

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年6月24日提出
【計算期間】	第5期(自 2018年3月27日至 2019年3月25日)
【ファンド名】	三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)
【発行者名】	三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松田 通
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【連絡場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の成長と収益の確保をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000億円です。

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

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

## 商品分類表

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

## 属性区分表

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

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

ます。

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

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

#### 商品分類の定義

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

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

#### 属性区分の定義

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

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

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

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

#### [ ファンドの目的・特色 ]

## ファンドの目的

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

## ファンドの特色

投資対象

ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、国内および先進国の株式、債券および短期金融資産に実質的な投資を行います。

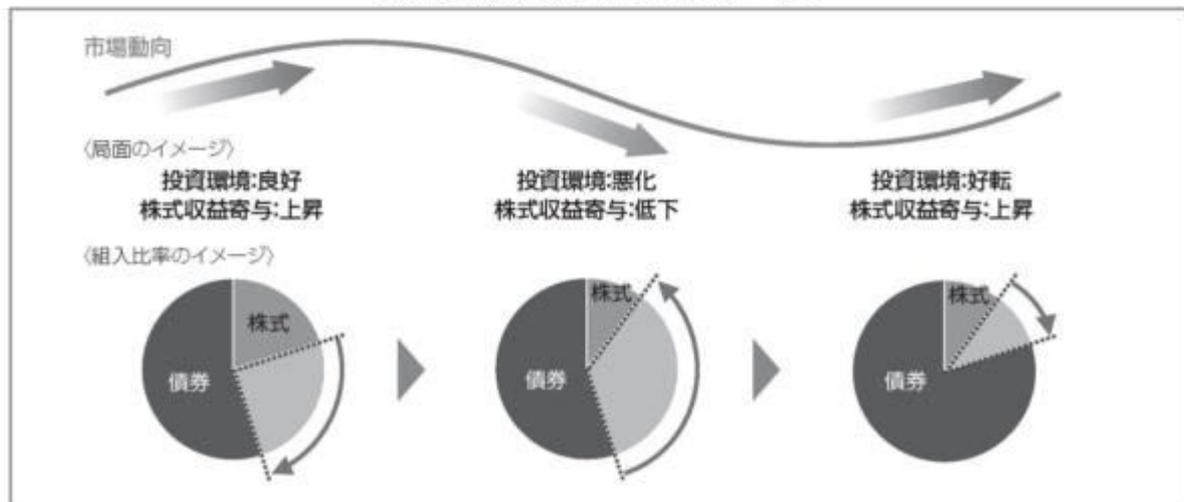
- ・国内、先進国の株式・債券および短期公社債等に投資するファンドです。
- ・国内株式、先進国株式の組入比率を抑えて、比較的安定的な基準価額の上昇をめざすファンドです。

### <ファンドが投資対象とするマザーファンドと運用目標>

各マザーファンド	主要投資対象	運用目標
TOPIXマザーファンド	国内株式	東証株価指数(TOPIX)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
外国株式インデックスマザーファンド	先進国株式 (国内株式を除く)	MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
日本債券インデックスマザーファンド	国内債券	NOMURA-BPI総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	先進国債券 (国内債券を除く)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
マネー・マーケット・マザーファンド	国内の 短期公社債等	安定した収益の確保をめざして安定運用を行います。

## ■運用方法・運用プロセス

### <(ご参考)組入比率変更のイメージ>



- 上図はファンドの組入比率の変更をご理解いただくために、組入比率の変更をイメージとして示したものです。また、各投資環境における組入比率については実際の比率と異なり、投資環境等によっては、株式の組入れを行わない場合があります。

- 各資産の組入比率は以下の範囲で変動します。

#### <各資産の組入比率>

国内株式	0.0%～22.0%
先進国株式	0.0%～22.0%
国内債券	0.0%～51.0%
先進国債券	0.0%～25.0% (原則、25.0%固定とします。)

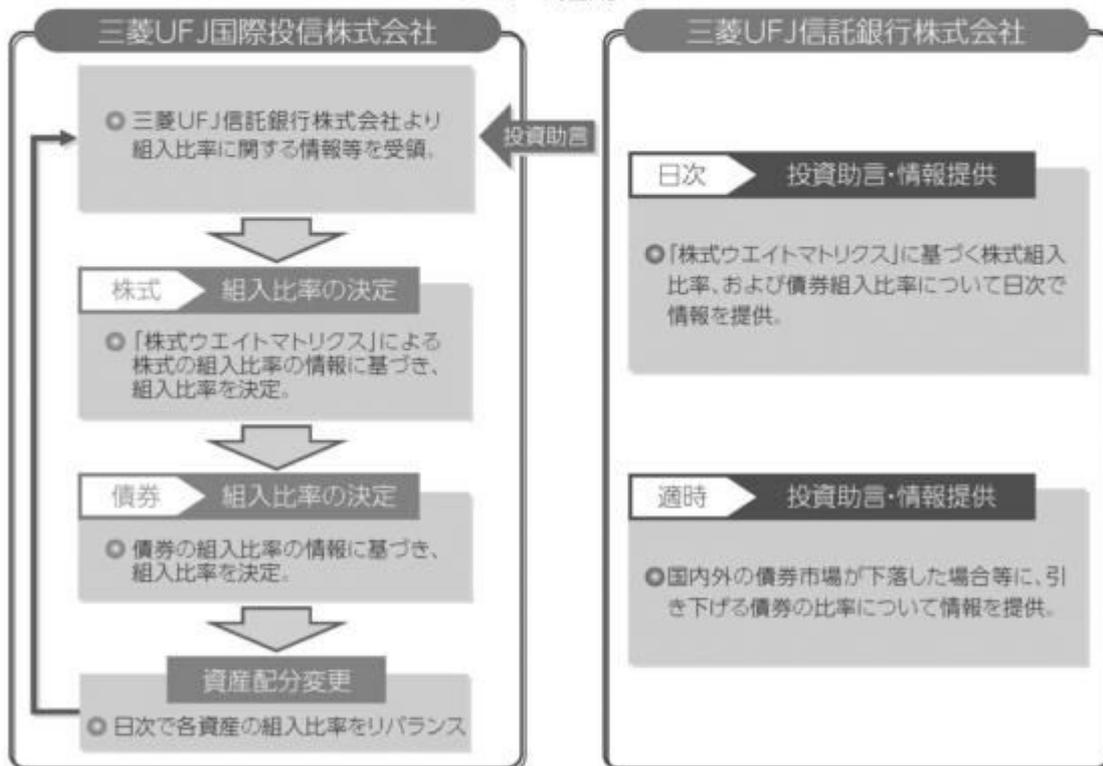
- 1 上記以外に短期金融資産を組み入れます。
- 1 上記組入比率は、今後、変更となる場合があります。

- 三菱UFJ信託銀行株式会社の投資助言・情報提供に基づき、三菱UFJ国際投信株式会社がファンドの運用を行います。

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

- ファンドの運用プロセスは以下のとおりです。

#### <ファンドの運用プロセス>

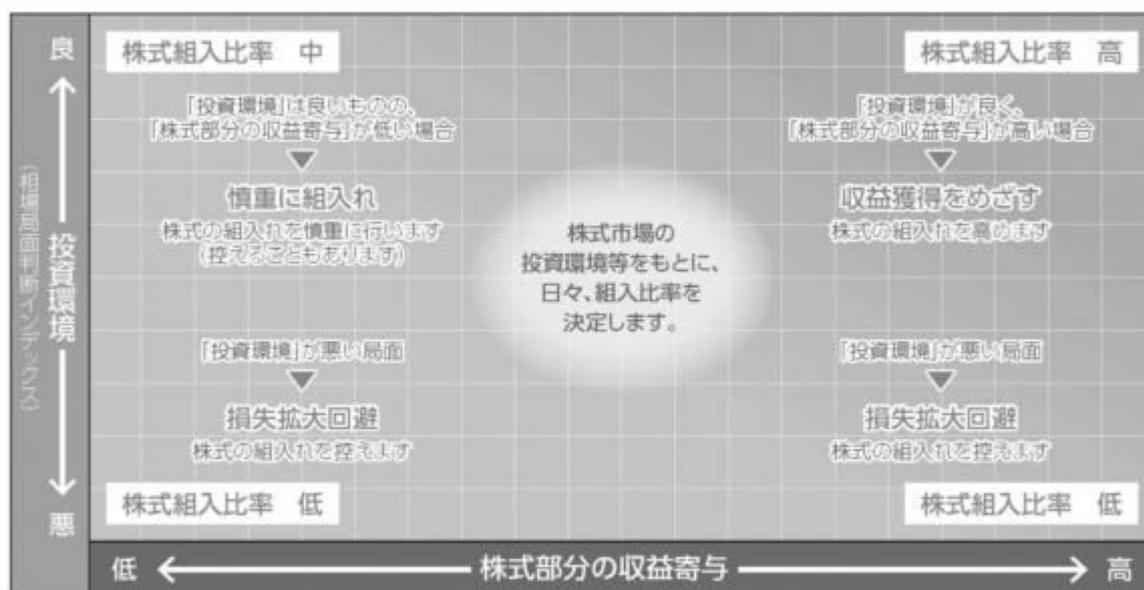


1 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用を行わない場合があります。

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

- 株式の組入比率については、投資環境や株式部分の収益寄与に基づいて決定する「株式ウエイトマトリクス」を活用します。
- ◆ 「投資環境」は、株式市場や景気の方角性、信用リスクに対する市場の反応の大きさ、株式市場の値動きの大きさ等を測る複数の指標を用いて計算される相場局面判断インデックスをもとに判断します。
- ◆ 「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。
- ❗ 「株式ウエイトマトリクス」は、各資産（国内株式、先進国株式）ごとに異なります。また、「投資環境」を判断する各指標については、今後変更になる場合があります。

#### <株式ウエイトマトリクスのイメージ>



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

- 株式部分以外への投資については、先進国債券に一定の比率で投資を行い、残りは国内債券等に投資します。
- なお、国内外の債券市場が下落した場合等に債券の組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等への投資を行う場合があります。

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

為替対応  
方針

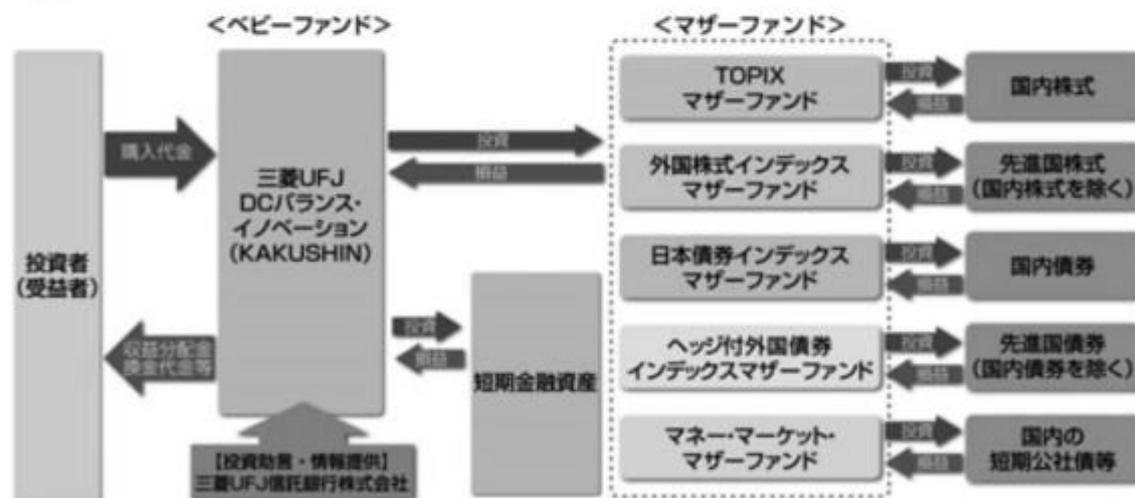
実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

- 実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。
- その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないため、ファンドは為替相場の変動による影響を受けます。

■ 為替ヘッジを行うにあたっては、対象通貨間の金利差に基づくヘッジコストがかかります。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。

## ■ ファンドの仕組み

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



## ■ 主な投資制限

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

## 分配方針

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

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

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## ■指数について

- ・東証株価指数(TOPIX)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
- ・MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。
- MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)は、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。
- MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)に対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
- ・NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- ・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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】

2014年5月30日 設定日、信託契約締結、運用開始

## (3)【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割

投資家(受益者)		
お申込金	収益分配金、解約代金等	
販売会社	募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。	
お申込金	収益分配金、解約代金等	
受託会社(受託者) 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)		<b>委託会社(委託者)</b> <b>三菱UFJ国際投信株式会社</b>
信託財産の保管・管理等を行います。		
投資 損益		信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。
マザーファンド		
投資 損益		

## 有価証券等

## 委託会社と関係法人との契約の概要

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

## 委託会社の概況（2019年3月末現在）

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

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

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

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

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

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

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

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

## （２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ａ．有価証券先物取引等

ｂ．スワップ取引

ｃ．金利先渡取引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

有価証券の指図範囲

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

１．株券または新株引受権証書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

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

１１．コマーシャル・ペーパー

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

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

１４．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）

１５．投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。16．において同じ。）で16．で定めるもの以外のもの

１６．投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下16．において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

１７．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）

18. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
  19. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  21. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
  22. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
  23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  24. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいい、1. から23. に該当するものを除きます。)
  25. 外国の者に対する権利で23. および24. の有価証券の性質を有するもの
- なお、1. の証券または証書ならびに13. および19. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から6. までの証券ならびに16. の証券ならびに13. および19. の証券または証書のうち2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14. および15. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 信託の受益権(金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、1. から5. に該当するものを除きます。)
7. 投資事業有限責任組合契約に基づく権利(金融商品取引法第2条第2項第5号に該当するものをいいます。)
8. 外国の者に対する権利で5. から7. の権利の性質を有するもの

#### その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

#### <マザーファンドの概要>

##### TOPIXマザーファンド

##### (基本方針)

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

##### (運用方法)

##### 投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

##### 投資態度

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

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

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

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

##### (投資制限)

株式への投資割合に制限を設けません。

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

ます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

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

## 外国株式インデックスマザーファンド

### （基本方針）

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

### （運用方法）

#### 投資対象

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

#### 投資態度

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

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

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

### （投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

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

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

## 日本債券インデックスマザーファンド

### （基本方針）

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

### （運用方法）

#### 投資対象

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

## 投資態度

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

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

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

### （投資制限）

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

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

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

### （基本方針）

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

### （運用方法）

#### 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。

#### 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、FTSE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）

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

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。

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。

### マネー・マーケット・マザーファンド

#### （基本方針）

この投資信託は、安定した収益の確保をめざして安定運用を行います。

#### （運用方法）

投資対象

わが国の公社債等を主要投資対象とします。

投資態度

わが国の短期公社債等を中心に投資し、利子等収益の確保を図ります。

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

#### （投資制限）

株式への投資は行いません。

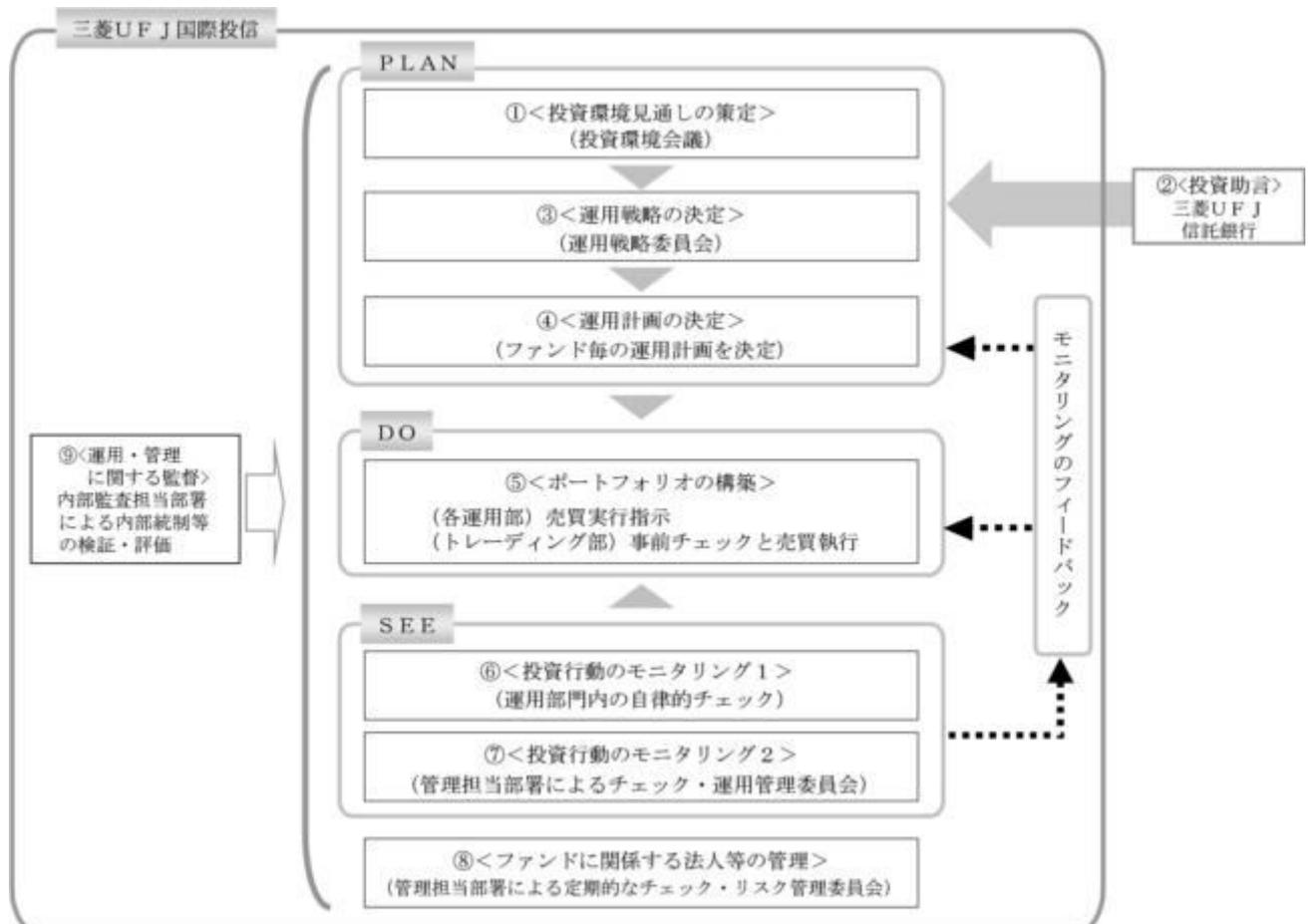
外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

