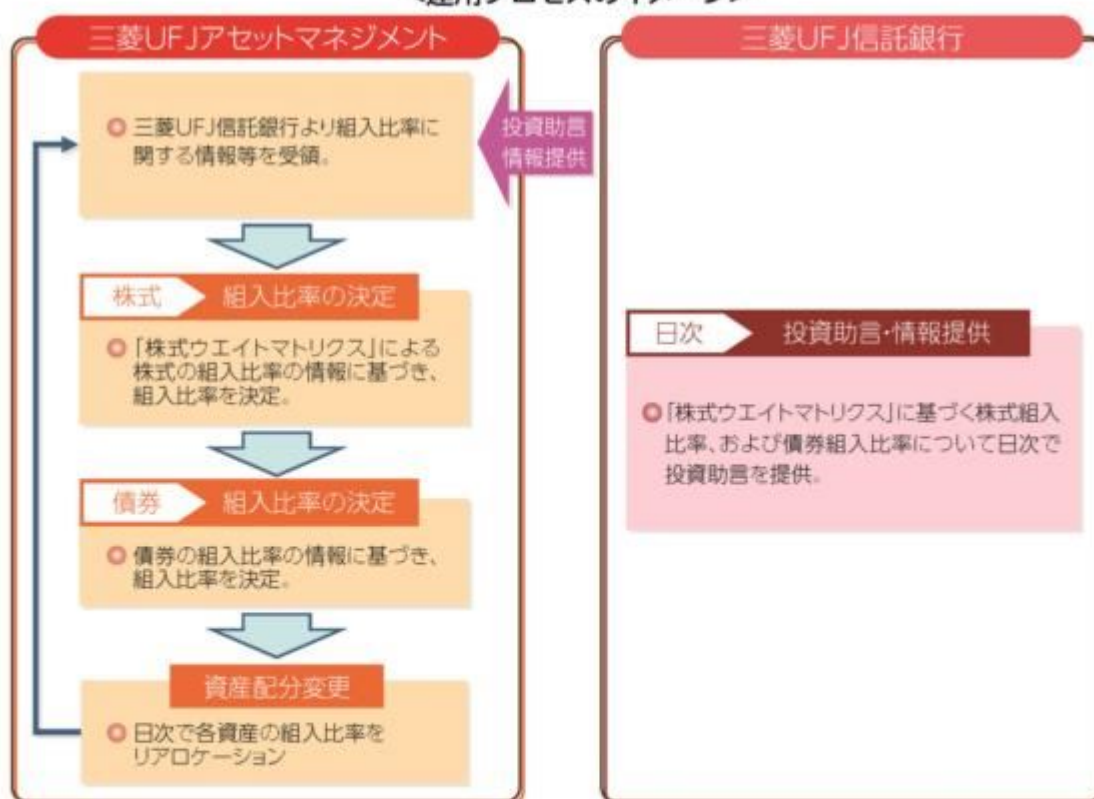
■運用方法・運用プロセス

<組入比率変更のイメージ>



❗ 上記はファンドの組入比率の変更をご理解いただくためにイメージとして示したもので、実際とは異なる場合があります。

<運用プロセスのイメージ>



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

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

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

<株式ウェイトマトリクスのイメージ>



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

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

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



実質組入外貨建資産について為替ヘッジを行う場合があります。

- 投資対象とするマザーファンドによっては、組入外貨建資産について為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図っている場合があります。
 - ただし、為替ヘッジにより、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。
 - 為替ヘッジを行わない場合は、為替相場の変動による影響を受けます。
- ❗ 為替ヘッジ（為替取引）を行うにあたっては、対象通貨間の金利差に基づくヘッジコスト（為替取引によるコスト）がかかります。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコスト（為替取引によるコスト）となる場合があります。

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。

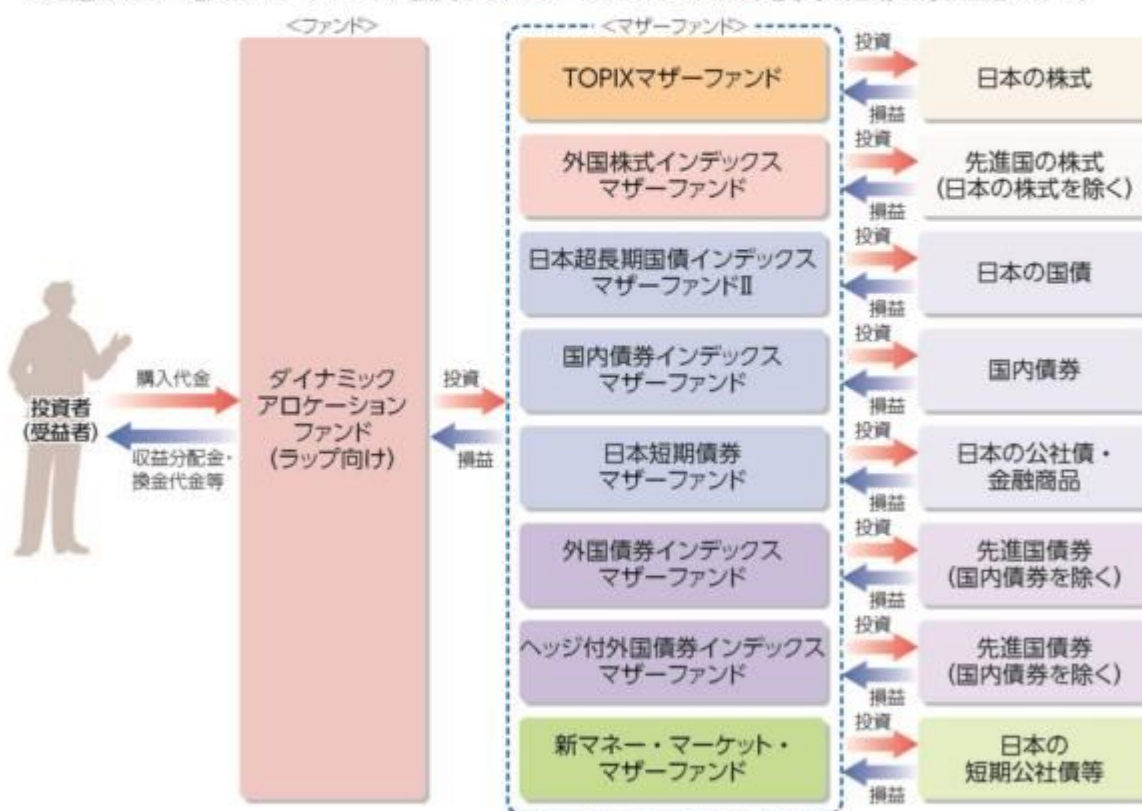
分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