金利先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

### （3）【運用体制】



### 投資環境見通しの策定

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

#### 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。

#### 運用戦略の決定

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

#### 運用計画の決定

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

#### ポートフォリオの構築

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

#### 投資行動のモニタリング1

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

#### 投資行動のモニタリング2

運用部から独立した管理担当部署(40~60名程度)は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

#### ファンドに関係する法人等の管理

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

#### 運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

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

#### (4)【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

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

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

#### (5)【投資制限】

##### < 信託約款に定められた投資制限 >

##### 新株引受権証券および新株予約権証券

- a. 委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

#### 投資信託証券

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

#### 同一銘柄の転換社債等

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

#### スワップ取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。))を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 信用取引

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

#### 外国為替予約取引

- a. 委託会社は、信託財産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。

#### 有価証券の借入れ

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

#### 資金の借入れ

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

#### 投資する株式等の範囲

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

#### 金利先渡取引および為替先渡取引

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

#### 有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を

次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. a. に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### 有価証券の空売り

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

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### デリバティブ取引等

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

#### 信用リスクの分散規制

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

#### <その他法令等に定められた投資制限>

- ・同一の法人の発行する株式への投資制限

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

### 3【投資リスク】

#### (1) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

(主なりスクであり、以下に限定されるものではありません。)

#### 価格変動リスク

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動し、また、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動するため、当ファンドはその影響を受け株

式や公社債の価格が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

#### 為替変動リスク

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

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

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

#### 信用リスク

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

#### 流動性リスク

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

#### 留意事項

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

#### （２）投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っています。

また、定期的に関催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。この内容は運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

##### トレーディング担当部署

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

##### コンプライアンス担当部署

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

##### リスク管理担当部署

運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行

い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

内部監査担当部署

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

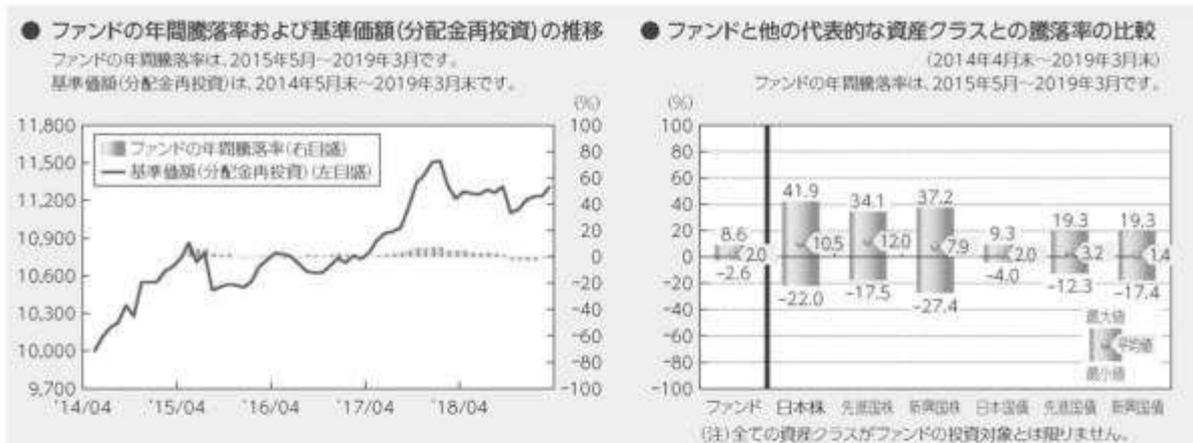
<流動性リスクに対する管理体制>

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

\* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

## ■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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



- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- 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	TOPIX(配当込み)	TOPIX(配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数(TOPIX)に、現金配当による権利落ちの修正を加えた株価指数です。TOPIX(配当込み)に関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の停止またはTOPIX(配当込み)の商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPI(国債)とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な国債パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(総合)のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セクレティーズ・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・セクレティーズ・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0.648%（税抜0.6%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。消費税率が10%となった場合は、年0.66%（税抜0.6%）となります。

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

- 信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- 信託報酬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	0.4%	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	0.17%	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	0.03%	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。

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

上記以外の場合の課税の取扱いは、次の通りです。

## 個人の受益者に対する課税

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

### 1. 収益分配金の課税

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

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

### 2. 解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

## 法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

## 個別元本について

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

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

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

## 収益分配金について

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

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

上記は2019年3月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## 5【運用状況】

## 【三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）】

## （１）【投資状況】

平成31年 3月29日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	5,142,877,873	80.89
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		1,214,992,677	19.11
純資産総額		6,357,870,550	100.00

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

## （２）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## a 評価額上位30銘柄

平成31年 3月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	2,396,039,328	1.3531	3,242,266,508	1.3538	3,243,758,042	51.02
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	1,227,192,742	1.2918	1,585,287,584	1.2951	1,589,337,320	25.00
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	112,767,104	2.7118	305,801,832	2.7471	309,782,511	4.87

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

## b 全銘柄の種類／業種別投資比率

平成31年 3月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	80.89
合計	80.89

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## （３）【運用実績】

## 【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成31年3月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末日 (平成27年 3月25日)	35,553,059	35,553,059	10,752	10,752
第2計算期間末日 (平成28年 3月25日)	807,612,280	807,612,280	10,742	10,742
第3計算期間末日 (平成29年 3月27日)	1,403,572,405	1,403,572,405	10,697	10,697
第4計算期間末日 (平成30年 3月26日)	2,639,151,920	2,639,151,920	11,120	11,120
第5計算期間末日 (平成31年 3月25日)	6,301,738,329	6,301,738,329	11,294	11,294
平成30年 3月末日	2,699,943,771		11,214	
4月末日	2,840,846,148		11,270	
5月末日	2,997,595,797		11,256	
6月末日	4,656,882,353		11,247	
7月末日	4,831,543,734		11,284	
8月末日	5,048,145,539		11,262	
9月末日	5,177,902,298		11,311	
10月末日	5,351,939,759		11,102	
11月末日	5,546,565,208		11,129	
12月末日	5,696,649,007		11,203	
平成31年 1月末日	5,974,411,597		11,232	
2月末日	6,152,071,047		11,235	
3月末日	6,357,870,550		11,310	

## 【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

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	7.52
第2計算期間	0.09
第3計算期間	0.41
第4計算期間	3.95
第5計算期間	1.56

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

#### （４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	34,064,041	997,459	33,066,582
第2計算期間	897,344,061	178,600,159	751,810,484
第3計算期間	815,850,058	255,563,488	1,312,097,054
第4計算期間	1,435,863,542	374,521,457	2,373,439,139
第5計算期間	3,809,862,810	603,687,552	5,579,614,397

（参考）

外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

平成31年 3月29日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	アメリカ	229,859,849,445	62.15
	イギリス	21,880,887,530	5.92
	カナダ	13,064,301,886	3.53
	フランス	13,040,801,301	3.53
	スイス	11,519,971,955	3.11
	ドイツ	10,915,407,570	2.95
	オーストラリア	8,336,316,058	2.25
	オランダ	5,538,181,502	1.50
	香港	4,659,986,699	1.26
	スペイン	3,862,766,415	1.04
	スウェーデン	3,448,665,989	0.93
	イタリア	2,511,052,453	0.68
	デンマーク	2,319,762,639	0.63
	シンガポール	1,562,014,213	0.42

	フィンランド	1,328,676,385	0.36
	ベルギー	1,295,197,664	0.35
	ノルウェー	937,048,832	0.25
	アイルランド	674,458,275	0.18
	ルクセンブルグ	376,578,826	0.10
	イスラエル	358,209,807	0.10
	ニュージーランド	318,617,252	0.09
	オーストリア	299,799,208	0.08
	ポルトガル	204,210,048	0.06
	小計	338,312,761,952	91.48
投資証券	アメリカ	7,242,867,635	1.96
	オーストラリア	667,590,540	0.18
	イギリス	272,905,801	0.07
	香港	236,249,706	0.06
	オランダ	216,966,096	0.06
	フランス	206,871,023	0.06
	シンガポール	162,252,016	0.04
	カナダ	70,553,569	0.02
	小計	9,076,256,386	2.45
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		22,437,311,354	6.07
純資産総額		369,826,329,692	100.00

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

#### その他の資産の投資状況

平成31年 3月29日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国/地域	時価合計	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	15,655,139,500	4.23
	買建	カナダ	826,710,726	0.22
	買建	ドイツ	3,164,999,846	0.86
	買建	オーストラリア	1,054,987,056	0.29
	買建	イギリス	1,453,786,950	0.39
	買建	スイス	740,890,281	0.20

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### a 評価額上位30銘柄

平成31年 3月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	408,366	21,250.95	8,678,167,345	20,946.03	8,553,647,630	2.31
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	627,517	11,263.68	7,068,155,770	12,978.06	8,143,953,716	2.20
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	35,766	185,128.41	6,621,303,010	196,831.88	7,039,889,228	1.90
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	206,731	20,064.46	4,147,947,884	18,374.39	3,798,556,949	1.03
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	230,735	14,373.38	3,316,441,880	15,414.29	3,556,616,480	0.96
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	27,071	124,183.70	3,361,777,007	129,690.70	3,510,857,078	0.95
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	25,729	124,943.92	3,214,682,332	130,110.24	3,347,606,553	0.91
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	364,338	9,001.44	3,279,570,128	8,961.33	3,264,953,997	0.88
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	286,135	12,525.20	3,583,898,993	11,177.80	3,198,360,633	0.86
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	263,405	8,816.79	2,322,389,051	10,615.75	2,796,242,156	0.76
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	151,402	15,012.90	2,272,983,743	17,166.82	2,599,091,381	0.70
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	111,405	22,332.30	2,487,930,772	22,271.25	2,481,128,985	0.67
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	214,237	8,597.28	1,841,856,540	11,493.01	2,462,228,947	0.67
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	802,303	3,379.40	2,711,306,393	3,033.35	2,433,671,180	0.66
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	497,280	4,151.67	2,064,543,444	4,693.76	2,334,116,503	0.63
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	355,561	5,598.20	1,990,503,113	6,557.28	2,331,516,305	0.63
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	392,901	5,884.51	2,312,030,425	5,894.67	2,316,025,234	0.63
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	387,082	5,090.11	1,970,291,314	5,922.42	2,292,464,656	0.62
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	164,433	14,064.57	2,312,680,593	13,653.98	2,245,166,505	0.61
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	82,761	27,150.06	2,246,966,323	26,885.10	2,225,038,398	0.60
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	626,242	3,522.47	2,205,924,460	3,441.79	2,155,399,653	0.58
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	384,755	6,031.12	2,320,505,356	5,448.49	2,096,337,271	0.57
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	79,056	22,052.32	1,743,368,388	26,067.11	2,060,761,559	0.56
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	223,703	6,966.23	1,558,366,596	9,171.10	2,051,603,411	0.55
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	97,175	21,235.69	2,063,578,958	21,094.75	2,049,883,245	0.55

スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	186,427	8,876.66	1,654,849,424	10,633.59	1,982,388,954	0.54
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	46,425	38,575.67	1,790,875,775	41,559.09	1,929,381,013	0.52
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	154,810	11,234.40	1,739,198,672	12,287.70	1,902,259,286	0.51
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	60,421	25,569.88	1,544,958,092	30,258.23	1,828,233,028	0.49
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	347,791	4,814.65	1,674,493,701	5,169.91	1,798,049,630	0.49

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

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成31年 3月29日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	エネルギー	6.12
	素材	4.19
	資本財	6.59
	商業・専門サービス	1.10
	運輸	1.88
	自動車・自動車部品	1.09
	耐久消費財・アパレル	1.78
	消費者サービス	1.76
	メディア・娯楽	5.51
	小売	4.50
	食品・生活必需品小売り	1.40
	食品・飲料・タバコ	4.72
	家庭用品・パーソナル用品	1.99
	ヘルスケア機器・サービス	4.39
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.95
	銀行	7.47
	各種金融	3.92
	保険	3.61
	不動産	0.65
	ソフトウェア・サービス	8.49
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.99
電気通信サービス	2.29	
公益事業	3.29	
半導体・半導体製造装置	2.78	
	小計	91.48
投資証券		2.45

合計	93.93
----	-------

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

平成31年 3月29日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI1906	買建	1,000	アメリカドル	141,189,647.5	15,670,638,976	141,050,000	15,655,139,500	4.23
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE601906	買建	52	カナダドル	10,020,555	828,098,665	10,003,760	826,710,726	0.22
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 1906	買建	784	ユーロ	25,639,666	3,193,676,797	25,409,440	3,164,999,846	0.86
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 1906	買建	87	オーストラリアドル	13,411,398	1,054,672,339	13,415,400	1,054,987,056	0.29
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 1906	買建	140	イギリスポンド	10,024,921	1,453,413,047	10,027,500	1,453,786,950	0.39
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX1906	買建	72	スイスフラン	6,661,719.2	742,848,307	6,644,160	740,890,281	0.20

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

#### 日本債券インデックスマザーファンド

#### 投資状況

平成31年 3月29日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	日本	503,548,669,480	83.31
地方債証券	日本	31,891,195,245	5.28
特殊債券	日本	39,491,944,136	6.53
社債券	日本	28,604,679,180	4.73
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		874,176,650	0.15
純資産総額		604,410,664,691	100.00

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国/地域	時価合計	投資比率(%)
債券先物取引	買建	日本	306,560,000	0.05

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### a 評価額上位30銘柄

平成31年 3月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限(年/月/日)	投資比率(%)
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	8,300,000,000	101.30	8,408,063,000	101.45	8,420,599,000	0.100000	2023/12/20	1.39
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	6,860,000,000	103.45	7,097,081,600	102.38	7,023,336,600	1.200000	2020/12/20	1.16
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	6,800,000,000	100.10	6,807,023,000	102.09	6,942,664,000	0.100000	2028/6/20	1.15
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	6,550,000,000	103.92	6,807,305,000	104.01	6,812,851,500	0.600000	2024/3/20	1.13
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,100,000,000	100.75	6,145,905,500	102.22	6,235,725,000	0.100000	2028/3/20	1.03
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	5,860,000,000	104.58	6,128,388,000	104.27	6,110,632,200	0.800000	2023/6/20	1.01
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	5,970,000,000	100.85	6,020,770,500	101.06	6,033,640,200	0.100000	2022/9/20	1.00
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	5,910,000,000	100.40	5,933,767,500	102.00	6,028,731,900	0.100000	2028/9/20	1.00
日本	国債証券	第148回利付国債(20年)	4,820,000,000	118.21	5,697,732,300	120.11	5,789,446,600	1.500000	2034/3/20	0.96
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	5,600,000,000	100.48	5,626,941,000	102.36	5,732,384,000	0.100000	2027/9/20	0.95
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	5,350,000,000	103.02	5,511,915,000	104.00	5,564,053,500	0.400000	2025/9/20	0.92
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	5,400,000,000	101.36	5,473,460,000	101.91	5,503,302,000	0.100000	2028/12/20	0.91
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	5,040,000,000	103.82	5,232,800,000	103.83	5,233,384,800	0.600000	2023/12/20	0.87
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	4,970,000,000	103.44	5,141,205,000	103.90	5,163,830,000	0.500000	2024/9/20	0.85
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	4,960,000,000	103.03	5,110,678,000	103.84	5,150,612,800	0.400000	2025/6/20	0.85
日本	国債証券	第130回利付国債(5年)	4,950,000,000	100.69	4,984,155,000	100.79	4,989,253,500	0.100000	2021/12/20	0.83
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	4,790,000,000	100.78	4,827,362,000	102.38	4,904,337,300	0.100000	2027/3/20	0.81
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	4,760,000,000	100.91	4,803,427,000	102.27	4,868,147,200	0.100000	2026/6/20	0.81
日本	国債証券	第390回利付国債(2年)	4,750,000,000	100.39	4,768,793,000	100.35	4,766,625,000	0.100000	2020/7/1	0.79
日本	国債証券	第391回利付国債(2年)	4,700,000,000	100.39	4,718,447,000	100.37	4,717,578,000	0.100000	2020/8/1	0.78

日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	4,610,000,000	100.88	4,650,568,000	101.16	4,663,568,200	0.100000	2022/12/20	0.77
日本	国債証券	第135回利付国債（5年）	4,480,000,000	101.02	4,525,696,000	101.24	4,535,552,000	0.100000	2023/3/20	0.75
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	4,330,000,000	103.89	4,498,437,000	104.21	4,512,682,700	0.600000	2024/6/20	0.75
日本	国債証券	第125回利付国債（5年）	4,400,000,000	100.53	4,423,320,000	100.41	4,418,172,000	0.100000	2020/9/20	0.73
日本	国債証券	第136回利付国債（5年）	4,300,000,000	100.79	4,333,970,000	101.31	4,356,717,000	0.100000	2023/6/20	0.72
日本	国債証券	第131回利付国債（5年）	4,310,000,000	100.77	4,343,427,000	100.88	4,347,928,000	0.100000	2022/3/20	0.72
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	4,190,000,000	100.72	4,220,220,000	102.35	4,288,548,800	0.100000	2026/12/20	0.71
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	4,190,000,000	100.64	4,216,951,900	102.29	4,286,328,100	0.100000	2027/12/20	0.71
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	4,120,000,000	102.56	4,225,593,000	103.47	4,263,211,200	0.300000	2025/12/20	0.71
日本	国債証券	第137回利付国債（5年）	4,200,000,000	101.08	4,245,392,000	101.37	4,257,792,000	0.100000	2023/9/20	0.70

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

#### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成31年 3月29日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	83.31
地方債証券	5.28
特殊債券	6.53
社債券	4.73
合計	99.86

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

平成31年 3月29日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物19年06月限	買建	2	円	305,662,160	306,560,000	0.05

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

#### ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

#### 投資状況

平成31年 3月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	111,179,794,991	46.31
	フランス	23,695,930,377	9.87
	イタリア	20,591,635,341	8.58
	イギリス	16,447,506,826	6.85
	ドイツ	15,464,108,040	6.44
	スペイン	13,336,506,693	5.55
	ベルギー	5,817,537,248	2.42
	オーストラリア	4,963,987,493	2.07
	カナダ	4,654,536,852	1.94
	オランダ	4,641,955,844	1.93
	オーストリア	3,442,576,015	1.43
	メキシコ	1,899,991,620	0.79
	アイルランド	1,809,646,586	0.75
	フィンランド	1,495,890,623	0.62
	ポーランド	1,405,147,598	0.59
	南アフリカ	1,263,125,344	0.53
	デンマーク	1,189,603,030	0.50
	シンガポール	1,183,408,696	0.49
	スウェーデン	817,597,116	0.34
ノルウェー	545,346,390	0.23	
	小計	235,845,832,723	98.23
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		4,246,013,139	1.77
純資産総額		240,091,845,862	100.00

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### a 評価額上位30銘柄

平成31年 3月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 230215	23,900,000	10,876.66	2,599,522,976	11,025.29	2,635,045,673	2.000000	2023/2/15	1.10
アメリカ	国債証券	6.125 T-BOND 271115	17,050,000	14,018.55	2,390,164,013	14,353.26	2,447,231,083	6.125000	2027/11/15	1.02
アメリカ	国債証券	2.625 T-NOTE 250331	18,200,000	11,088.54	2,018,115,909	11,326.18	2,061,365,244	2.625000	2025/3/31	0.86
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 210815	18,000,000	11,142.78	2,005,702,022	11,235.56	2,022,402,549	2.750000	2021/8/15	0.84

アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 250430	15,700,000	11,243.65	1,765,254,328	11,485.73	1,803,259,732	2.875000	2025/4/30	0.75
アメリカ	国債証券	2.625 T-NOTE 210515	15,500,000	11,104.63	1,721,218,611	11,190.48	1,734,524,404	2.625000	2021/5/15	0.72
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 210630	16,000,000	10,725.27	1,716,044,138	10,838.86	1,734,218,750	1.125000	2021/6/30	0.72
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 241115	15,100,000	10,910.48	1,647,483,355	11,100.73	1,676,210,866	2.250000	2024/11/15	0.70
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 210215	15,000,000	11,020.52	1,653,078,989	11,095.96	1,664,394,767	2.250000	2021/2/15	0.69
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 200930	15,200,000	10,873.55	1,652,779,838	10,947.25	1,663,982,891	1.375000	2020/9/30	0.69
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 250215	15,000,000	10,701.86	1,605,279,586	10,941.18	1,641,177,914	2.000000	2025/2/15	0.68
フランス	国債証券	2.25 O.A.T 240525	11,350,000	13,994.68	1,588,396,568	14,090.01	1,599,216,753	2.250000	2024/5/25	0.67
アメリカ	国債証券	2.375 T-NOTE 210315	14,000,000	11,050.00	1,547,001,163	11,127.18	1,557,805,346	2.375000	2021/3/15	0.65
アメリカ	国債証券	1.75 T-NOTE 220228	12,750,000	10,829.32	1,380,739,445	10,960.26	1,397,433,469	1.750000	2022/2/28	0.58
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 250815	12,300,000	10,661.10	1,311,316,500	10,916.03	1,342,672,910	2.000000	2025/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 260215	12,600,000	10,352.41	1,304,404,772	10,627.29	1,339,038,855	1.625000	2026/2/15	0.56
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 211015	11,500,000	11,180.94	1,285,808,310	11,280.65	1,297,275,832	2.875000	2021/10/15	0.54
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 200315	11,500,000	10,981.50	1,262,873,267	11,019.22	1,267,210,983	1.625000	2020/3/15	0.53
アメリカ	国債証券	2.375 T-NOTE 240815	11,200,000	10,960.26	1,227,549,400	11,177.90	1,251,925,579	2.375000	2024/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	2.5 T-NOTE 230815	10,950,000	11,056.51	1,210,688,025	11,241.20	1,230,912,050	2.500000	2023/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	2.125 T-NOTE 250515	10,650,000	10,787.30	1,148,847,952	11,008.82	1,172,439,397	2.125000	2025/5/15	0.49
イギリス	国債証券	4.25 GILT 551207	4,410,000	24,548.01	1,082,567,400	25,990.85	1,146,196,686	4.250000	2055/12/7	0.48
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 221115	10,350,000	10,716.60	1,109,168,593	10,882.22	1,126,310,045	1.625000	2022/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 211231	10,000,000	10,923.84	1,092,384,391	11,045.23	1,104,523,922	2.000000	2021/12/31	0.46
フランス	国債証券	5.5 O.A.T 290425	5,800,000	18,573.91	1,077,287,090	18,975.97	1,100,606,326	5.500000	2029/4/25	0.46
アメリカ	国債証券	2.375 T-NOTE 270515	9,800,000	10,824.99	1,060,849,357	11,136.28	1,091,355,998	2.375000	2027/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 230228	10,000,000	10,633.36	1,063,336,227	10,812.85	1,081,285,391	1.500000	2023/2/28	0.45
アメリカ	国債証券	2.5 T-NOTE 240515	9,100,000	11,039.16	1,004,564,420	11,251.61	1,023,896,624	2.500000	2024/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	1.75 T-NOTE 220515	9,200,000	10,809.81	994,503,349	10,953.32	1,007,705,957	1.750000	2022/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	2.5 T-NOTE 201231	9,000,000	11,107.21	999,649,193	11,141.92	1,002,772,971	2.500000	2020/12/31	0.42

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

#### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成31年 3月29日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.23
合計	98.23

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

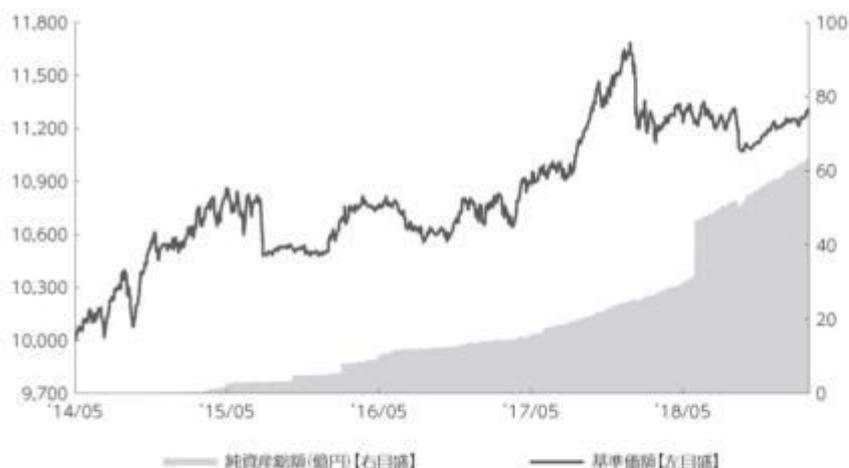
## 参考情報



## 運用実績

2019年3月29日現在

### ■基準価額・純資産の推移 2014年5月30日(設定日)～2019年3月29日



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

### ■基準価額・純資産

基準価額	11,310円
純資産総額	63.5億円

### ■分配の推移

2019年3月	0円
2018年3月	0円
2017年3月	0円
2016年3月	0円
2015年3月	0円
設定来累計	0円

・分配金は1万口当たり、税引前

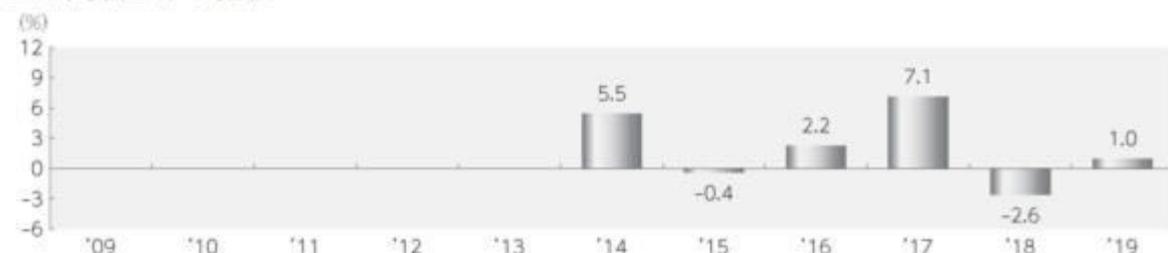
### ■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	種類	業種/種別	比率
国内債券	50.9%	1 円	94.7%	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.1%
外国株式	4.6%	2 アメリカドル	3.5%	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	0.1%
外国債券	24.6%	3 ユーロ	0.7%	AMAZON.COM INC	株式	小売	0.1%
		4 イギリスポンド	0.4%	FACEBOOK INC-CLASS A	株式	メディア・娯楽	0.1%
		5 カナダドル	0.2%	JOHNSON & JOHNSON	株式	医薬品・バイオテクノロジーライフサイエンス	0.0%
		6 スイスフラン	0.2%	第138回利付国債(5年)	債券	国債	0.7%
		7 オーストラリアドル	0.1%	第312回利付国債(10年)	債券	国債	0.6%
		8 香港ドル	0.1%	第351回利付国債(10年)	債券	国債	0.6%
コールローン他 (負債控除後)	19.9%	9 スウェーデンクローネ	0.0%	第333回利付国債(10年)	債券	国債	0.6%
合計	100.0%	10 デンマーククローネ	0.0%	第350回利付国債(10年)	債券	国債	0.5%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引(買建)	0.3%
債券先物取引(買建)	0.0%

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

### ■年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額で計算
- ・2014年は設定日から年末までの、2019年は年初から3月29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】

### 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。

### 申込単位

1円以上1円単位

### 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

### 申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

### 申込価額の照会方法

申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

### 申込手数料

ありません。

### 申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

### 申込受付時間

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

### 取得申込みの受付の中止および取消し

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

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

## 2【換金（解約）手続等】

### 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  
れます。

**解約単位**

1口単位

**解約価額**

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

**信託財産留保額**

ありません。

**解約価額の算出頻度**

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

**解約価額の照会方法**

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

**支払開始日**

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

**解約請求受付時間**

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時まで、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。

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

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

**3【資産管理等の概要】****(1)【資産の評価】****基準価額の算出方法**

基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

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

す。

（資産の評価方法）

・株式 / 上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券

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

・転換社債 / 転換社債型新株予約権付社債

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

・公社債等

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

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

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

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

・外国為替予約取引

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

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限（2014年5月30日設定）

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

#### （４）【計算期間】

毎年3月26日から翌年3月25日まで

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

#### （５）【その他】

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

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

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

##### 信託約款の変更等

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

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

##### ファンドの償還等に関する開示方法

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

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

##### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

#### 関係法人との契約の更改

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

#### 運用報告書

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

#### 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

#### 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

#### 信託事務の再信託

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

#### 公告

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

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

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

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

##### (1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

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

##### (2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

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

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

##### (3) 換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(平成30年3月27日から平成31年3月25日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 [平成30年 3月26日現在]	第5期 [平成31年 3月25日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	52,994,283	1,103,098,815
親投資信託受益証券	2,584,312,963	5,229,403,339
未収入金	14,000,000	-
流動資産合計	2,651,307,246	6,332,502,154
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	4,589,895	12,532,256
未払受託者報酬	376,019	906,056
未払委託者報酬	7,144,258	17,214,951
未払利息	92	1,890
その他未払費用	45,062	108,672
流動負債合計	12,155,326	30,763,825
負債合計	12,155,326	30,763,825
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,373,439,139	5,579,614,397
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	265,712,781	722,123,932
(分配準備積立金)	35,976,786	92,038,227
元本等合計	2,639,151,920	6,301,738,329
純資産合計	2,639,151,920	6,301,738,329
負債純資産合計	2,651,307,246	6,332,502,154

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	平成29年 3月28日 至 平成30年 3月26日	自	平成30年 3月27日 至 平成31年 3月25日
営業収益				
受取利息		282		556
有価証券売買等損益		62,933,566		95,907,850
営業収益合計		62,933,848		95,908,406
営業費用				
支払利息		27,055		409,353
受託者報酬		650,660		1,537,288
委託者報酬		12,362,353		29,208,191
その他費用		77,960		197,873
営業費用合計		13,118,028		31,352,705
営業利益又は営業損失（ ）		49,815,820		64,555,701
経常利益又は経常損失（ ）		49,815,820		64,555,701
当期純利益又は当期純損失（ ）		49,815,820		64,555,701
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（ ）		14,799,267		3,638,446
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		91,475,351		265,712,781
剰余金増加額又は欠損金減少額		169,865,849		466,385,120
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		169,865,849		466,385,120
剰余金減少額又は欠損金増加額		30,644,972		70,891,224
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		30,644,972		70,891,224
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		265,712,781		722,123,932