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

ファミリーファンド方式により、運用を行います。

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



主な投資制限

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



指数について

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

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

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

・NOMURA-BPI国債 超長期(11-)とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表している日本国が発行した固定利付債(個人向けは対象外)の残存期間11年以上の債券のパフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI国債のサブインデックスです。

当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

・NOMURA-BPI総合とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

・NOMURA-BPI短期インデックスとは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表しているわが国の残存期間1年から3年の債券で構成されている債券パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI総合のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

①委託会社およびファンドの関係法人の役割

投資家（受益者）	
お申込金↓↑収益分配金、解約代金等	
販売会社	募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。
お申込金↓↑収益分配金、解約代金等	
受託会社（受託者） 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）	委託会社（委託者） 三菱UFJアセットマネジメント株式会社

信託財産の保管・管理等を行います。

投資↓↑損益

マザーファンド

投資↓↑損益

有価証券等

信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。

②委託会社と関係法人との契約の概要

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

③委託会社の概況（2026年6月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・設立年月日
1985年8月1日
- ・資本金
2,000百万円
- ・沿革
1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
2005年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
2015年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更
2023年10月 エム・ユー投資顧問株式会社の有価証券運用事業を三菱UFJ国際投信株式会社へ統合し、商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更

・大株主の状況

株主名	住所	所有株式数	所有比率
株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	211,581株	100.0%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

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

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

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券および新マネー・マーケット・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国を含む先進国の株式および公社債等に投資を行います。

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

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

実質組入外貨建資産については、為替ヘッジを行う場合があります。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（２）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ａ. 有価証券先物取引等

ｂ. スワップ取引

ｃ. 金利先渡取引および為替先渡取引

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

②有価証券の指図範囲

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

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

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

11. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

③金融商品の指図範囲

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

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

④その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

<マザーファンドの概要>

TOPIXマザーファンド

（基本方針）

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

（運用方法）

①投資対象

東京証券取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

②投資態度

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

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

管理に基づいたポートフォリオ構築と適切な売買執行を行います。

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

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

（投資制限）

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

外国株式インデックスマザーファンド

（基本方針）

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

（運用方法）

①投資対象

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

②投資態度

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

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

・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

（投資制限）

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

⑩外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ

（基本方針）

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

（運用方法）

①投資対象

わが国の国債を主要投資対象とします。

②投資態度

主としてわが国の国債に投資を行います。

国債の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

⑦外貨建資産への投資は行いません。

⑧有価証券先物取引等を行うことができます。

⑨スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

国内債券インデックスマザーファンド

（基本方針）

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

（運用方法）

①投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

主としてわが国の公社債に投資を行います。

公社債の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

⑦外貨建資産への投資は行いません。

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

日本短期債券マザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、信託財産の安定的な成長をめざして運用を行います。

（運用方法）

①投資対象

わが国の公社債・金融商品を主要投資対象とします。

②投資態度

ポートフォリオのデュレーション調整と銘柄選択による収益獲得をめざして運用を行います。

ポートフォリオのデュレーションはベンチマークの平均を中心に調整します。デュレーション調整は主としてファンダメンタルズ分析に基づく中期的な金利見通しに沿って行います。

銘柄選択は信用リスクと金利スプレッドを定量的・定性的に分析して行います。

NOMURA－BPI短期インデックスをベンチマークとし、同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。

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

（投資制限）

- ①同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ②外貨建資産への投資は行いません。
- ③有価証券先物取引等を行うことができます。
- ④スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを減じる目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国債券インデックスマザーファンド

（基本方針）

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

（運用方法）

①投資対象

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

②投資態度

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

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

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

- ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

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

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

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

（基本方針）

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

（運用方法）

①投資対象

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

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

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

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

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

新マネー・マーケット・マザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、主として安定した利子収益の確保をめざして運用を行います。

（運用方法）

①投資対象

わが国の公社債等を主要投資対象とします。

②投資態度

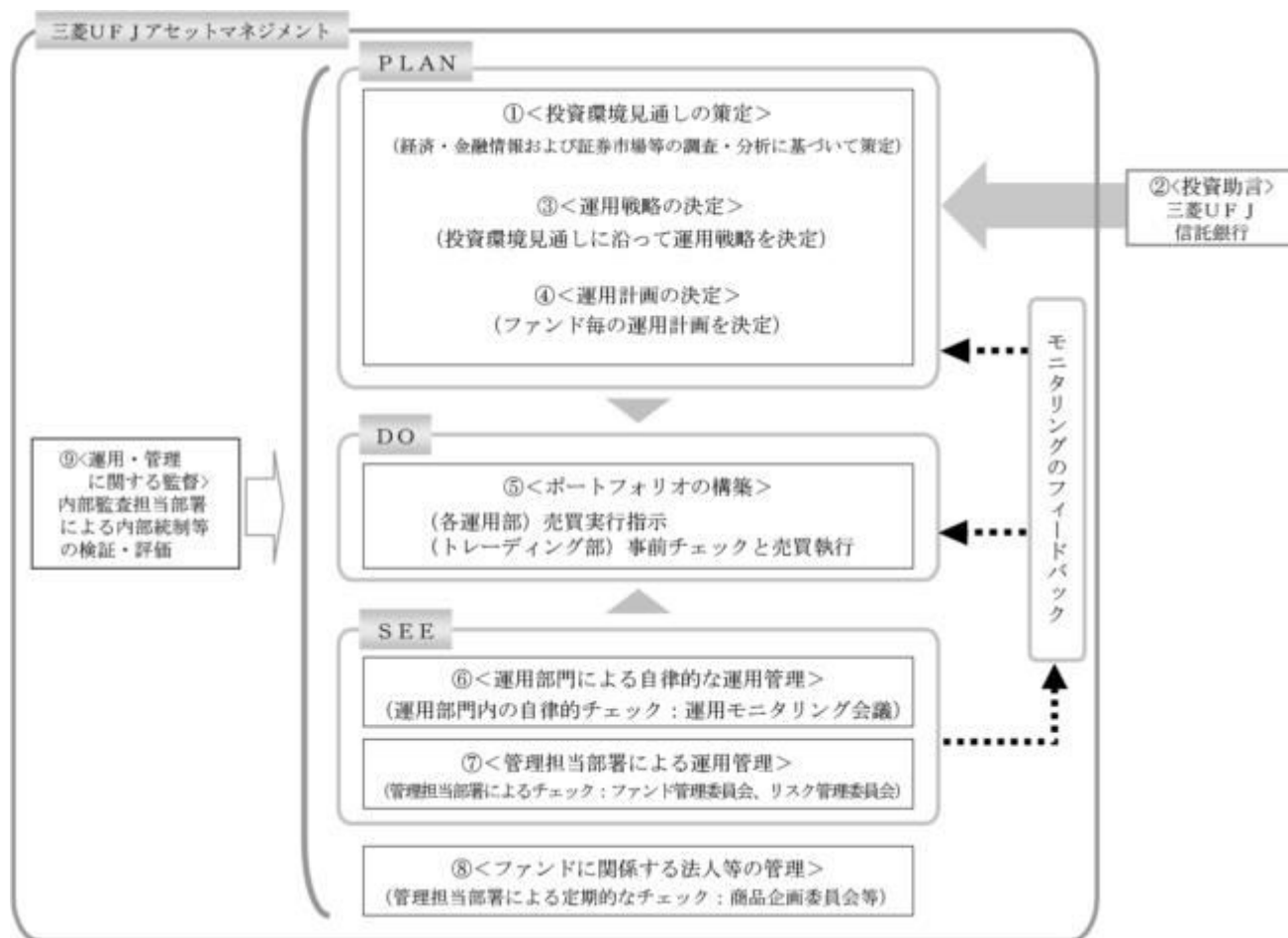
主としてわが国の短期公社債等に投資を行います。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