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年3月25日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成30年 3月27日から平成31年 3月25日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第4期 [平成30年 3月26日現在]	第5期 [平成31年 3月25日現在]
1. 期首元本額	1,312,097,054円	2,373,439,139円
期中追加設定元本額	1,435,863,542円	3,809,862,810円
期中一部解約元本額	374,521,457円	603,687,552円
2. 受益権の総数	2,373,439,139口	5,579,614,397口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 平成29年 3月28日 至 平成30年 3月26日			第5期 自 平成30年 3月27日 至 平成31年 3月25日		
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	23,920,994円	費用控除後の配当等収益額	A	43,894,919円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	2,273,047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	17,022,336円
収益調整金額	C	229,735,995円	収益調整金額	C	630,085,705円
分配準備積立金額	D	9,782,745円	分配準備積立金額	D	31,120,972円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	265,712,781円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	722,123,932円
当ファンドの期末残存口数	F	2,373,439,139口	当ファンドの期末残存口数	F	5,579,614,397口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,119円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,294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 平成29年 3月28日 至 平成30年 3月26日	第5期 自 平成30年 3月27日 至 平成31年 3月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同左

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第4期 [平成30年 3月26日現在]	第5期 [平成31年 3月25日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

区分	第4期	第5期
	[平成30年 3月26日現在]	[平成31年 3月25日現在]
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	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	第5期
	[平成30年 3月26日現在]	[平成31年 3月25日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	318,015	88,755,372
合計	318,015	88,755,372

## (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	第5期
	[平成30年 3月26日現在]	[平成31年 3月25日現在]
1口当たり純資産額	1.1120円	1.1294円
(1万口当たり純資産額)	(11,120円)	(11,294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	1,227,192,742	1,585,287,584	
	TOPIXマザーファンド	72,051,134	122,047,415	
	外国株式インデックスマザーファンド	112,767,104	305,801,832	
	日本債券インデックスマザーファンド	2,376,785,773	3,216,266,508	
	合計	3,788,796,753	5,229,403,339	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

## TOPIXマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

[平成31年 3月25日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	26,627,704,539
株式	243,354,142,420
未収配当金	309,774,714
未収利息	661,398
その他未収収益	54,824,034
差入委託証拠金	87,750,000
流動資産合計	270,434,857,105
資産合計	270,434,857,105
負債の部	

[平成31年 3月25日現在]

流動負債	
派生商品評価勘定	66,234,340
前受金	18,420,000
未払金	1,634,410,598
未払解約金	364,932,268
未払利息	45,624
受入担保金	23,330,133,897
流動負債合計	25,414,176,727
負債合計	25,414,176,727
純資産の部	
元本等	
元本	144,648,237,224
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	100,372,443,154
元本等合計	245,020,680,378
純資産合計	245,020,680,378
負債純資産合計	270,434,857,105

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[平成31年 3月25日現在]
1. 期首	平成30年 3月27日
期首元本額	157,232,250,877円
期中追加設定元本額	120,208,869,168円
期中一部解約元本額	132,792,882,821円
元本の内訳	
ファンド・マネジャー（国内株式）	12,356,149,314円
eMAXIS TOPIXインデックス	11,206,777,934円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	2,087,619,625円
eMAXIS バランス（波乗り型）	99,215,326円
コアバランス	193,769円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	32,045,813円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	56,887,607円

[平成31年 3月25日現在]

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	48,563,390円
eMAXIS Slim 国内株式(TOPIX)	4,308,442,221円
国内株式セレクション(ラップ向け)	1,661,601,972円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	1,669,841,262円
つみたて日本株式(TOPIX)	2,310,455,913円
つみたて8資産均等バランス	519,436,419円
つみたて4資産均等バランス	129,372,667円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,454,860円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,088,174円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	2,290,556円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	7,168,416円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	6,737,201円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	6,312,876円
eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)	179,871,116円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	2,675,517円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	352,120,860円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	546,775,131円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	449,644,148円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	72,051,134円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	346,790,891円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	36,975,422円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	241,898,878円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	221,775,463円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	50,636,665円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	68,291,175円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	265,390,196円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	196,895,501円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	491,121,938円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	53,814,684円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	9,586,745,495円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)	239,254,979円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	2,792,239,479円
MUAM 日本株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	14,739,950,377円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)	441,947,184円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投資家限定)	8,922,811円

	[平成31年 3月25日現在]
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	6,622,543円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定)	62,850,292円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	23,868,371円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	435,025,743円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	876,601,820円
MUAMトピックスリスクコントロール(5%)インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	1,894,108円
MUAMトピックスリスクコントロール(10%)インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	165,101,552円
MUAM インデックスファンドTOPIXi(適格機関投資家限定)	8,726,654円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	467,170,250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)	187,681,581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)	621,794,310円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	50,188,782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)	11,502,186円
MUKAM 日本株式インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	2,810,438,365円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	9,101,572,441円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	4,598,253円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	18,900,160円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	19,726,208円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	17,248,132円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	1,618,674,880円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	297,921,033円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	43,255,633円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	301,401,498円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	30,436,821円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	191,111,598円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,892,995,162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)	520,527,966円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(安定成長型)	2,037,413,184円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(成長型)	1,742,705,835円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(積極型)	1,422,408,692円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	51,759,428,812円

	[平成31年 3月25日現在]
合計	144,648,237,224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	21,780,520,190円
3. 受益権の総数	144,648,237,224口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成30年 3月27日 至 平成31年 3月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、新株予約権証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成31年 3月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品

区分	[平成31年 3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	<p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	[平成31年 3月25日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	
株式		16,038,309,673
合計		16,038,309,673

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## 株式関連

[平成31年 3月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,504,875,000		3,438,760,000	66,115,000
	合計	3,504,875,000		3,438,760,000	66,115,000

## （注）時価の算定方法

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	[平成31年 3月25日現在]
1口当たり純資産額	1.6939円
(1万口当たり純資産額)	(16,939円)

## 附属明細表

第1 有価証券明細表  
(1) 株式

(単位：円)

	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1301	極洋	4,700	3,040.00	14,288,000	貸付有価証券 3,700株(3,700株)
1332	日本水産	146,000	797.00	116,362,000	
1333	マルハニチロ	21,100	4,005.00	84,505,500	
1376	カネコ種苗	4,400	1,344.00	5,913,600	
1377	サカタのタネ	17,800	3,715.00	66,127,000	貸付有価証券 14,200株(14,200株)
1379	ホクト	12,200	1,969.00	24,021,800	
1384	ホクリヨウ	2,000	610.00	1,220,000	
1514	住石ホールディングス	31,400	103.00	3,234,200	貸付有価証券 21,700株(21,700株)
1515	日鉄鉱業	3,300	4,560.00	15,048,000	
1518	三井松島ホールディングス	6,100	1,311.00	7,997,100	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
1605	国際石油開発帝石	585,600	1,035.50	606,388,800	
1662	石油資源開発	21,000	2,231.00	46,851,000	
1663	K&Oエナジーグループ	7,100	1,537.00	10,912,700	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
1413	ヒノキヤグループ	3,100	2,162.00	6,702,200	
1414	ショーボンドホールディングス	10,400	7,260.00	75,504,000	貸付有価証券 8,500株(8,500株)
1417	ミライト・ホールディングス	41,100	1,557.00	63,992,700	貸付有価証券 10,800株(10,800株)
1419	タマホーム	7,000	1,027.00	7,189,000	
1420	サンヨーホームズ	2,100	886.00	1,860,600	貸付有価証券 700株(700株)
1429	日本アクア	3,500	535.00	1,872,500	貸付有価証券 700株(700株)
1430	ファーストコーポレーション	4,500	782.00	3,519,000	
1433	ベステラ	2,800	1,368.00	3,830,400	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
1435	TATERU	17,800	255.00	4,539,000	
1448	スペースバリューホールディングス	17,800	518.00	9,220,400	

1712	ダイセキ環境ソリューション	2,800	624.00	1,747,200	貸付有価証券 200株(200株)
1716	第一カッター興業	1,800	1,691.00	3,043,800	貸付有価証券 500株(500株)
1719	安藤・間	93,400	760.00	70,984,000	
1720	東急建設	42,800	845.00	36,166,000	貸付有価証券 6,900株(6,900株)
1721	コムシスホールディングス	51,800	2,882.00	149,287,600	貸付有価証券 25,100株(25,100株)
1722	ミサワホーム	11,500	802.00	9,223,000	
1726	ピーアールホールディングス	11,900	338.00	4,022,200	
1762	高松コンストラクショングループ	9,100	2,648.00	24,096,800	貸付有価証券 5,100株(5,100株)
1766	東建コーポレーション	4,500	7,020.00	31,590,000	
1768	ソネック	1,500	714.00	1,071,000	貸付有価証券 800株(800株)
1780	ヤマウラ	5,600	999.00	5,594,400	貸付有価証券 4,100株(4,100株)
1801	大成建設	119,900	5,060.00	606,694,000	
1802	大林組	361,200	1,098.00	396,597,600	
1803	清水建設	368,400	957.00	352,558,800	
1805	飛鳥建設	10,300	1,355.00	13,956,500	
1808	長谷工コーポレーション	150,600	1,427.00	214,906,200	
1810	松井建設	13,300	697.00	9,270,100	
1811	銭高組	1,500	5,250.00	7,875,000	
1812	鹿島建設	282,300	1,601.00	451,962,300	
1813	不動テトラ	8,300	1,460.00	12,118,000	
1814	大末建設	4,300	905.00	3,891,500	
1815	鉄建建設	7,300	2,738.00	19,987,400	貸付有価証券 5,300株(5,300株)
1820	西松建設	26,000	2,524.00	65,624,000	
1821	三井住友建設	86,900	763.00	66,304,700	
1822	大豊建設	8,100	3,185.00	25,798,500	
1824	前田建設工業	85,900	1,125.00	96,637,500	
1826	佐田建設	7,800	379.00	2,956,200	
1827	ナカノフドー建設	9,200	487.00	4,480,400	貸付有価証券 6,800株(6,800株)
1833	奥村組	19,800	3,540.00	70,092,000	
1835	東鉄工業	14,500	3,005.00	43,572,500	
1847	イチケン	2,200	1,888.00	4,153,600	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
1848	富士ピー・エス	3,700	496.00	1,835,200	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
1852	浅沼組	4,300	2,597.00	11,167,100	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
1860	戸田建設	140,000	694.00	97,160,000	貸付有価証券 72,000株(72,000株)

1861	熊谷組	17,200	3,430.00	58,996,000	
1865	青木あすなる建設	5,900	1,053.00	6,212,700	
1866	北野建設	2,500	3,105.00	7,762,500	貸付有価証券 700株(700株)
1867	植木組	1,500	2,344.00	3,516,000	
1870	矢作建設工業	16,400	786.00	12,890,400	
1871	ピーエス三菱	12,700	675.00	8,572,500	貸付有価証券 9,600株(9,600株)
1873	日本ハウスホールディングス	23,000	443.00	10,189,000	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
1878	大東建託	42,900	15,600.00	669,240,000	貸付有価証券 13,400株(13,400株)
1879	新日本建設	14,300	971.00	13,885,300	
1881	N I P P O	31,900	2,041.00	65,107,900	
1882	東亜道路工業	2,300	2,950.00	6,785,000	
1883	前田道路	37,700	2,121.00	79,961,700	
1884	日本道路	3,300	6,570.00	21,681,000	
1885	東亜建設工業	10,500	1,562.00	16,401,000	貸付有価証券 7,700株(7,700株)
1888	若築建設	6,100	1,494.00	9,113,400	
1890	東洋建設	44,100	434.00	19,139,400	
1893	五洋建設	143,200	520.00	74,464,000	
1898	世紀東急工業	17,500	603.00	10,552,500	
1899	福田組	3,900	4,200.00	16,380,000	
1911	住友林業	85,400	1,468.00	125,367,200	
1914	日本基礎技術	12,400	379.00	4,699,600	
1921	巴コーポレーション	15,000	344.00	5,160,000	貸付有価証券 11,000株(11,000株)
1925	大和ハウス工業	333,500	3,444.00	1,148,574,000	
1926	ライト工業	23,100	1,402.00	32,386,200	
1928	積水ハウス	368,800	1,799.50	663,655,600	
1929	日特建設	10,300	609.00	6,272,700	
1930	北陸電気工事	5,800	883.00	5,121,400	
1934	ユアテック	19,300	802.00	15,478,600	
1939	四電工	1,800	2,693.00	4,847,400	貸付有価証券 600株(600株)
1941	中電工	15,500	2,275.00	35,262,500	貸付有価証券 9,900株(9,900株)
1942	関電工	54,800	960.00	52,608,000	
1944	きんでん	80,100	1,796.00	143,859,600	
1945	東京エネシス	12,400	948.00	11,755,200	
1946	トーエネック	3,400	3,005.00	10,217,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
1949	住友電設	8,300	1,818.00	15,089,400	
1950	日本電設工業	20,500	2,240.00	45,920,000	貸付有価証券 14,400株(14,400株)

1951	協和エクシオ	47,200	2,931.00	138,343,200	
1952	新日本空調	10,100	1,950.00	19,695,000	貸付有価証券 7,400株(7,400株)
1959	九電工	23,800	3,415.00	81,277,000	
1961	三機工業	27,200	1,216.00	33,075,200	
1963	日揮	103,700	1,463.00	151,713,100	貸付有価証券 19,900株(19,900株)
1964	中外炉工業	3,400	1,805.00	6,137,000	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
1967	ヤマト	10,800	480.00	5,184,000	貸付有価証券 7,700株(7,700株)
1968	太平電業	8,100	2,356.00	19,083,600	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
1969	高砂熱学工業	30,400	1,748.00	53,139,200	
1972	三晃金属工業	1,500	2,920.00	4,380,000	
1975	朝日工業社	2,500	2,901.00	7,252,500	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
1976	明星工業	21,800	749.00	16,328,200	
1979	大気社	16,400	3,190.00	52,316,000	
1980	ダイダン	8,100	2,507.00	20,306,700	
1982	日比谷総合設備	11,500	1,863.00	21,424,500	貸付有価証券 7,900株(7,900株)
1983	東芝プラントシステム	26,100	1,974.00	51,521,400	
5912	OSJBホールディングス	53,200	274.00	14,576,800	
6330	東洋エンジニアリング	14,200	624.00	8,860,800	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
6366	千代田化工建設	86,900	280.00	24,332,000	貸付有価証券 49,000株(49,000株)
6379	新興ブランテック	21,600	1,172.00	25,315,200	貸付有価証券 7,600株(7,600株)
2001	日本製粉	35,800	1,892.00	67,733,600	
2002	日清製粉グループ本社	121,900	2,459.00	299,752,100	
2003	日東富士製粉	800	6,200.00	4,960,000	
2004	昭和産業	9,900	3,005.00	29,749,500	
2009	鳥越製粉	9,600	755.00	7,248,000	
2053	中部飼料	13,200	1,183.00	15,615,600	
2060	フィード・ワン	72,500	177.00	12,832,500	
2107	東洋精糖	1,600	1,025.00	1,640,000	
2108	日本甜菜製糖	6,100	2,018.00	12,309,800	
2109	三井製糖	8,500	2,873.00	24,420,500	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
2112	塩水港精糖	11,700	235.00	2,749,500	
2117	日新製糖	5,100	2,087.00	10,643,700	
2201	森永製菓	27,100	4,830.00	130,893,000	
2204	中村屋	2,800	4,435.00	12,418,000	
2206	江崎グリコ	32,400	5,750.00	186,300,000	

2207	名糖産業	5,200	1,467.00	7,628,400	
2209	井村屋グループ	4,600	2,478.00	11,398,800	
2211	不二家	6,000	2,186.00	13,116,000	貸付有価証券 4,100株(4,100株)
2212	山崎製パン	88,200	1,785.00	157,437,000	貸付有価証券 45,000株(45,000株)
2215	第一屋製パン	1,900	1,022.00	1,941,800	
2217	モロゾフ	1,800	4,795.00	8,631,000	
2220	亀田製菓	6,700	5,370.00	35,979,000	
2222	寿スピリッツ	11,400	4,180.00	47,652,000	
2229	カルビー	49,200	2,978.00	146,517,600	貸付有価証券 13,700株(13,700株)
2264	森永乳業	21,600	3,600.00	77,760,000	貸付有価証券 10,400株(10,400株)
2266	六甲バター	7,900	2,107.00	16,645,300	貸付有価証券 3,900株(3,900株)
2267	ヤクルト本社	79,900	7,540.00	602,446,000	貸付有価証券 9,500株(9,500株)
2269	明治ホールディングス	76,400	8,760.00	669,264,000	
2270	雪印メグミルク	26,000	2,674.00	69,524,000	
2281	プリマハム	15,200	2,067.00	31,418,400	
2282	日本ハム	46,600	3,965.00	184,769,000	貸付有価証券 21,500株(21,500株)
2286	林兼産業	3,600	558.00	2,008,800	
2288	丸大食品	11,500	1,882.00	21,643,000	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
2292	S Foods	9,700	4,000.00	38,800,000	貸付有価証券 700株(700株)
2296	伊藤ハム米久ホールディングス	69,500	692.00	48,094,000	貸付有価証券 50,700株(50,700株)
2501	サッポロホールディングス	39,400	2,508.00	98,815,200	貸付有価証券 20,200株(20,200株)
2502	アサヒグループホールディングス	225,900	4,700.00	1,061,730,000	
2503	キリンホールディングス	488,000	2,554.00	1,246,352,000	
2531	宝ホールディングス	80,800	1,312.00	106,009,600	
2533	オエノンホールディングス	30,600	400.00	12,240,000	
2540	養命酒製造	3,300	2,113.00	6,972,900	
2579	コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	82,600	2,698.00	222,854,800	貸付有価証券 38,800株(38,800株)
2587	サントリー食品インターナショナル	72,200	4,970.00	358,834,000	
2590	ダイドーグループホールディングス	6,100	4,985.00	30,408,500	貸付有価証券 4,300株(4,300株)
2593	伊藤園	32,800	5,430.00	178,104,000	
2594	キーコーヒー	10,600	2,129.00	22,567,400	貸付有価証券 4,300株(4,300株)
2597	ユニカフェ	3,000	990.00	2,970,000	貸付有価証券 700株(700株)
2599	ジャパンフーズ	1,500	1,285.00	1,927,500	

2602	日清オイリオグループ	13,900	3,345.00	46,495,500	
2607	不二製油グループ本社	26,300	3,645.00	95,863,500	
2612	かどや製油	1,200	5,370.00	6,444,000	
2613	J - オイルミルズ	5,600	4,115.00	23,044,000	
2801	キッコーマン	71,200	5,280.00	375,936,000	貸付有価証券 41,200株(41,200株)
2802	味の素	238,300	1,754.00	417,978,200	
2809	キューピー	60,100	2,604.00	156,500,400	貸付有価証券 31,400株(31,400株)
2810	ハウス食品グループ本社	41,200	4,355.00	179,426,000	貸付有価証券 17,500株(17,500株)
2811	カゴメ	43,200	3,020.00	130,464,000	貸付有価証券 31,800株(31,800株)
2812	焼津水産化学工業	5,200	1,148.00	5,969,600	
2815	アリアケジャパン	9,900	5,960.00	59,004,000	
2818	ピエトロ	1,400	1,660.00	2,324,000	
2819	エバラ食品工業	2,600	2,202.00	5,725,200	
2871	ニチレイ	56,000	2,693.00	150,808,000	
2875	東洋水産	55,500	4,140.00	229,770,000	
2882	イトアアンド	3,700	1,721.00	6,367,700	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
2883	大冷	1,200	1,821.00	2,185,200	
2884	ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,900	542.00	1,571,800	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
2897	日清食品ホールディングス	45,900	7,430.00	341,037,000	
2899	永谷園ホールディングス	5,700	2,556.00	14,569,200	
2904	一正蒲鉾	4,200	1,062.00	4,460,400	
2908	フジッコ	11,700	2,197.00	25,704,900	
2910	ロック・フィールド	11,600	1,599.00	18,548,400	貸付有価証券 9,200株(9,200株)
2914	日本たばこ産業	623,000	2,702.50	1,683,657,500	
2915	ケンコーマヨネーズ	6,000	2,175.00	13,050,000	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
2918	わらべや日洋ホールディングス	7,100	1,813.00	12,872,300	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
2922	なとり	6,000	1,720.00	10,320,000	
2924	イフジ産業	1,900	710.00	1,349,000	
2925	ピククルスコーポレーション	2,600	1,839.00	4,781,400	
2930	北の達人コーポレーション	42,400	418.00	17,723,200	貸付有価証券 16,800株(16,800株)
2931	ユーグレナ	46,000	668.00	30,728,000	貸付有価証券 33,200株(33,200株)
4404	ミヨシ油脂	4,100	1,041.00	4,268,100	
4526	理研ビタミン	5,100	3,605.00	18,385,500	
3001	片倉工業	12,900	1,241.00	16,008,900	貸付有価証券 3,600株(3,600株)

3002	グンゼ	7,100	4,620.00	32,802,000	貸付有価証券 4,700株(4,700株)
3101	東洋紡	44,600	1,501.00	66,944,600	
3103	ユニチカ	30,800	419.00	12,905,200	
3104	富士紡ホールディングス	5,500	2,702.00	14,861,000	
3106	倉敷紡績	10,000	2,082.00	20,820,000	
3109	シキボウ	5,500	1,056.00	5,808,000	
3201	日本毛織	34,600	905.00	31,313,000	貸付有価証券 8,300株(8,300株)
3202	ダイトウボウ	17,000	80.00	1,360,000	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
3204	トーア紡コーポレーション	4,500	445.00	2,002,500	貸付有価証券 100株(100株)
3205	ダイドーリミテッド	12,600	334.00	4,208,400	
3302	帝国繊維	11,800	2,682.00	31,647,600	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
3401	帝人	85,900	1,866.00	160,289,400	
3402	東レ	816,700	719.70	587,778,990	
3408	サカイオーベックス	2,600	1,758.00	4,570,800	
3501	住江織物	3,100	2,634.00	8,165,400	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
3512	日本フェルト	6,000	462.00	2,772,000	
3513	イチカワ	1,500	1,390.00	2,085,000	
3524	日東製網	1,200	1,377.00	1,652,400	
3529	アツギ	8,700	976.00	8,491,200	
3551	ダイニック	4,300	732.00	3,147,600	
3569	セーレン	25,900	1,681.00	43,537,900	貸付有価証券 20,600株(20,600株)
3571	ソトー	4,200	981.00	4,120,200	
3577	東海染工	1,400	1,097.00	1,535,800	
3580	小松マテーレ	17,300	779.00	13,476,700	貸付有価証券 12,700株(12,700株)
3591	ワコールホールディングス	30,700	2,655.00	81,508,500	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
3593	ホギメディカル	13,100	3,885.00	50,893,500	貸付有価証券 5,200株(5,200株)
3606	レナウン	30,400	100.00	3,040,000	
3607	クラウディアホールディングス	2,600	474.00	1,232,400	
3608	T S Iホールディングス	38,800	640.00	24,832,000	貸付有価証券 16,800株(16,800株)
3611	マツオカコーポレーション	3,300	3,370.00	11,121,000	
3612	ワールド	10,300	2,236.00	23,030,800	
8011	三陽商会	6,300	1,663.00	10,476,900	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
8013	ナイガイ	3,800	502.00	1,907,600	貸付有価証券 200株(200株)
8016	オンワードホールディングス	63,200	566.00	35,771,200	

8029	ルックホールディングス	3,800	1,485.00	5,643,000	
8107	キムラタン	51,900	26.00	1,349,400	貸付有価証券 28,100株(28,100株)
8111	ゴールドウイン	9,500	14,570.00	138,415,000	貸付有価証券 5,200株(5,200株)
8114	デサント	23,300	2,674.00	62,304,200	貸付有価証券 18,800株(18,800株)
8118	キング	5,600	556.00	3,113,600	
8127	ヤマトインターナショナル	6,900	411.00	2,835,900	
3708	特種東海製紙	6,700	4,150.00	27,805,000	貸付有価証券 4,400株(4,400株)
3861	王子ホールディングス	473,900	694.00	328,886,600	
3863	日本製紙	50,400	2,285.00	115,164,000	
3864	三菱製紙	17,100	522.00	8,926,200	
3865	北越コーポレーション	69,800	652.00	45,509,600	
3877	中越パルプ工業	4,500	1,334.00	6,003,000	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
3878	巴川製紙所	3,500	979.00	3,426,500	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
3880	大王製紙	51,300	1,305.00	66,946,500	貸付有価証券 36,700株(36,700株)
3896	阿波製紙	2,700	498.00	1,344,600	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
3941	レンゴー	108,600	996.00	108,165,600	貸付有価証券 7,700株(7,700株)
3946	トーモク	6,500	1,652.00	10,738,000	
3950	ザ・パック	8,000	3,275.00	26,200,000	貸付有価証券 5,800株(5,800株)
3405	クラレ	177,600	1,402.00	248,995,200	貸付有価証券 24,000株(24,000株)
3407	旭化成	749,000	1,154.50	864,720,500	
3553	共和レザー	6,500	729.00	4,738,500	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
4004	昭和電工	69,900	3,680.00	257,232,000	貸付有価証券 38,400株(38,400株)
4005	住友化学	828,700	524.00	434,238,800	
4008	住友精化	5,100	3,950.00	20,145,000	貸付有価証券 600株(600株)
4021	日産化学	64,600	5,000.00	323,000,000	
4022	ラサ工業	3,700	1,559.00	5,768,300	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
4023	クレハ	9,700	6,350.00	61,595,000	貸付有価証券 2,900株(2,900株)
4025	多木化学	3,100	5,940.00	18,414,000	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
4027	テイカ	8,600	2,473.00	21,267,800	貸付有価証券 6,500株(6,500株)
4028	石原産業	20,200	1,133.00	22,886,600	
4031	片倉コープアグリ	3,100	1,175.00	3,642,500	

4033	日東エフシー	6,600	772.00	5,095,200	
4041	日本曹達	16,600	2,899.00	48,123,400	
4042	東ソー	162,700	1,704.00	277,240,800	
4043	トクヤマ	30,300	2,560.00	77,568,000	
4044	セントラル硝子	22,900	2,495.00	57,135,500	
4045	東亜合成	66,100	1,162.00	76,808,200	
4046	大阪ソーダ	11,300	2,712.00	30,645,600	貸付有価証券 7,200株(7,200株)
4047	関東電化工業	25,000	749.00	18,725,000	
4061	デンカ	41,400	3,140.00	129,996,000	
4063	信越化学工業	185,500	9,109.00	1,689,719,500	
4064	日本カーバイド工業	3,600	1,483.00	5,338,800	
4078	堺化学工業	7,000	2,390.00	16,730,000	貸付有価証券 5,400株(5,400株)
4082	第一稀元素化学工業	8,600	868.00	7,464,800	
4088	エア・ウォーター	86,200	1,603.00	138,178,600	
4091	大陽日酸	86,700	1,608.00	139,413,600	貸付有価証券 63,800株(63,800株)
4092	日本化学工業	3,600	1,999.00	7,196,400	
4093	東邦アセチレン	1,600	1,424.00	2,278,400	貸付有価証券 400株(400株)
4095	日本パーカラライジング	57,500	1,379.00	79,292,500	
4097	高圧ガス工業	16,700	830.00	13,861,000	
4098	チタン工業	1,300	2,356.00	3,062,800	貸付有価証券 900株(900株)
4099	四国化成工業	17,700	1,174.00	20,779,800	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
4100	戸田工業	2,200	2,145.00	4,719,000	
4109	ステラ ケミファ	6,200	3,050.00	18,910,000	貸付有価証券 4,200株(4,200株)
4112	保土谷化学工業	3,700	3,285.00	12,154,500	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
4114	日本触媒	17,700	7,260.00	128,502,000	
4116	大日精化工業	8,700	3,030.00	26,361,000	
4118	カネカ	28,000	4,080.00	114,240,000	
4182	三菱瓦斯化学	108,300	1,600.00	173,280,000	
4183	三井化学	95,600	2,686.00	256,781,600	
4185	J S R	105,700	1,730.00	182,861,000	
4186	東京応化工業	18,100	3,060.00	55,386,000	
4187	大阪有機化学工業	9,700	1,079.00	10,466,300	
4188	三菱ケミカルホールディングス	703,800	805.10	566,629,380	
4189	K Hネオケム	16,000	2,627.00	42,032,000	貸付有価証券 10,200株(10,200株)
4202	ダイセル	163,500	1,167.00	190,804,500	
4203	住友ベークライト	18,200	3,990.00	72,618,000	
4204	積水化学工業	230,100	1,765.00	406,126,500	

4205	日本ゼオン	94,900	1,102.00	104,579,800	
4206	アイカ工業	31,600	3,555.00	112,338,000	
4208	宇部興産	53,200	2,329.00	123,902,800	
4212	積水樹脂	17,400	1,918.00	33,373,200	
4215	タキロンシーアイ	22,800	627.00	14,295,600	
4216	旭有機材	7,300	1,634.00	11,928,200	貸付有価証券 5,200株(5,200株)
4217	日立化成	48,700	2,455.00	119,558,500	
4218	ニチバン	5,500	2,288.00	12,584,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
4220	リケンテクノス	28,700	434.00	12,455,800	
4221	大倉工業	5,400	1,674.00	9,039,600	
4228	積水化成品工業	15,700	921.00	14,459,700	貸付有価証券 8,200株(8,200株)
4229	群栄化学工業	2,700	2,526.00	6,820,200	貸付有価証券 200株(200株)
4231	タイガースポリマー	5,500	583.00	3,206,500	
4238	ミライアル	3,000	1,066.00	3,198,000	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
4245	ダイキアクシス	3,700	823.00	3,045,100	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
4246	ダイキョーニシカワ	22,200	1,063.00	23,598,600	
4248	竹本容器	3,800	1,415.00	5,377,000	
4249	森六ホールディングス	5,700	2,593.00	14,780,100	
4272	日本化薬	67,000	1,303.00	87,301,000	貸付有価証券 41,000株(41,000株)
4275	カーリットホールディングス	11,200	780.00	8,736,000	貸付有価証券 7,600株(7,600株)
4362	日本精化	8,500	1,188.00	10,098,000	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
4368	扶桑化学工業	10,700	1,869.00	19,998,300	貸付有価証券 4,500株(4,500株)
4369	トリケミカル研究所	2,300	5,310.00	12,213,000	貸付有価証券 800株(800株)
4401	A D E K A	51,900	1,593.00	82,676,700	
4403	日油	40,600	3,710.00	150,626,000	
4406	新日本理化	19,000	194.00	3,686,000	貸付有価証券 10,000株(10,000株)
4410	ハリマ化成グループ	8,700	1,015.00	8,830,500	
4452	花王	261,000	8,442.00	2,203,362,000	
4461	第一工業製薬	3,900	3,355.00	13,084,500	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
4462	石原ケミカル	2,700	1,737.00	4,689,900	貸付有価証券 900株(900株)
4463	日華化学	3,500	960.00	3,360,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
4465	ニイタカ	1,600	1,474.00	2,358,400	
4471	三洋化成工業	7,100	5,180.00	36,778,000	