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

(3) 【運用体制】



①投資環境見通しの策定

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

②投資助言

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

③運用戦略の決定

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

④運用計画の決定

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

⑤ポートフォリオの構築

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

⑥運用部門による自律的な運用管理

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

⑦管理担当部署による運用管理

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

⑧ファンドに関係する法人等の管理

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

⑨運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

「運用担当者に係る事項」 https://www.am.mufig.jp/investment_policy/fm.html

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

（５）【投資制限】

＜信託約款に定められた投資制限＞

①新株引受権証券および新株予約権証券

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

②投資信託証券

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

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

⑦公社債の借入れ

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

⑧資金の借入れ

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

⑨投資する株式等の範囲

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

⑩金利先渡取引および為替先渡取引

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

⑪有価証券の貸付

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

⑫特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められ

る場合には、制限されることがあります。

⑬デリバティブ取引等

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

⑭信用リスクの分散規制

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

＜その他法令等に定められた投資制限＞

・同一の法人の発行する株式への投資制限

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

3【投資リスク】

（1）投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

（主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。）

価格変動 リスク	・株式の価格は、株式市場全体の動向のほか、発行企業の業績や業績に対する市場の見通しなどの影響を受けて変動します。組入株式の価格の下落は、基準価額の下落要因となります。 ・債券の価格は、市場金利の変動の影響を受けて変動します。一般に市場金利が上がると、債券の価格は下落し、組入債券の価格の下落は基準価額の下落要因となります。市場金利の変動による債券価格の変動は、一般にその債券の残存期間が長いほど大きくなる傾向があります。
為替変動 リスク	投資対象とするマザーファンドによっては、組入外貨建資産について為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図っている場合があります。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨建の金利より低いときには、これらの金利差相当分がヘッジコストとなります。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。 また、為替ヘッジを行わない場合は、為替変動の影響を受けます。
信用リスク	有価証券等の発行企業の経営、財務状況が悪化したり、市場においてその懸念が高まった場合には、有価証券等の価格が下落（債券の場合は利回りが上昇）すること、配当金が減額あるいは支払いが停止、または利払いや償還金の支払いが滞ること、倒産等によりその価値がなくなること等があります。
流動性 リスク	有価証券等を売買しようとする際に、その有価証券等の取引量が十分でない場合や規制等により取引が制限されている場合には、売買が成立しなかったり、十分な数量の売買が出来なかったり、ファンドの売買自体によって市場価格が動き、結果として不利な価格での取引となる場合があります。

※留意事項

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

（２）投資リスクに対する管理体制

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

また、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策を策定し流動性リスクの評価と管理プロセスの検証などを行います。リスク管理委員会は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

①コンプライアンス担当部署

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

②リスク管理担当部署

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

③内部監査担当部署

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

＊組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

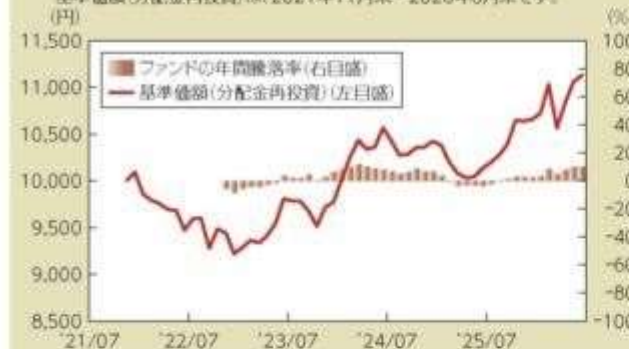
■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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

● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

ファンドの年間騰落率は、2022年11月～2026年6月です。

基準価額(分配金再投資)は、2021年11月末～2026年6月末です。



● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2021年7月末～2026年6月末)

ファンドの年間騰落率は、2022年11月～2026年6月です。



(注) 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

●年間騰落率は、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。

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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

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

（２）【換金（解約）手数料】

かかりません。

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

（３）【信託報酬等】

・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年0.176%（税抜0.160%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

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

※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

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

・信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.105%	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等
販売会社	0.030%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	0.025%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

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

１．収益分配金の課税

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

原則として、20.315%（所得税15.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。

2. 解約時および償還時の課税

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

20.315%（所得税15.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

◇個別元本について

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

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

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

◇収益分配金について

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

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

※上記は2026年6月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

(参考情報)ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間(以下「当期間」といいます。)(2025年6月26日～2026年6月25日)における当ファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
0.19%	0.18%	0.01%

(比率は年率、表示桁数未満四捨五入)

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

詳細につきましては、当期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

【ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）】

(1)【投資状況】

2026年 6月30日現在
(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	36,990,703,764	99.97
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	12,895,970	0.03
純資産総額		37,003,599,734	100.00

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

(2)【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位 30 銘柄

2026年 6月30日現在

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

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2026年 6月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.97
合計	99.97

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

①【純資産の推移】

下記計算期間末日および2026年6月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

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

②【分配の推移】

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

③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第1計算期間	△5.21

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

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

（４）【設定及び解約の実績】

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

（参考）

TOPIXマザーファンド

投資状況

2026年 6月30日現在
(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	日本	2,911,562,086,090	99.52
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	14,186,281,731	0.48
純資産総額		2,925,748,367,821	100.00

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

その他の資産の投資状況

2026年 6月30日現在
(単位：円)

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	9,407,050,000	0.32

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

2026年 6月30日現在

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

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

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2026年 6月30日現在

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

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

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

2026年 6月30日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX 26年09月限	買建	235	円	9,375,736,425	9,407,050,000	0.32

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

外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

2026年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	アメリカ	11,866,714,189,480	74.92
	イギリス	556,464,892,484	3.51