4531	有機合成薬品工業	8,100	197.00	1,595,700	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
4611	大日本塗料	11,900	1,091.00	12,982,900	
4612	日本ペイントホールディングス	86,900	4,300.00	373,670,000	貸付有価証券 50,000株(50,000株)
4613	関西ペイント	118,300	2,120.00	250,796,000	貸付有価証券 70,000株(70,000株)
4615	神東塗料	8,300	173.00	1,435,900	
4617	中国塗料	34,600	947.00	32,766,200	貸付有価証券 24,000株(24,000株)
4619	日本特殊塗料	7,900	1,149.00	9,077,100	貸付有価証券 3,100株(3,100株)
4620	藤倉化成	14,200	572.00	8,122,400	
4626	太陽ホールディングス	8,700	3,660.00	31,842,000	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
4631	D I C	47,600	3,220.00	153,272,000	貸付有価証券 20,400株(20,400株)
4633	サカタインクス	23,000	1,011.00	23,253,000	貸付有価証券 13,900株(13,900株)
4634	東洋インキS Cホールディングス	22,300	2,452.00	54,679,600	貸付有価証券 10,400株(10,400株)
4636	T & K T O K A	8,200	944.00	7,740,800	
4901	富士フイルムホールディングス	223,300	5,004.00	1,117,393,200	
4911	資生堂	213,600	7,808.00	1,667,788,800	
4912	ライオン	149,700	2,320.00	347,304,000	貸付有価証券 66,000株(66,000株)
4914	高砂香料工業	7,400	3,310.00	24,494,000	
4917	マンダム	24,200	2,801.00	67,784,200	
4919	ミルボン	13,300	4,950.00	65,835,000	
4921	ファンケル	47,900	2,801.00	134,167,900	
4922	コーセー	18,200	18,950.00	344,890,000	
4923	コタ	5,100	1,495.00	7,624,500	
4924	シーズ・ホールディングス	2,900	5,880.00	17,052,000	
4926	シーボン	1,300	2,654.00	3,450,200	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	45,900	3,430.00	157,437,000	貸付有価証券 23,600株(23,600株)
4928	ノエビアホールディングス	6,800	5,280.00	35,904,000	
4929	アジュバンコスメジャパン	2,400	946.00	2,270,400	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
4951	エステー	7,700	1,901.00	14,637,700	貸付有価証券 5,600株(5,600株)
4955	アグロ カネショウ	4,400	2,102.00	9,248,800	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
4956	コニシ	19,000	1,578.00	29,982,000	
4958	長谷川香料	12,800	1,807.00	23,129,600	貸付有価証券 10,400株(10,400株)
4963	星光P M C	7,200	778.00	5,601,600	
4967	小林製薬	30,100	8,940.00	269,094,000	

4968	荒川化学工業	9,600	1,278.00	12,268,800	
4971	メック	7,400	1,009.00	7,466,600	
4973	日本高純度化学	3,000	2,380.00	7,140,000	貸付有価証券 500株(500株)
4974	タカラバイオ	28,100	2,541.00	71,402,100	
4975	J C U	13,900	1,767.00	24,561,300	
4977	新田ゼラチン	6,700	700.00	4,690,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
4979	O A T アグリオ	1,500	1,660.00	2,490,000	貸付有価証券 600株(600株)
4980	デクセリアルズ	27,700	739.00	20,470,300	貸付有価証券 11,600株(11,600株)
4985	アース製薬	8,100	5,150.00	41,715,000	貸付有価証券 4,200株(4,200株)
4992	北興化学工業	11,000	529.00	5,819,000	貸付有価証券 800株(800株)
4994	大成ラミック	3,500	2,817.00	9,859,500	
4996	クミアイ化学工業	44,400	761.00	33,788,400	貸付有価証券 30,700株(30,700株)
4997	日本農薬	25,700	452.00	11,616,400	
5142	アキレス	7,800	1,869.00	14,578,200	
5208	有沢製作所	16,900	810.00	13,689,000	貸付有価証券 12,200株(12,200株)
6988	日東電工	81,200	5,771.00	468,605,200	
7874	レック	11,500	1,465.00	16,847,500	貸付有価証券 7,900株(7,900株)
7888	三光合成	9,200	336.00	3,091,200	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
7908	きもと	18,300	168.00	3,074,400	貸付有価証券 7,300株(7,300株)
7917	藤森工業	9,600	3,010.00	28,896,000	
7925	前澤化成工業	7,400	1,015.00	7,511,000	
7931	未来工業	5,800	2,549.00	14,784,200	
7940	ウェーブロックホールディングス	2,200	791.00	1,740,200	
7942	J S P	6,300	2,411.00	15,189,300	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
7947	エフピコ	8,900	6,390.00	56,871,000	貸付有価証券 5,600株(5,600株)
7958	天馬	7,400	2,041.00	15,103,400	
7970	信越ポリマー	19,300	809.00	15,613,700	
7971	東リ	26,800	262.00	7,021,600	
7988	ニフコ	43,100	2,743.00	118,223,300	貸付有価証券 25,800株(25,800株)
7995	バルカー	8,700	2,200.00	19,140,000	
8113	ユニ・チャーム	227,900	3,518.00	801,752,200	貸付有価証券 106,200株(106,200株)
9385	ショーエイコーポレーション	600	909.00	545,400	

4151	協和発酵キリン	134,700	2,279.00	306,981,300	
4502	武田薬品工業	938,400	4,599.00	4,315,701,600	
4503	アステラス製薬	991,100	1,631.50	1,616,979,650	
4506	大日本住友製薬	79,700	2,657.00	211,762,900	貸付有価証券 40,800株(40,800株)
4507	塩野義製薬	140,600	6,448.00	906,588,800	
4508	田辺三菱製薬	112,400	1,498.00	168,375,200	
4512	わかもと製薬	12,800	275.00	3,520,000	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
4514	あすか製薬	13,300	1,179.00	15,680,700	貸付有価証券 4,400株(4,400株)
4516	日本新薬	28,100	7,430.00	208,783,000	
4517	ビオフェルミン製薬	1,800	2,315.00	4,167,000	
4519	中外製薬	112,100	7,320.00	820,572,000	貸付有価証券 15,300株(15,300株)
4521	科研製薬	19,400	5,070.00	98,358,000	
4523	エーザイ	128,700	6,065.00	780,565,500	
4527	ロート製薬	55,100	2,743.00	151,139,300	貸付有価証券 24,000株(24,000株)
4528	小野薬品工業	253,900	2,162.50	549,058,750	
4530	久光製薬	31,800	4,770.00	151,686,000	
4534	持田製薬	8,100	10,970.00	88,857,000	貸付有価証券 4,300株(4,300株)
4536	参天製薬	203,800	1,597.00	325,468,600	
4538	扶桑薬品工業	3,800	2,526.00	9,598,800	
4539	日本ケミファ	1,400	2,921.00	4,089,400	
4540	ツムラ	33,300	3,245.00	108,058,500	貸付有価証券 16,900株(16,900株)
4541	日医工	27,600	1,500.00	41,400,000	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
4547	キッセイ薬品工業	19,000	2,794.00	53,086,000	
4548	生化学工業	20,900	1,258.00	26,292,200	貸付有価証券 5,200株(5,200株)
4549	栄研化学	18,900	2,594.00	49,026,600	貸付有価証券 13,800株(13,800株)
4550	日水製薬	4,500	1,194.00	5,373,000	
4551	鳥居薬品	5,800	2,203.00	12,777,400	
4552	JCRファーマ	7,600	6,210.00	47,196,000	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
4553	東和薬品	5,200	8,940.00	46,488,000	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
4554	富士製薬工業	7,300	1,691.00	12,344,300	
4555	沢井製薬	22,100	6,400.00	141,440,000	
4559	ゼリア新薬工業	21,300	1,849.00	39,383,700	貸付有価証券 16,900株(16,900株)
4568	第一三共	307,600	4,250.00	1,307,300,000	
4569	キョーリン製薬ホールディングス	23,700	2,108.00	49,959,600	貸付有価証券 6,100株(6,100株)

4574	大幸薬品	4,800	1,859.00	8,923,200	
4577	ダイト	6,300	2,769.00	17,444,700	
4578	大塚ホールディングス	204,800	4,346.00	890,060,800	
4581	大正製薬ホールディングス	24,100	10,360.00	249,676,000	
4587	ペプチドリーム	53,600	5,270.00	282,472,000	貸付有価証券 32,800株(32,800株)
3315	日本コークス工業	90,800	102.00	9,261,600	
5002	昭和シェル石油	51,500	1,682.00	86,623,000	
5011	ニチレキ	13,700	1,107.00	15,165,900	
5013	ユシロ化学工業	5,600	1,276.00	7,145,600	
5015	ビーピー・カストロール	3,800	1,373.00	5,217,400	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
5017	富士石油	26,100	259.00	6,759,900	貸付有価証券 19,200株(19,200株)
5018	MORESCO	3,900	1,433.00	5,588,700	
5019	出光興産	103,900	3,970.00	412,483,000	
5020	JXTGホールディングス	1,808,000	526.80	952,454,400	
5021	コスモエネルギーホールディングス	31,100	2,532.00	78,745,200	貸付有価証券 15,900株(15,900株)
5101	横浜ゴム	62,200	2,020.00	125,644,000	貸付有価証券 32,000株(32,000株)
5105	TOYO TIRE	55,200	1,286.00	70,987,200	貸付有価証券 24,000株(24,000株)
5108	ブリヂストン	330,400	4,210.00	1,390,984,000	
5110	住友ゴム工業	96,600	1,322.00	127,705,200	貸付有価証券 48,800株(48,800株)
5121	藤倉ゴム工業	9,400	435.00	4,089,000	貸付有価証券 6,800株(6,800株)
5122	オカモト	7,500	5,690.00	42,675,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
5185	フコク	4,700	883.00	4,150,100	
5186	ニッタ	12,100	3,550.00	42,955,000	貸付有価証券 8,900株(8,900株)
5191	住友理工	20,800	901.00	18,740,800	貸付有価証券 14,600株(14,600株)
5192	三ツ星ベルト	14,100	1,950.00	27,495,000	
5195	バンドー化学	20,500	1,105.00	22,652,500	
3110	日東紡績	16,000	1,971.00	31,536,000	貸付有価証券 3,800株(3,800株)
5201	A G C	106,300	3,770.00	400,751,000	
5202	日本板硝子	51,400	893.00	45,900,200	貸付有価証券 40,000株(40,000株)
5204	石塚硝子	1,800	1,752.00	3,153,600	
5210	日本山村硝子	4,500	1,463.00	6,583,500	
5214	日本電気硝子	46,500	2,842.00	132,153,000	
5218	オハラ	4,200	1,220.00	5,124,000	貸付有価証券 3,100株(3,100株)

5232	住友大阪セメント	21,700	4,285.00	92,984,500	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
5233	太平洋セメント	67,900	3,625.00	246,137,500	
5262	日本ヒューム	10,800	747.00	8,067,600	
5269	日本コンクリート工業	23,100	274.00	6,329,400	貸付有価証券 13,000株(13,000株)
5273	三谷セキサン	5,000	2,922.00	14,610,000	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
5288	アジアパイルホールディングス	15,200	595.00	9,044,000	
5301	東海カーボン	97,600	1,363.00	133,028,800	貸付有価証券 72,000株(72,000株)
5302	日本カーボン	5,100	4,765.00	24,301,500	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
5310	東洋炭素	6,300	2,010.00	12,663,000	貸付有価証券 4,500株(4,500株)
5331	ノリタケカンパニーリミテド	6,400	5,130.00	32,832,000	
5332	TOTO	82,700	4,500.00	372,150,000	
5333	日本碍子	131,200	1,629.00	213,724,800	
5334	日本特殊陶業	90,600	2,080.00	188,448,000	
5337	ダントーホールディングス	9,000	105.00	945,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
5344	MARUWA	3,700	5,070.00	18,759,000	
5351	品川リフラクトリーズ	2,800	3,170.00	8,876,000	
5352	黒崎播磨	2,100	5,780.00	12,138,000	
5357	ヨータイ	9,400	525.00	4,935,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
5358	イソライト工業	5,500	509.00	2,799,500	
5363	東京窯業	13,700	363.00	4,973,100	貸付有価証券 10,000株(10,000株)
5367	ニッカトー	4,900	907.00	4,444,300	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
5384	フジインコーポレーテッド	9,600	2,397.00	23,011,200	
5388	クミネ工業	3,600	808.00	2,908,800	
5391	エーアンドエーマテリアル	2,100	1,042.00	2,188,200	
5393	ニチアス	29,400	2,112.00	62,092,800	
7943	ニチハ	14,900	2,906.00	43,299,400	
5401	新日鐵住金	493,900	1,962.00	969,031,800	
5406	神戸製鋼所	194,600	839.00	163,269,400	
5408	中山製鋼所	14,700	493.00	7,247,100	
5410	合同製鐵	5,100	1,713.00	8,736,300	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	287,100	1,896.00	544,341,600	
5423	東京製鐵	56,900	928.00	52,803,200	貸付有価証券 31,800株(31,800株)
5440	共英製鋼	12,000	1,593.00	19,116,000	貸付有価証券 8,800株(8,800株)
5444	大和工業	22,600	2,993.00	67,641,800	

5445	東京鐵鋼	4,400	1,278.00	5,623,200	貸付有価証券 3,300株(3,300株)
5449	大阪製鐵	7,100	1,950.00	13,845,000	
5451	淀川製鋼所	14,400	2,094.00	30,153,600	
5463	丸一鋼管	37,600	3,255.00	122,388,000	
5464	モリ工業	3,200	2,396.00	7,667,200	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
5471	大同特殊鋼	17,400	4,405.00	76,647,000	
5476	日本高周波鋼業	3,900	521.00	2,031,900	
5480	日本冶金工業	87,900	244.00	21,447,600	貸付有価証券 60,900株(60,900株)
5481	山陽特殊製鋼	13,400	2,309.00	30,940,600	
5482	愛知製鋼	6,000	3,470.00	20,820,000	
5486	日立金属	114,500	1,300.00	148,850,000	
5491	日本金属	2,500	1,179.00	2,947,500	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
5541	大平洋金属	7,200	2,756.00	19,843,200	貸付有価証券 4,500株(4,500株)
5563	新日本電工	63,700	223.00	14,205,100	貸付有価証券 46,800株(46,800株)
5602	栗本鐵工所	5,400	1,460.00	7,884,000	
5603	虹技	1,600	1,388.00	2,220,800	
5612	日本鑄鉄管	1,100	878.00	965,800	貸付有価証券 600株(600株)
5632	三菱製鋼	7,900	1,584.00	12,513,600	貸付有価証券 5,600株(5,600株)
5658	日亜鋼業	15,500	355.00	5,502,500	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
5659	日本精線	1,500	3,345.00	5,017,500	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
5698	エンビプロ・ホールディングス	3,000	627.00	1,881,000	貸付有価証券 700株(700株)
6319	シンニッタン	16,500	351.00	5,791,500	貸付有価証券 11,800株(11,800株)
7305	新家工業	2,400	1,632.00	3,916,800	
5702	大紀アルミニウム工業所	17,500	679.00	11,882,500	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
5703	日本軽金属ホールディングス	289,600	247.00	71,531,200	
5706	三井金属鉱業	28,700	2,811.00	80,675,700	
5707	東邦亜鉛	5,900	3,160.00	18,644,000	貸付有価証券 4,300株(4,300株)
5711	三菱マテリアル	70,200	2,912.00	204,422,400	
5713	住友金属鉱山	145,600	3,170.00	461,552,000	
5714	DOWAホールディングス	24,800	3,670.00	91,016,000	貸付有価証券 8,600株(8,600株)
5715	古河機械金属	17,500	1,401.00	24,517,500	貸付有価証券 9,800株(9,800株)
5721	エス・サイエンス	47,000	62.00	2,914,000	

5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	12,300	1,655.00	20,356,500	貸付有価証券 8,100株(8,100株)
5727	東邦チタニウム	19,000	942.00	17,898,000	貸付有価証券 14,000株(14,000株)
5741	U A C J	16,100	2,146.00	34,550,600	貸付有価証券 11,500株(11,500株)
5757	C K サンエツ	2,000	3,105.00	6,210,000	
5801	古河電気工業	30,700	2,834.00	87,003,800	
5802	住友電気工業	397,400	1,478.00	587,357,200	
5803	フジクラ	128,400	416.00	53,414,400	
5805	昭和電線ホールディングス	12,300	698.00	8,585,400	
5807	東京特殊電線	1,400	2,125.00	2,975,000	
5809	タツタ電線	21,100	451.00	9,516,100	
5819	カナレ電気	1,800	1,919.00	3,454,200	
5821	平河ヒューテック	4,400	1,497.00	6,586,800	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
5851	リョービ	13,100	2,397.00	31,400,700	
5852	アーレスティ	13,100	652.00	8,541,200	
5857	アサヒホールディングス	20,000	2,168.00	43,360,000	貸付有価証券 12,400株(12,400株)
3421	稲葉製作所	6,000	1,372.00	8,232,000	
3431	宮地エンジニアリンググループ	3,200	1,918.00	6,137,600	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
3433	トーカロ	27,400	848.00	23,235,200	貸付有価証券 12,100株(12,100株)
3434	アルファC o	3,700	1,327.00	4,909,900	
3436	S U M C O	117,500	1,235.00	145,112,500	貸付有価証券 35,300株(35,300株)
3443	川田テクノロジーズ	2,400	7,700.00	18,480,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
3445	R S Technologies	2,100	2,896.00	6,081,600	貸付有価証券 700株(700株)
3447	信和	4,300	1,064.00	4,575,200	
5901	東洋製罐グループホールディングス	67,700	2,299.00	155,642,300	
5902	ホッカホホールディングス	5,400	1,951.00	10,535,400	
5909	コロナ	5,900	1,081.00	6,377,900	
5911	横河ブリッジホールディングス	19,800	1,896.00	37,540,800	貸付有価証券 6,400株(6,400株)
5915	駒井ハルテック	2,000	1,894.00	3,788,000	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
5923	高田機工	1,000	2,622.00	2,622,000	
5929	三和ホールディングス	109,800	1,271.00	139,555,800	
5930	文化シャッター	31,300	814.00	25,478,200	
5932	三協立山	14,700	1,488.00	21,873,600	貸付有価証券 10,800株(10,800株)
5933	アルインコ	8,400	976.00	8,198,400	
5936	東洋シャッター	2,600	716.00	1,861,600	貸付有価証券 1,500株(1,500株)

5938	L I X I Lグループ	156,800	1,467.00	230,025,600	
5942	日本ファイルコン	8,100	515.00	4,171,500	
5943	ノーリツ	23,700	1,672.00	39,626,400	貸付有価証券 500株(500株)
5946	長府製作所	10,800	2,265.00	24,462,000	貸付有価証券 6,500株(6,500株)
5947	リンナイ	18,900	7,700.00	145,530,000	
5951	ダイニチ工業	5,700	674.00	3,841,800	
5957	日東精工	14,700	545.00	8,011,500	
5958	三洋工業	1,400	1,897.00	2,655,800	
5959	岡部	21,500	952.00	20,468,000	
5970	ジーテクト	11,700	1,525.00	17,842,500	貸付有価証券 5,400株(5,400株)
5974	中国工業	1,600	556.00	889,600	
5975	東プレ	19,800	2,084.00	41,263,200	貸付有価証券 15,900株(15,900株)
5976	高周波熱錬	20,500	890.00	18,245,000	
5981	東京製綱	6,500	968.00	6,292,000	貸付有価証券 4,400株(4,400株)
5985	サンコール	6,000	624.00	3,744,000	
5986	モリテック スチール	8,300	408.00	3,386,400	貸付有価証券 4,100株(4,100株)
5988	パイオラックス	17,000	2,121.00	36,057,000	貸付有価証券 12,300株(12,300株)
5989	エイチワン	10,400	909.00	9,453,600	
5991	日本発條	105,900	976.00	103,358,400	
5992	中央発條	1,300	2,901.00	3,771,300	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
5998	アドバネクス	1,400	1,637.00	2,291,800	貸付有価証券 900株(900株)
7989	立川ブラインド工業	4,700	1,119.00	5,259,300	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
8155	三益半導体工業	9,500	1,498.00	14,231,000	貸付有価証券 4,400株(4,400株)
1909	日本ドライケミカル	2,900	1,080.00	3,132,000	貸付有価証券 100株(100株)
5631	日本製鋼所	32,200	2,023.00	65,140,600	貸付有価証券 8,100株(8,100株)
6005	三浦工業	46,000	2,476.00	113,896,000	貸付有価証券 27,000株(27,000株)
6013	タクマ	38,800	1,308.00	50,750,400	
6101	ツガミ	23,900	796.00	19,024,400	貸付有価証券 16,400株(16,400株)
6103	オークマ	13,500	5,760.00	77,760,000	貸付有価証券 7,400株(7,400株)
6104	東芝機械	12,000	2,156.00	25,872,000	貸付有価証券 8,800株(8,800株)
6113	アマダホールディングス	164,000	1,060.00	173,840,000	
6118	アイダエンジニアリング	29,500	799.00	23,570,500	

6121	滝澤鉄工所	3,300	1,569.00	5,177,700	
6134	F U J I	31,800	1,493.00	47,477,400	
6135	牧野フライス製作所	12,500	4,130.00	51,625,000	
6136	オーエスジー	52,400	1,998.00	104,695,200	貸付有価証券 4,400株(4,400株)
6138	ダイジェット工業	1,200	1,697.00	2,036,400	
6140	旭ダイヤモンド工業	27,900	745.00	20,785,500	
6141	D M G 森精機	67,300	1,334.00	89,778,200	貸付有価証券 30,400株(30,400株)
6143	ソディック	23,200	806.00	18,699,200	
6146	ディスコ	14,400	15,050.00	216,720,000	貸付有価証券 6,400株(6,400株)
6151	日東工器	5,800	2,156.00	12,504,800	
6157	日進工具	3,100	2,489.00	7,715,900	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
6165	バンチ工業	7,400	596.00	4,410,400	
6167	富士ダイス	4,700	655.00	3,078,500	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
6203	豊和工業	5,900	996.00	5,876,400	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
6205	O K K	4,400	799.00	3,515,600	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
6208	石川製作所	2,600	1,725.00	4,485,000	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
6210	東洋機械金属	7,600	590.00	4,484,000	貸付有価証券 4,200株(4,200株)
6217	津田駒工業	2,300	1,788.00	4,112,400	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
6218	エンシュウ	2,800	1,169.00	3,273,200	
6222	島精機製作所	14,700	3,470.00	51,009,000	貸付有価証券 5,300株(5,300株)
6235	オプトラン	10,400	2,007.00	20,872,800	
6236	N C ホールディングス	3,400	503.00	1,710,200	
6237	イワキポンプ	3,500	937.00	3,279,500	
6238	フリュー	8,500	980.00	8,330,000	
6240	ヤマシンフィルタ	18,500	747.00	13,819,500	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
6247	日阪製作所	13,100	894.00	11,711,400	
6250	やまびこ	20,600	1,040.00	21,424,000	
6258	平田機工	5,000	7,370.00	36,850,000	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
6262	ベガサスミシン製造	9,900	626.00	6,197,400	貸付有価証券 5,100株(5,100株)
6264	マルマエ	2,900	689.00	1,998,100	
6266	タツモ	3,300	724.00	2,389,200	
6268	ナブテスコ	58,500	3,095.00	181,057,500	貸付有価証券 26,300株(26,300株)

6269	三井海洋開発	11,300	3,245.00	36,668,500	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
6272	レオン自動機	10,400	1,532.00	15,932,800	貸付有価証券 6,800株(6,800株)
6273	S M C	31,500	40,050.00	1,261,575,000	貸付有価証券 4,600株(4,600株)
6274	新川	8,000	422.00	3,376,000	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
6277	ホソカワミクロン	3,700	4,920.00	18,204,000	
6278	ユニオンツール	4,600	2,884.00	13,266,400	貸付有価証券 800株(800株)
6282	オイレス工業	14,900	1,871.00	27,877,900	貸付有価証券 10,700株(10,700株)
6284	日精エー・エス・ピー機械	3,100	3,780.00	11,718,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
6287	サトーホールディングス	12,800	2,481.00	31,756,800	
6289	技研製作所	7,400	3,320.00	24,568,000	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
6291	日本エアーテック	3,300	569.00	1,877,700	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
6292	カワタ	2,200	1,338.00	2,943,600	貸付有価証券 700株(700株)
6293	日精樹脂工業	8,900	893.00	7,947,700	
6294	オカダアイヨン	3,600	1,319.00	4,748,400	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
6298	ワイエイシイホールディングス	4,200	710.00	2,982,000	貸付有価証券 800株(800株)
6301	小松製作所	486,700	2,554.50	1,243,275,150	
6302	住友重機械工業	61,500	3,530.00	217,095,000	
6305	日立建機	43,100	2,873.00	123,826,300	
6306	日工	2,900	2,305.00	6,684,500	貸付有価証券 800株(800株)
6309	巴工業	4,600	2,492.00	11,463,200	貸付有価証券 700株(700株)
6310	井関農機	10,700	1,611.00	17,237,700	貸付有価証券 8,400株(8,400株)
6315	T O W A	9,200	678.00	6,237,600	貸付有価証券 6,900株(6,900株)
6316	丸山製作所	2,300	1,326.00	3,049,800	
6317	北川鉄工所	4,800	2,257.00	10,833,600	
6323	ローツェ	4,700	1,611.00	7,571,700	貸付有価証券 700株(700株)
6325	タカキタ	3,700	578.00	2,138,600	
6326	クボタ	575,900	1,550.50	892,932,950	貸付有価証券 134,300株(134,300株)
6328	荏原実業	3,100	1,964.00	6,088,400	
6331	三菱化工機	3,700	1,531.00	5,664,700	貸付有価証券 2,700株(2,700株)

6332	月島機械	21,300	1,404.00	29,905,200	貸付有価証券 14,700株(14,700株)
6333	帝国電機製作所	7,500	1,123.00	8,422,500	
6335	東京機械製作所	4,200	419.00	1,759,800	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
6339	新東工業	25,500	940.00	23,970,000	貸付有価証券 4,300株(4,300株)
6340	澁谷工業	9,400	3,225.00	30,315,000	貸付有価証券 300株(300株)
6345	アイチ コーポレーション	18,600	702.00	13,057,200	
6349	小森コーポレーション	29,100	1,158.00	33,697,800	
6351	鶴見製作所	8,400	1,978.00	16,615,200	貸付有価証券 6,100株(6,100株)
6355	住友精密工業	1,800	2,987.00	5,376,600	
6358	酒井重工業	2,000	2,587.00	5,174,000	
6361	荏原製作所	47,600	3,000.00	142,800,000	貸付有価証券 25,400株(25,400株)
6362	石井鐵工所	1,600	1,900.00	3,040,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
6363	西島製作所	11,000	912.00	10,032,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
6364	北越工業	11,100	1,120.00	12,432,000	
6367	ダイキン工業	146,700	12,225.00	1,793,407,500	
6368	オルガノ	3,900	3,075.00	11,992,500	
6369	トーヨーカネツ	4,000	2,086.00	8,344,000	
6370	栗田工業	58,200	2,710.00	157,722,000	
6371	椿本チエイン	14,100	3,890.00	54,849,000	貸付有価証券 200株(200株)
6373	大同工業	5,100	858.00	4,375,800	
6378	木村化工機	8,900	374.00	3,328,600	貸付有価証券 2,900株(2,900株)
6381	アネスト岩田	16,700	936.00	15,631,200	
6383	ダイフク	59,200	5,640.00	333,888,000	貸付有価証券 23,500株(23,500株)
6387	サムコ	3,000	836.00	2,508,000	貸付有価証券 800株(800株)
6390	加藤製作所	5,500	2,646.00	14,553,000	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
6393	油研工業	1,800	1,756.00	3,160,800	
6395	タダノ	51,900	1,019.00	52,886,100	貸付有価証券 38,000株(38,000株)
6406	フジテック	39,100	1,217.00	47,584,700	
6407	C K D	29,900	987.00	29,511,300	貸付有価証券 22,000株(22,000株)
6409	キトー	8,100	1,654.00	13,397,400	
6412	平和	30,000	2,231.00	66,930,000	
6413	理想科学工業	9,500	1,770.00	16,815,000	
6417	S A N K Y O	26,900	4,200.00	112,980,000	

6418	日本金銭機械	11,900	1,085.00	12,911,500	貸付有価証券 700株(700株)
6419	マースグループホールディングス	6,800	2,184.00	14,851,200	
6420	福島工業	6,600	3,640.00	24,024,000	
6428	オーイズミ	4,500	362.00	1,629,000	貸付有価証券 900株(900株)
6430	ダイコク電機	4,900	1,414.00	6,928,600	
6432	竹内製作所	18,000	1,871.00	33,678,000	
6436	アマノ	30,700	2,472.00	75,890,400	
6440	J U K I	15,000	1,094.00	16,410,000	
6444	サンデンホールディングス	13,100	745.00	9,759,500	貸付有価証券 8,600株(8,600株)
6445	蛇の目ミシン工業	9,800	462.00	4,527,600	
6454	マックス	16,500	1,585.00	26,152,500	
6457	グローリー	29,800	2,624.00	78,195,200	
6458	新晃工業	10,000	1,493.00	14,930,000	
6459	大和冷機工業	15,500	1,093.00	16,941,500	
6460	セガサミーホールディングス	106,600	1,312.00	139,859,200	
6461	日本ピストンリング	3,900	1,609.00	6,275,100	
6462	リケン	5,000	4,980.00	24,900,000	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
6463	T P R	14,500	2,138.00	31,001,000	
6464	ツバキ・ナカシマ	16,300	1,847.00	30,106,100	貸付有価証券 6,800株(6,800株)
6465	ホシザキ	31,400	6,800.00	213,520,000	
6470	大豊工業	8,800	917.00	8,069,600	
6471	日本精工	220,800	1,010.00	223,008,000	
6472	N T N	231,000	332.00	76,692,000	貸付有価証券 128,000株(128,000株)
6473	ジェイテクト	103,100	1,355.00	139,700,500	
6474	不二越	10,000	4,390.00	43,900,000	貸付有価証券 7,300株(7,300株)
6480	日本トムソン	31,900	500.00	15,950,000	
6481	T H K	67,000	2,701.00	180,967,000	
6482	ユーシン精機	8,300	1,027.00	8,524,100	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
6485	前澤給装工業	4,200	1,936.00	8,131,200	
6486	イーグル工業	13,300	1,224.00	16,279,200	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
6489	前澤工業	7,200	336.00	2,419,200	
6490	日本ビラー工業	10,900	1,263.00	13,766,700	
6498	キッツ	43,600	781.00	34,051,600	
6586	マキタ	130,800	3,635.00	475,458,000	
7004	日立造船	85,200	337.00	28,712,400	貸付有価証券 5,900株(5,900株)

7011	三菱重工業	180,100	4,601.00	828,640,100	
7013	I H I	82,600	2,595.00	214,347,000	
7718	スター精密	18,300	1,632.00	29,865,600	
3105	日清紡ホールディングス	59,700	925.00	55,222,500	
4062	イビデン	65,800	1,655.00	108,899,000	貸付有価証券 33,500株(33,500株)
4902	コニカミノルタ	234,900	1,074.00	252,282,600	
6448	ブラザー工業	140,000	1,993.00	279,020,000	貸付有価証券 71,200株(71,200株)
6479	ミネベアミツミ	199,500	1,611.00	321,394,500	
6501	日立製作所	483,900	3,519.00	1,702,844,100	
6503	三菱電機	1,074,900	1,403.00	1,508,084,700	
6504	富士電機	69,800	3,210.00	224,058,000	
6505	東洋電機製造	4,200	1,177.00	4,943,400	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
6506	安川電機	124,600	3,360.00	418,656,000	貸付有価証券 60,000株(60,000株)
6507	シンフォニアテクノロジー	14,900	1,335.00	19,891,500	
6508	明電舎	21,300	1,509.00	32,141,700	
6513	オリジン電気	2,900	2,000.00	5,800,000	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
6516	山洋電気	5,200	3,955.00	20,566,000	貸付有価証券 300株(300株)
6517	デンヨー	9,900	1,345.00	13,315,500	貸付有価証券 4,400株(4,400株)
6588	東芝テック	13,500	3,155.00	42,592,500	
6590	芝浦メカトロニクス	1,900	3,510.00	6,669,000	
6592	マブチモーター	29,700	3,790.00	112,563,000	貸付有価証券 15,400株(15,400株)
6594	日本電産	129,300	13,360.00	1,727,448,000	
6615	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,800	1,529.00	8,868,200	
6616	トレックス・セミコンダクター	3,600	1,169.00	4,208,400	
6617	東光高岳	5,400	1,342.00	7,246,800	
6619	ダブル・スコープ	15,700	1,505.00	23,628,500	貸付有価証券 8,400株(8,400株)
6620	宮越ホールディングス	4,000	983.00	3,932,000	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
6622	ダイヘン	11,800	2,702.00	31,883,600	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
6624	田淵電機	14,900	115.00	1,713,500	
6630	ヤーマン	15,600	1,177.00	18,361,200	貸付有価証券 5,400株(5,400株)
6632	JVCケンウッド	82,100	262.00	21,510,200	
6638	ミマキエンジニアリング	9,600	641.00	6,153,600	
6640	第一精工	4,500	1,029.00	4,630,500	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
6641	日新電機	25,200	978.00	24,645,600	貸付有価証券 4,400株(4,400株)