	カナダ	555,353,300,264	3.51
	スイス	390,040,759,955	2.46
	フランス	352,192,594,504	2.22
	ドイツ	346,904,845,679	2.19
	オランダ	288,364,450,313	1.82
	オーストラリア	248,083,662,727	1.57
	スペイン	154,613,597,189	0.98
	スウェーデン	121,649,160,346	0.77
	イタリア	119,591,262,955	0.76
	デンマーク	67,873,964,508	0.43
	香港	63,928,155,367	0.40
	シンガポール	56,164,790,855	0.35
	フィンランド	48,381,845,097	0.31
	イスラエル	36,056,760,882	0.23
	ベルギー	35,658,656,211	0.23
	ノルウェー	22,962,504,702	0.14
	アイルランド	16,084,283,461	0.10
	オーストリア	14,081,902,063	0.09
	ルクセンブルク	8,814,930,430	0.06
	ポルトガル	7,366,293,946	0.05
	ニュージーランド	7,031,977,072	0.04
	バミューダ	1,954,783,373	0.01
	ジャージー	482,605,062	0.00
	小計	15,386,816,168,925	97.14
投資証券	アメリカ	209,192,983,517	1.32
	オーストラリア	13,510,918,995	0.09
	フランス	5,109,890,471	0.03
	シンガポール	3,796,559,063	0.02
	イギリス	3,722,006,070	0.02
	香港	2,191,041,787	0.01
	小計	237,523,399,903	1.50
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	214,828,276,659	1.36
純資産総額		15,839,167,845,487	100.00

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

その他の資産の投資状況

2026年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	184,339,093,181	1.16
	買建	カナダ	8,627,018,664	0.05
	買建	ドイツ	26,169,670,296	0.17

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

2026年 6月30日現在

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

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

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2026年 6月30日現在

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

	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.72
	銀行	6.95
	金融サービス	6.02
	保険	2.66
	ソフトウェア・サービス	6.90
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.98
	電気通信サービス	1.17
	公益事業	2.70
	半導体・半導体製造装置	15.04
	不動産管理・開発	0.18
	小計	97.14
投資証券	—	1.50
合計		98.64

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

2026年 6月30日現在

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

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

国内債券インデックスマザーファンド

投資状況

2026年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	日本	130,786,277,700	83.75
地方債証券	日本	9,470,714,100	6.06

特殊債券	日本	5,595,627,452	3.58
社債券	日本	8,682,997,000	5.56
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	1,634,708,346	1.05
純資産総額		156,170,324,598	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

2026年 6月30日現在

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

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

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2026年 6月30日現在

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

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

日本短期債券マザーファンド

投資状況

2026年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
社債券	日本	15,008,004,000	98.55
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	220,430,298	1.45
純資産総額		15,228,434,298	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位３０銘柄

2026年 6月30日現在

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

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

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2026年 6月30日現在

種類	投資比率（％）
社債券	98.55
合計	98.55

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

2026年 6月30日現在

（単位：円）

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

	デンマーク	765,932,006	0.21
	スウェーデン	675,977,101	0.19
	ノルウェー	583,388,683	0.16
	小計	357,844,000,036	98.38
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	5,875,773,586	1.62
純資産総額		363,719,773,622	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

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

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

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2026年 6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.38
合計	98.38

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

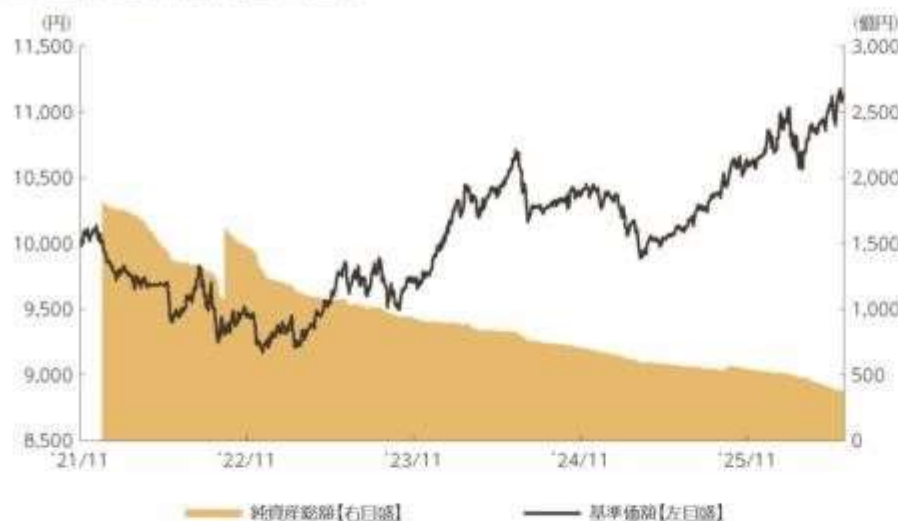
《参考情報》



運用実績

2026年6月30日現在

■基準価額・純資産の推移 2021年11月30日(設定日)～2026年6月30日



■基準価額・純資産

基準価額	11,130円
純資産総額	370.0億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2026年 6月	0円
2025年 6月	0円
2024年 6月	0円
2023年 6月	0円
2022年 6月	0円
設定来累計	0円

●分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

資産別構成	比率
国内株式	19.9%
国内債券	30.8%
外国株式	17.4%
外国債券	30.6%
コールローン他 (負債控除後)	1.3%
合計	100.0%

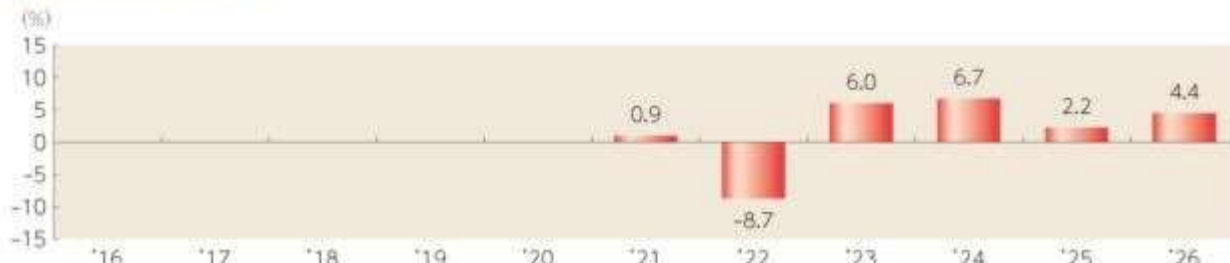
組入上位通貨	比率
1 円	82.1%
2 アメリカドル	13.8%
3 ユーロ	1.7%
4 イギリスポンド	0.6%
5 カナダドル	0.6%
6 スイスフラン	0.4%
7 オーストラリアドル	0.3%
8 スウェーデンクローネ	0.1%
9 デンマーククローネ	0.1%
10 香港ドル	0.1%

組入上位銘柄	種類	業種／種別	国・地域	比率
NVIDIA CORP.	株式	半導体・半導体製造装置	アメリカ	0.9%
APPLE INC.	株式	テクノロジー・ハードウェア機器	アメリカ	0.9%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	日本	0.7%
東京エレクトロン	株式	電気機器	日本	0.6%
MICROSOFT CORP.	株式	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.5%
第180回利付国債(5年)	債券	国債	日本	0.8%
第478回利付国債(2年)	債券	国債	日本	0.6%
第172回利付国債(5年)	債券	国債	日本	0.6%
第177回利付国債(5年)	債券	国債	日本	0.6%
第183回利付国債(5年)	債券	国債	日本	0.6%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引（買建）	0.3%

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

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2021年は11月30日（設定日）から年末までの、2026年は年初から6月30日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

①申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

②申込単位

販売会社が定める単位

③申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

④申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑤申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認ください。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑥申込手数料

ありません。

⑦申込方法

取得申込者は、販売会社取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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

⑧申込受付時間

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

⑨取得申込みの受付の中止および取消し

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

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

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

①解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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

②解約単位

販売会社が定める単位

③解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

④信託財産留保額

ありません。

⑤解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑦支払開始日

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

⑧解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時30分までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

⑨解約請求受付の中止および取消し

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

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

①基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

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

（資産の評価方法）

・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

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

・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

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

・公社債等

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

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

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

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

・外国為替予約取引

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

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

②基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

③基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

2031年6月25日まで（2021年11月30日設定）

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

（４）【計算期間】

毎年6月26日から翌年6月25日まで

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

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

①ファンドの償還条件等

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

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

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

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

②信託約款の変更等

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

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

③ファンドの償還等に関する開示方法

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

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

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

④反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

⑤関係法人との契約の更改

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

⑥運用報告書

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

⑦委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

⑧受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

⑨信託事務の再信託

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

⑩公告

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

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

①分配金受取コース（一般コース）

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

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

②分配金再投資コース（累積投資コース）

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

（2）償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

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

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

（3）換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（2025年6月26日から2026年6月25日まで）の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

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

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自 2024年 6月26日 至 2025年 6月25日	第5期 自 2025年 6月26日 至 2026年 6月25日
営業収益		
受取利息	36,654,721	45,631,920
有価証券売買等損益	△2,881,753,426	4,920,841,177
営業収益合計	△2,845,098,705	4,966,473,097
営業費用		
受託者報酬	18,794,198	14,019,523
委託者報酬	101,488,581	75,705,319
その他費用	2,330,361	1,738,297
営業費用合計	122,613,140	91,463,139
営業利益又は営業損失（△）	△2,967,711,845	4,875,009,958
経常利益又は経常損失（△）	△2,967,711,845	4,875,009,958
当期純利益又は当期純損失（△）	△2,967,711,845	4,875,009,958
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△521,279,645	1,490,736,994
期首剰余金又は期首欠損金（△）	4,228,667,255	572,421,749
剰余金増加額又は欠損金減少額	25,192,072	123,303,007
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	25,192,072	123,303,007
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,235,005,378	296,635,751
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,235,005,378	296,635,751
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	572,421,749	3,783,361,969

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第4期 自 2024年 6月26日 至 2025年 6月25日	第5期 自 2025年 6月26日 至 2026年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第4期 [2025年 6月25日現在]	第5期 [2026年 6月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	(1) 有価証券 同左

区分	第4期 [2025年 6月25日現在]	第5期 [2026年 6月25日現在]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(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。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	(2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左 同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

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

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

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

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドの主要投資対象の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

TOPIXマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[2026年 6月25日現在]

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

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

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

	[2026年 6月25日現在]
三菱UFJ 資産配分最適化バランス（R3）	1,046,189,778円
三菱UFJ 資産配分最適化バランス（R4）	838,872,279円
三菱UFJ 資産配分最適化バランス（R5）	324,767,054円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	394,599,537円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	1,071,559,424円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	178,499,563円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	1,033,585,630円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	109,828,188円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	864,385,094円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	146,994,587円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	215,382,792円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	982,019,324円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	852,171,814円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	1,765,376,079円
三菱UFJ トピックスオープン	811,397,940円
三菱UFJ DCトピックスオープン	7,247,488,070円
三菱UFJ トピックスオープンVA（適格機関投資家限定）	26,007,052円
三菱UFJ トピックスインデックスファンドVA（適格機関投資家限定）	1,725,214,840円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	4,608,013円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	1,928,261,998円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	23,408,532円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	682,943,517円
MUAM 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	72,493,987,300円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	109,246,586円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	85,096円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	104,428,735円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	174,252,018円
MUAM インデックスファンドTOPIXi（適格機関投資家限定）	3,683,175,156円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	1,689,556,468円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	225,503,717円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	232,419,085円
世界8資産 バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	104,971,606円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	2,261,001,855円
MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	109,225,610円
MUKAM 日本株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	9,833,991,776円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）	124,466,527円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	8,184,527,742円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付）	58,996,948円
日米コアバランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	51,939,021円
日本株式インデックスファンドS	11,026,071,103円
グローバルバランスオープンV（適格機関投資家限定）	60,959,783円
MUAM グローバルバランス（退職給付信託向け）（適格機関投資家限定）	8,963,462,443円
TOPIXインデックスファンドV（適格機関投資家限定）	7,574,780円
パッシブバランスファンド（2%コース）（適格機関投資家転売制限付）	2,747,820円
パッシブバランスファンド（5%コース）（適格機関投資家転売制限付）	49,218,883円
MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド2020-07（適格機関投資家限定）	63,312,841円
MUKAM 日米コアバランス 2021-07（適格機関投資家限定）	166,425,299円

	[2026年 6月25日現在]
MUKAM 日米コアバランス（除く米国株）2022-03（適格機関投資家限定）	382,215,109円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	4,916,675,786円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	1,738,579円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	4,464,377円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	1,113,456円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	4,371,672円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	305,442,149円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	43,227,778円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	1,377,227円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	9,855,698円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	720,838円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	8,904,732円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,483,877,653円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	203,001,873円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	948,855,323円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	963,401,362円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	992,691,113円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	56,957,999,169円
合計	566,498,146,277円
2. 貸付有価証券 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	48,844,392,880円
3. 受益権の総数	566,498,146,277口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2025年 6月26日 至 2026年 6月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2026年 6月25日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	（1）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （2）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[2026年 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	259,950,118,075
合計	259,950,118,075

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

[2026年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	24,680,844,900	—	25,078,865,000	398,020,100
合計		24,680,844,900	—	25,078,865,000	398,020,100

（注）時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[2026年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	5.1694円
(1万口当たり純資産額)	(51,694円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

	銘 柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1301	極洋	30,300	4,360.00	132,108,000	貸付有価証券 6,200株
1332	ニッスイ	664,300	1,271.50	844,657,450	貸付有価証券 10,400株
1333	Um i o s	351,900	1,284.00	451,839,600	貸付有価証券 4,800株
1375	ユキグニファクトリー	61,700	1,104.00	68,116,800	貸付有価証券 18,200株
1376	カネコ種苗	20,500	1,447.00	29,663,500	貸付有価証券 6,100株
1377	サカタのタネ	87,800	4,155.00	364,809,000	貸付有価証券 1,300株

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

[2026年 6月25日現在]

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

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

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

	[2026年 6月25日現在]
合計	1,485,682,803,218円
2. 受益権の総数	1,485,682,803,218口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2025年 6月26日 至 2026年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2026年 6月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[2026年 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	45,216,271,102
投資証券	1,213,683,669
合計	46,429,954,771

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

[2026年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）

市場取引	株価指数先物取引 買建				
		195,135,339,871	—	191,465,256,410	△3,670,083,461
合計		195,135,339,871	—	191,465,256,410	△3,670,083,461

（注）時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

[2026年 6月25日現在]

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

（注）時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

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

附属明細表

第１ 有価証券明細表
(1)株式

(単位：円)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

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

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

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 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 514銘柄	98.26%	—	75.82%
	投資証券 25銘柄	—	1.74%	1.35%
カナダドル	株式 84銘柄	100.00%	—	3.59%
オーストラリアドル	株式 43銘柄	94.88%	—	1.61%
	投資証券 4銘柄	—	5.12%	0.09%
イギリスポンド	株式 62銘柄	99.34%	—	3.57%

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

国内債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[2026年 6月25日現在]

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

	[2026年 6月25日現在]
1. 期首	2025年 6月26日
期首元本額	158,298,291,884円
期中追加設定元本額	563,931,016,828円
期中一部解約元本額	542,213,028,920円
元本の内訳※	
ファンド・マネジャー（国内債券）	9,388,236,774円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	10,753,754,246円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	518,446,137円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	141,545,496円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	837,451,527円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	4,637,001,855円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	514,990,972円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	162,557,752円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	12,181,401,080円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	3,140,425,744円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	19,842,097,363円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	2,656,722,836円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	20,246,862,305円
MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	3,129,880,365円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	91,168,445,180円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付）	696,460,160円
合計	180,016,279,792円
2. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	31,146,529,417円
3. 受益権の総数	180,016,279,792口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2025年 6月26日 至 2026年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用してあります。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2026年 6月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	（1）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

区分	[2026年 6月25日現在]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(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。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[2026年 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△60,868,650
地方債証券	3,701,600
特殊債券	△8,542,073
社債券	10,061,000
合計	△55,648,123

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	[2026年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	0.8270円
(1万口当たり純資産額)	(8,270円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第474回利付国債（2年）	80,000,000	79,623,200	
	第475回利付国債（2年）	660,000,000	657,921,000	
	第476回利付国債（2年）	1,050,000,000	1,046,136,000	
	第478回利付国債（2年）	3,330,000,000	3,318,278,400	
	第479回利付国債（2年）	920,000,000	916,246,400	
	第480回利付国債（2年）	1,800,000,000	1,794,240,000	
	第481回利付国債（2年）	720,000,000	719,604,000	
	第482回利付国債（2年）	670,000,000	669,443,900	
	第483回利付国債（2年）	370,000,000	370,188,700	
	第484回利付国債（2年）	1,000,000,000	1,000,180,000	
	第154回利付国債（5年）	170,000,000	167,691,400	

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

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

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

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

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

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

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

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

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

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

日本短期債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[2026年 6月25日現在]

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
--------------------	---

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

（貸借対照表に関する注記）

	[2026年 6月25日現在]
1. 期首	2025年 6月26日
期首元本額	7,210,073,567円
期中追加設定元本額	7,090,020,792円
期中一部解約元本額	1,127,968,417円
元本の内訳※	
三菱ＵＦＪ グローバル・エコ・ウォーター・ファンド	88,421円
国内債券セレクション（ラップ向け）	4,423,192,411円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	998,597,382円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	44,978,263円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	12,220,431円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	82,120,114円
三菱ＵＦＪ 日本短期債券オープン	5,519,340,564円
日本短期債券ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	2,057,830円
日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）	102,767,848円
三菱ＵＦＪ 積立ファンド（日本バランス型）	1,336,067,512円
三菱ＵＦＪ 国内バランス２０	650,695,166円
合計	13,172,125,942円
2. 受益権の総数	13,172,125,942口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2025年 6月26日 至 2026年 6月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2026年 6月25日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	（１）有価証券 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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[2026年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	1.1286円
(1万口当たり純資産額)	(11,286円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
社債券	第３５回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	99,611,000	
	第４４回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	197,952,000	
	第４７回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	98,965,000	
	第１回新韓銀行	100,000,000	99,493,000	
	第２４回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付	100,000,000	99,350,000	
	第２７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付	200,000,000	197,314,000	
	第２９回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付	100,000,000	98,923,000	
	第３２回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	200,000,000	199,928,000	
	第１５回クレディ・アグリコル・エス・エー（２０２４）	200,000,000	199,324,000	
	第１８回クレディ・アグリコル・エス・エー（２０２５）	100,000,000	99,244,000	
	第２１回クレディ・アグリコル・エス・エー（２０２５）	300,000,000	296,712,000	
	第２５回クレディ・アグリコル・エス・エー（２０２６）	200,000,000	199,380,000	
	第４回香港上海銀行	200,000,000	198,644,000	
	第１０回エイチエスビーシー・ホールディングス期限前償還条項	100,000,000	98,869,000	
	第１２回ロイズ・バンキング・グループ期限前償還条項付	200,000,000	199,840,000	
	第１４回ロイズ・バンキング・グループ期限前償還条項付	200,000,000	199,856,000	
	第１０回フランス電力	200,000,000	197,854,000	
	第１２回フランス電力	100,000,000	98,694,000	
	第２７回ルノー	100,000,000	99,271,000	
	第２９回ルノー	100,000,000	100,518,000	

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

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

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

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

	[2026年 6月25日現在]
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	629,547,791円
eMAXIS/PayPay証券 全世界バランス	26,738,589円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	2,599,844,114円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	3,257,686,523円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	81,764,277円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	6,814,512,830円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	1,172,224,770円
eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）	80,259,835円
MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）	188,981,417,234円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	8,345,976,784円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	11,260,773,359円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	1,485,133,410円
MUKAM スマート・クオリティ・セクション（適格機関投資家転売制限付）	310,237,535円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	12,117,827,850円
MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	1,148,217,918円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	13,655,163,404円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスオープン（適格機関投資家限定）	6,842,600,868円
MUKAM スマート・クオリティ・セクション2（適格機関投資家限定）	169,201,973円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	46,532,022,377円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付）	389,214,480円
MUKAM バランスファンド2019-12（適格機関投資家限定）	2,727,146,638円
MUKAM バランスファンド2020-07（適格機関投資家限定）	2,709,923,128円
合計	332,259,294,017円
2. 受益権の総数	332,259,294,017口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2025年 6月26日 至 2026年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2026年 6月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	（1）有価証券

区分	[2026年 6月25日現在]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[2026年 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△992,623,710
合計	△992,623,710

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[2026年 6月25日現在]

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

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

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[2026年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	1.1013円
(1万口当たり純資産額)	(11,013円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨	種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
アメリカドル	国債証券	0.375 T-NOTE 270731	4,000,000.00	3,840,390.64	
		0.375 T-NOTE 270930	4,200,000.00	4,007,718.75	
		0.5 T-NOTE 270630	3,500,000.00	3,376,686.60	
		0.5 T-NOTE 270831	3,850,000.00	3,690,585.93	
		0.5 T-NOTE 271031	4,900,000.00	4,668,015.62	
		0.625 T-NOTE 271130	5,700,000.00	5,424,128.89	
		0.625 T-NOTE 271231	6,280,000.00	5,958,150.00	
		0.625 T-NOTE 300515	4,800,000.00	4,195,031.23	
		0.625 T-NOTE 300815	6,450,000.00	5,588,320.31	
		0.75 T-NOTE 280131	4,200,000.00	3,981,058.57	
		0.875 T-NOTE 301115	8,000,000.00	6,951,250.00	
		1 T-NOTE 280731	6,600,000.00	6,185,824.19	
		1.125 T-BOND 400515	3,760,000.00	2,397,587.49	
		1.125 T-BOND 400815	3,850,000.00	2,429,936.50	
		1.125 T-NOTE 280229	7,000,000.00	6,659,296.84	
		1.125 T-NOTE 280831	5,850,000.00	5,483,689.43	
		1.125 T-NOTE 310215	6,950,000.00	6,066,861.34	
		1.25 T-BOND 500515	3,550,000.00	1,713,707.04	

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

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

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

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

２【ファンドの現況】

【ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）】

【純資産額計算書】

2026年 6月30日現在

(単位：円)

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

(参考)

TOPIXマザーファンド

純資産額計算書

2026年 6月30日現在

(単位：円)

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

外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2026年 6月30日現在

(単位：円)

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

国内債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2026年 6月30日現在

(単位：円)

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

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

日本短期債券マザーファンド

純資産額計算書

2026年 6月30日現在

（単位：円）

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

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2026年 6月30日現在

（単位：円）

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

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換等

該当事項はありません。

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

（2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

該当事項はありません。

（４）受益権の譲渡

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

（５）受益権の譲渡の対抗要件

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【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

2026年6月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

（2）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

取締役会は、株主総会で選任された取締役で構成され、経営の基本方針の決定、内部統制システムの整備、取締役の職務の執行の監督、代表取締役の選定・解職などを行います。また、取締役会で決定した基本方針に基づき、経営管理全般に関する執行方針その他重要な事項を協議・決定する任意の機関として、経営会議を設置しています。

代表取締役

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

監査等委員会

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

・投資運用の意思決定機構

①投資環境見通しの策定

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

②運用戦略の決定

①で策定された投資環境見通しに沿って、各運用部は運用戦略を決定します。

③運用計画の決定

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

④ポートフォリオの構築

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

⑤運用部門による自律的な運用管理

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

⑥管理担当部署による運用管理

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

⑦ファンドに係る法人等の管理

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

⑧運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

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

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

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

3【委託会社等の経理状況】

（1）財務諸表の作成方法について

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

なお、財務諸表に掲載している金額については、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

（2）監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第41期事業年度（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

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

(単位：百万円)

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

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

(単位：百万円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

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

(単位：百万円)

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

(単位：百万円)

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

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

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

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

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

1.有価証券の評価基準及び評価方法

(1)子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2)その他有価証券

市場価格のない株式等及び投資事業有限責任組合等への出資以外のもの

時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

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

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

2.金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3.固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5年～50年

器具備品 3年～20年

投資不動産 3年～50年

(2)無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。

4.外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5.引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3)役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4)退職給付引当金

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

① 退職給付見込額の期間帰属方法

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

② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5)役員退職慰労引当金

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

(6)時効後支払損引当金

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

6.収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1)委託者報酬

投資信託の信託約款に基づき信託財産の運用指図等を行っております。委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受領しております。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2)投資顧問料

顧客との投資一任及び投資助言契約に基づき運用及び助言を行っております。投資顧問料は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を主に年4回受領しております。当該報酬は契約期間にわたり収益として認識しております。

7.その他財務諸表作成のための基礎となる事項

グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(未適用の会計基準等)

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

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

(1)概要

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

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

(2)適用予定日

2028年3月期の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

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

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

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

(1)概要

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

(2)適用予定日

2028年3月期の期首から適用します。

(貸借対照表関係)

※1.有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

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

※2.関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

(損益計算書関係)

※1.固定資産売却損の内訳

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

※2.固定資産除却損の内訳

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

※3.関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

※4.減損損失

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

当社は、以下のとおり減損損失を計上しました。

場所	用途	種類	金額
東京都港区（本社）	インターネット直販サービス	ソフトウェア	1,306百万円

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグループिंगとしております。

現行のソフトウェアについて、利用終了が見込まれたため、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、回収可能価額として使用価値を用いておりますが、割引率については使用見込期間が短いため考慮しておりません。

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

該当事項はありません。

※5.事業譲渡関連損失

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

吸収分割に伴うものであり、データ移管に伴うシステム対応費用であります。

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

該当事項はありません。

(株主資本等変動計算書関係)

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 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

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

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

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

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

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

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 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

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

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

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

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

① 配当金の総額	12,408百万円
② 配当の原資	利益剰余金
③ 1株当たり配当額	58,647円
④ 基準日	2026年3月31日
⑤ 効力発生日	2026年6月26日

(リース取引関係)

〈借主側〉

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

	第40期 (2025年3月31日現在)	第41期 (2026年3月31日現在)
1年内	681百万円	171百万円
1年超	170百万円	4百万円
合計	851百万円	176百万円

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、金銭の信託（合同運用指定金銭信託）及び国債で運用し、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号2021年6月17日。以下、「時価算定適用指針」という。）第24-16項を適用した投資事業有限責任組合等への出資は、次表には含まれておりません（（注3）参照）。

第40期(2025年3月31日現在)

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

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

- (注1) 「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。
- (注2) 現金及び預金に含まれるコーラブル預金（定期預金）（貸借対照表計上額1,000百万円）の時価は、取引先金融機関から提示された価格によっております。その他の現金及び預金（貸借対照表計上額36,354百万円）については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、当該帳簿価額によっております。
- (注3) 市場価格のない株式等、時価算定適用指針第24-16項の取扱いを適用した投資事業有限責任組合等への出資
 関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額159百万円）は、市場価格がないため、記載していません。また投資有価証券のうち、時価算定適用指針第24-16項の取扱いを適用した投資事業有限責任組合等への出資（当事業年度の貸借対照表計上額202百万円）は上記に含めておりません。
- (注4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明
 金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。
- (注5) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第40期(2025年3月31日現在)

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	37,354	—	—	—
金銭の信託	1,650	—	—	—
未収委託者報酬	24,418	—	—	—
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	700	3,248	268	11
合計	64,124	3,248	268	11

第41期(2026年3月31日現在)

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

- (注1) 「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。
- (注2) 投資有価証券には、時価算定適用指針第24-3項の基準価額を時価とみなす取扱いを適用した投資信託が含まれております。
- (注3) 市場価格のない株式等、時価算定適用指針第24-16項の取扱いを適用した投資事業有限責任組合等への出資
 関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額159百万円）は、市場価格がないため、記載していません。また投資有価証券のうち、時価算定適用指針第24-16項の取扱いを適用した投資事業有限責任組合等への出資（当事業年度の貸借対照表計上額355百万円）は上記に含めておりません。
- (注4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明
 金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。
- (注5) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第41期(2026年3月31日現在)

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	38,323	—	—	—
金銭の信託	3,151	—	—	—
未収委託者報酬	29,726	—	—	—
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
国債	1,999	—	—	—
投資信託	1,348	2,241	1,919	1,996
合計	74,548	2,241	1,919	1,996

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

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

- レベル1の時価： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価： 観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

第40期(2025年3月31日現在)

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

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

ETF（上場投資信託）は相場価格を用いて評価しております。ETFは活発な市場で取引されているため、レベル1の時価に分類しております。

ETF（上場投資信託）以外の投資信託は基準価額を用いて評価しております。基準価額は観察可能なインプットを用いて算出しているため、レベル2の時価に分類しております。

金銭の信託

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しており、レベル2の時価に分類しております。

第41期(2026年3月31日現在)

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

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

は、上記には含めておりません。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

ETF（上場投資信託）及び国債は相場価格を用いて評価しております。ETF及び国債は活発な市場で取引されているため、レベル1の時価に分類しております。

ETF（上場投資信託）以外の投資信託は、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額を用いて評価しております。基準価額は観察可能なインプットを用いて算出しているため、レベル2の時価に分類しております。時価算定適用指針第24-3項の取扱いを適用し、基準価額を時価とみなした投資信託はレベルを付しておりません。

金銭の信託

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しており、レベル2の時価に分類しております。

（注2）時価算定適用指針第24-3項の取扱いを適用した投資信託に関する情報

期首残高から期末残高への調整表

（単位：百万円）

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

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

（2）時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

第40期（2025年3月31日現在）

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

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

現金及び預金

コーラブル預金（定期預金）は、取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しており、レベル2の時価に分類しております。

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

第41期(2026年3月31日現在)

該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

関連会社株式（貸借対照表計上額は159百万円）は、市場価格がないため、記載しておりません。

2. その他有価証券

第40期(2025年3月31日現在)

	種類	貸借対照表 計上額（百万円）	取得原価 （百万円）	差額（百万円）
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	9,857	7,508	2,348
	小計	9,857	7,508	2,348
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	2,593	2,884	△290
	小計	2,593	2,884	△290
合計		12,450	10,392	2,058

（注）「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」（貸借対照表計上額は1,650百万円、取得原価は1,650百万円）を含めております。

第41期(2026年3月31日現在)

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

（注）「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」（貸借対照表計上額は3,151百万円、取得原価は3,150百万円）を含めております。

3. 売却したその他有価証券

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

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

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

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

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度においては、減損処理を行っておりません。

当事業年度において、有価証券について37百万円（その他有価証券のその他37百万円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%

以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

（退職給付関係）

1.採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度（積立型制度）及び退職一時金制度（非積立型制度）を設けております。また確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

2.確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	第40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	第41期 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,652 百万円	3,437 百万円
勤務費用	180	178
利息費用	47	67
数理計算上の差異の 発生額	△207	△239
退職給付の支払額	△236	△286
過去勤務費用の発生額	—	—
退職給付債務の期末残高	3,437	3,157

（2）年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

（3）退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

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

（4）退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(注) 「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額及び退職金です。

(5)年金資産に関する事項

①年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

②長期期待運用収益率の設定方法

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

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第40期 (2025年3月31日現在)	第41期 (2026年3月31日現在)
割引率	2.07～2.11%	2.89～2.97%
長期期待運用収益率	1.8%	1.8%

3.確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度172百万円、当事業年度173百万円であります。

(税効果会計関係)

1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

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

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

建物の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を取得から15年と見積り、割引率は1.1%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3. 当該資産除去債務の総額の増減

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

（収益認識関係）

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

収益及び契約から生じるキャッシュ・フローの性質、金額、時期及び不確実性に影響を及ぼす主要な要因に基づく区分に当該収益を分解した情報については、重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は、「（重要な会計方針）の6.収益及び費用の計上基準」に記載のとおりであります。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）及び第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）及び第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

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

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 1. グループ通算制度に基づく通算税効果額であります。

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

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

おります。

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等
第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

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

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。
2. 投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。
3. 預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。
4. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

2. 親会社に関する注記

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

（1株当たり情報）

	第40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	第41期 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
1株当たり純資産額	289,876.37円	337,242.83円
1株当たり当期純利益金額	53,688.15円	73,309.88円

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	第41期 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
当期純利益金額（百万円）	11,359	15,510
普通株主に帰属しない金額 （百万円）	—	—
普通株式に係る当期純利益金額 （百万円）	11,359	15,510
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581	211,581

4 【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

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

5【その他】

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（1）受託会社

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

（2）販売会社

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

2【関係業務の概要】

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

3【資本関係】

該当ありません。（2026年6月末現在）

（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

第3【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、ファンドの管理番号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す。
 - ・ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
 - ・ファンドの約款の内容の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

2026年6月5日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 鶴見 将史

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 田嶋 大士

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJアセットマネジメント株式会社の2025年4月1日から2026年3月31日までの第41期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJアセットマネジメント株式会社の2026年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2026年9月2日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）の2025年6月26日から2026年6月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）の2026年6月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。