6644	大崎電気工業	21,400	690.00	14,766,000	
6645	オムロン	114,200	5,090.00	581,278,000	貸付有価証券 46,300株(46,300株)
6651	日東工業	17,200	2,140.00	36,808,000	貸付有価証券 12,600株(12,600株)
6652	I D E C	14,400	1,836.00	26,438,400	貸付有価証券 10,300株(10,300株)
6653	正興電機製作所	1,900	769.00	1,461,100	
6654	不二電機工業	1,200	1,281.00	1,537,200	
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	38,600	2,146.00	82,835,600	
6675	サクサホールディングス	2,700	1,698.00	4,584,600	貸付有価証券 100株(100株)
6676	メルコホールディングス	4,500	3,710.00	16,695,000	
6678	テクノメディカ	2,400	2,092.00	5,020,800	貸付有価証券 500株(500株)
6701	日本電気	139,100	3,755.00	522,320,500	貸付有価証券 29,800株(29,800株)
6702	富士通	103,600	7,814.00	809,530,400	
6703	沖電気工業	46,600	1,331.00	62,024,600	
6704	岩崎通信機	5,000	798.00	3,990,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
6706	電気興業	5,600	3,250.00	18,200,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
6707	サンケン電気	12,600	2,003.00	25,237,800	貸付有価証券 8,400株(8,400株)
6715	ナカヨ	2,100	1,495.00	3,139,500	
6718	アイホン	6,100	1,805.00	11,010,500	
6723	ルネサスエレクトロニクス	111,400	518.00	57,705,200	
6724	セイコーエプソン	133,400	1,669.00	222,644,600	
6727	ワコム	77,800	451.00	35,087,800	貸付有価証券 43,300株(43,300株)
6728	アルバック	21,400	3,050.00	65,270,000	貸付有価証券 9,300株(9,300株)
6730	アクセル	4,500	466.00	2,097,000	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
6737	E I Z O	9,900	4,455.00	44,104,500	貸付有価証券 7,800株(7,800株)
6740	ジャパンディスプレイ	254,200	70.00	17,794,000	貸付有価証券 181,400株(181,400株)
6741	日本信号	27,400	983.00	26,934,200	貸付有価証券 21,800株(21,800株)
6742	京三製作所	23,100	367.00	8,477,700	貸付有価証券 700株(700株)
6744	能美防災	14,200	1,803.00	25,602,600	
6745	ホーチキ	6,800	1,097.00	7,459,600	
6748	星和電機	4,300	487.00	2,094,100	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
6750	エレコム	10,000	3,315.00	33,150,000	

6752	パナソニック	1,228,000	940.10	1,154,442,800	
6753	シャープ	106,600	1,181.00	125,894,600	貸付有価証券 36,800株(36,800株)
6754	アンリツ	69,200	2,049.00	141,790,800	
6755	富士通ゼネラル	32,800	1,463.00	47,986,400	
6758	ソニー	721,000	4,630.00	3,338,230,000	
6762	T D K	56,200	8,520.00	478,824,000	
6763	帝国通信工業	4,700	1,207.00	5,672,900	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
6768	タムラ製作所	41,400	585.00	24,219,000	
6770	アルプスアルパイン	111,900	2,247.00	251,439,300	
6771	池上通信機	3,400	1,122.00	3,814,800	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
6779	日本電波工業	9,700	392.00	3,802,400	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
6785	鈴木	5,800	635.00	3,683,000	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
6788	日本トリム	2,000	5,660.00	11,320,000	
6789	ローランド ディー . ジー .	5,500	2,279.00	12,534,500	
6794	フォスター電機	12,600	1,526.00	19,227,600	
6798	S M K	3,000	2,583.00	7,749,000	
6800	ヨコオ	7,700	1,559.00	12,004,300	貸付有価証券 5,600株(5,600株)
6803	ティアック	7,700	191.00	1,470,700	貸付有価証券 4,500株(4,500株)
6804	ホシデン	31,600	904.00	28,566,400	貸付有価証券 12,400株(12,400株)
6806	ヒロセ電機	15,400	11,390.00	175,406,000	貸付有価証券 7,300株(7,300株)
6807	日本航空電子工業	24,600	1,494.00	36,752,400	
6809	T O A	11,500	1,046.00	12,029,000	
6810	マクセルホールディングス	23,100	1,580.00	36,498,000	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
6814	古野電気	13,800	1,000.00	13,800,000	貸付有価証券 7,800株(7,800株)
6815	ユニデンホールディングス	3,200	2,170.00	6,944,000	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
6817	スミダコーポレーション	9,200	1,504.00	13,836,800	
6820	アイコム	5,900	2,253.00	13,292,700	
6823	リオン	4,900	2,096.00	10,270,400	
6826	本多通信工業	9,200	535.00	4,922,000	
6839	船井電機	10,900	707.00	7,706,300	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
6841	横河電機	107,600	2,167.00	233,169,200	
6844	新電元工業	3,800	4,250.00	16,150,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
6845	アズビル	69,400	2,535.00	175,929,000	
6848	東亜ディーケーケー	5,300	744.00	3,943,200	

6849	日本光電工業	47,400	3,450.00	163,530,000	
6850	チノー	3,700	1,313.00	4,858,100	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
6853	共和電業	11,200	387.00	4,334,400	
6855	日本電子材料	4,200	654.00	2,746,800	貸付有価証券 3,100株(3,100株)
6856	堀場製作所	21,300	5,930.00	126,309,000	貸付有価証券 10,200株(10,200株)
6857	アドバンテスト	73,300	2,498.00	183,103,400	
6858	小野測器	5,000	603.00	3,015,000	
6859	エスベック	9,500	2,003.00	19,028,500	
6861	キーエンス	52,800	69,090.00	3,647,952,000	
6866	日置電機	5,600	4,595.00	25,732,000	貸付有価証券 4,100株(4,100株)
6869	シスメックス	83,800	6,746.00	565,314,800	
6871	日本マイクロニクス	17,400	731.00	12,719,400	
6875	メガチップス	8,500	1,596.00	13,566,000	
6877	O B A R A G R O U P	6,300	3,645.00	22,963,500	
6901	澤藤電機	1,300	1,600.00	2,080,000	貸付有価証券 400株(400株)
6904	原田工業	3,300	921.00	3,039,300	
6905	コーセル	13,700	1,157.00	15,850,900	貸付有価証券 10,900株(10,900株)
6908	イリソ電子工業	9,800	4,940.00	48,412,000	貸付有価証券 3,800株(3,800株)
6914	オプテックスグループ	18,900	1,752.00	33,112,800	
6915	千代田インテグレ	4,500	1,981.00	8,914,500	
6916	アイ・オー・データ機器	4,000	1,139.00	4,556,000	貸付有価証券 700株(700株)
6920	レーザーテック	22,000	4,785.00	105,270,000	貸付有価証券 11,600株(11,600株)
6923	スタンレー電気	76,000	2,917.00	221,692,000	
6924	岩崎電気	4,200	1,377.00	5,783,400	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
6925	ウシオ電機	65,200	1,311.00	85,477,200	貸付有価証券 33,400株(33,400株)
6926	岡谷電機産業	7,600	373.00	2,834,800	貸付有価証券 4,200株(4,200株)
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	9,900	694.00	6,870,600	貸付有価証券 6,700株(6,700株)
6928	エノモト	2,200	877.00	1,929,400	
6929	日本セラミック	10,900	2,889.00	31,490,100	貸付有価証券 4,500株(4,500株)
6932	遠藤照明	5,400	752.00	4,060,800	
6937	古河電池	7,700	695.00	5,351,500	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
6938	双信電機	5,200	541.00	2,813,200	貸付有価証券 3,800株(3,800株)

6941	山一電機	7,800	1,070.00	8,346,000	
6947	図研	7,000	1,447.00	10,129,000	
6951	日本電子	21,200	1,916.00	40,619,200	
6952	カシオ計算機	95,100	1,440.00	136,944,000	貸付有価証券 57,200株(57,200株)
6954	ファナック	102,100	18,800.00	1,919,480,000	
6958	日本シイエムケイ	27,400	634.00	17,371,600	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
6961	エンブラス	4,900	2,864.00	14,033,600	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
6962	大真空	3,900	1,057.00	4,122,300	
6963	ローム	52,000	6,880.00	357,760,000	
6965	浜松ホトニクス	77,100	4,165.00	321,121,500	
6966	三井ハイテック	11,900	1,018.00	12,114,200	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
6967	新光電気工業	36,100	830.00	29,963,000	
6971	京セラ	163,800	6,305.00	1,032,759,000	
6976	太陽誘電	47,800	2,061.00	98,515,800	貸付有価証券 26,800株(26,800株)
6981	村田製作所	112,800	16,015.00	1,806,492,000	
6985	ユーシン	15,000	983.00	14,745,000	
6986	双葉電子工業	17,600	1,800.00	31,680,000	貸付有価証券 10,200株(10,200株)
6989	北陸電気工業	4,000	1,042.00	4,168,000	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
6996	ニチコン	33,800	973.00	32,887,400	貸付有価証券 24,800株(24,800株)
6997	日本ケミコン	7,600	1,887.00	14,341,200	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
6999	K O A	16,200	1,506.00	24,397,200	
7244	市光工業	16,100	592.00	9,531,200	
7276	小糸製作所	64,400	6,110.00	393,484,000	
7280	ミツバ	19,800	625.00	12,375,000	貸付有価証券 13,400株(13,400株)
7735	S C R E E Nホールディングス	18,600	4,425.00	82,305,000	
7739	キャノン電子	9,900	1,711.00	16,938,900	
7751	キャノン	578,700	3,140.00	1,817,118,000	貸付有価証券 319,200株(319,200株)
7752	リコー	323,200	1,129.00	364,892,800	
7965	象印マホービン	20,000	1,062.00	21,240,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
7999	M U T O Hホールディングス	1,500	1,916.00	2,874,000	
8035	東京エレクトロン	71,700	16,200.00	1,161,540,000	
3116	トヨタ紡織	37,600	1,685.00	63,356,000	
3526	芦森工業	2,200	1,577.00	3,469,400	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
5949	ユニプレス	20,800	1,717.00	35,713,600	

6201	豊田自動織機	87,000	5,590.00	486,330,000	
6455	モリタホールディングス	18,800	1,740.00	32,712,000	貸付有価証券 12,200株(12,200株)
6584	三櫻工業	13,600	511.00	6,949,600	貸付有価証券 10,000株(10,000株)
6902	デンソー	236,700	4,394.00	1,040,059,800	
6995	東海理化電機製作所	28,300	1,872.00	52,977,600	
7003	三井E&Sホールディングス	38,800	1,107.00	42,951,600	
7012	川崎重工業	83,600	2,652.00	221,707,200	
7014	名村造船所	32,300	372.00	12,015,600	貸付有価証券 22,100株(22,100株)
7022	サノヤスホールディングス	14,100	177.00	2,495,700	
7102	日本車輛製造	3,900	2,671.00	10,416,900	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
7105	三菱ロジスネクスト	12,800	1,165.00	14,912,000	貸付有価証券 9,100株(9,100株)
7122	近畿車輛	1,600	1,984.00	3,174,400	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
7201	日産自動車	1,267,700	945.40	1,198,483,580	貸付有価証券 56,600株(56,600株)
7202	いすゞ自動車	339,800	1,463.00	497,127,400	
7203	トヨタ自動車	1,197,900	6,610.00	7,918,119,000	
7205	日野自動車	134,200	941.00	126,282,200	
7211	三菱自動車工業	397,900	590.00	234,761,000	貸付有価証券 260,900株(260,900株)
7212	エフテック	7,500	903.00	6,772,500	
7213	レシップホールディングス	3,800	770.00	2,926,000	
7214	GMB	2,100	862.00	1,810,200	貸付有価証券 400株(400株)
7215	ファルテック	1,900	914.00	1,736,600	
7220	武蔵精密工業	26,100	1,484.00	38,732,400	貸付有価証券 11,800株(11,800株)
7222	日産車体	21,000	951.00	19,971,000	貸付有価証券 16,700株(16,700株)
7224	新明和工業	48,300	1,339.00	64,673,700	
7226	極東開発工業	21,400	1,497.00	32,035,800	貸付有価証券 12,200株(12,200株)
7230	日信工業	19,700	1,430.00	28,171,000	
7231	トピー工業	8,800	2,260.00	19,888,000	
7236	ティラド	3,900	2,270.00	8,853,000	
7238	曙ブレーキ工業	59,000	131.00	7,729,000	
7239	タチエス	18,200	1,569.00	28,555,800	貸付有価証券 5,600株(5,600株)
7240	NOK	57,800	1,732.00	100,109,600	貸付有価証券 26,700株(26,700株)
7241	フタバ産業	29,900	520.00	15,548,000	貸付有価証券 14,600株(14,600株)

7242	K Y B	11,200	2,783.00	31,169,600	
7245	大同メタル工業	17,400	723.00	12,580,200	貸付有価証券 11,000株（11,000株）
7246	プレス工業	53,300	587.00	31,287,100	
7247	ミクニ	13,600	430.00	5,848,000	
7250	太平洋工業	22,500	1,518.00	34,155,000	貸付有価証券 17,400株（17,400株）
7251	ケーヒン	24,700	1,797.00	44,385,900	
7256	河西工業	13,200	867.00	11,444,400	貸付有価証券 3,200株（3,200株）
7259	アイシン精機	88,500	4,045.00	357,982,500	
7261	マツダ	337,400	1,239.50	418,207,300	
7266	今仙電機製作所	10,000	986.00	9,860,000	
7267	本田技研工業	906,800	2,962.50	2,686,395,000	
7269	スズキ	196,700	4,978.00	979,172,600	
7270	S U B A R U	333,700	2,680.00	894,316,000	
7271	安永	5,200	1,352.00	7,030,400	貸付有価証券 2,000株（2,000株）
7272	ヤマハ発動機	151,800	2,115.00	321,057,000	貸付有価証券 83,700株（83,700株）
7274	ショーワ	25,400	1,414.00	35,915,600	
7277	T B K	12,800	419.00	5,363,200	
7278	エクセディ	14,600	2,443.00	35,667,800	
7282	豊田合成	34,700	2,345.00	81,371,500	
7283	愛三工業	16,800	677.00	11,373,600	
7284	盟和産業	1,600	1,081.00	1,729,600	貸付有価証券 500株（500株）
7291	日本プラスト	8,400	770.00	6,468,000	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
7294	ヨロズ	10,000	1,580.00	15,800,000	貸付有価証券 7,300株（7,300株）
7296	エフ・シー・シー	19,300	2,307.00	44,525,100	貸付有価証券 3,900株（3,900株）
7309	シマノ	43,300	16,740.00	724,842,000	貸付有価証券 23,800株（23,800株）
7313	テイ・エス テック	25,000	3,150.00	78,750,000	
7408	ジャムコ	5,400	2,369.00	12,792,600	貸付有価証券 2,100株（2,100株）
4543	テルモ	152,100	6,775.00	1,030,477,500	
5187	クリエートメディック	3,500	936.00	3,276,000	
6376	日機装	34,700	1,264.00	43,860,800	
7701	島津製作所	138,300	2,999.00	414,761,700	
7702	J M S	9,900	669.00	6,623,100	
7709	クボテック	2,300	363.00	834,900	貸付有価証券 1,600株（1,600株）
7715	長野計器	8,400	797.00	6,694,800	貸付有価証券 4,800株（4,800株）

7717	ブイ・テクノロジー	2,500	13,660.00	34,150,000	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
7721	東京計器	6,800	1,114.00	7,575,200	貸付有価証券 400株（400株）
7723	愛知時計電機	1,400	4,060.00	5,684,000	
7725	インターアクション	5,000	1,614.00	8,070,000	貸付有価証券 2,400株（2,400株）
7727	オーバル	10,500	242.00	2,541,000	
7729	東京精密	19,400	2,759.00	53,524,600	
7730	マニー	13,100	5,130.00	67,203,000	
7731	ニコン	187,300	1,534.00	287,318,200	貸付有価証券 102,800株（102,800株）
7732	トプコン	57,700	1,344.00	77,548,800	
7733	オリンパス	160,100	4,720.00	755,672,000	
7734	理研計器	9,500	2,123.00	20,168,500	
7740	タムロン	9,500	2,004.00	19,038,000	
7741	HOYA	216,400	7,296.00	1,578,854,400	
7743	シード	4,600	1,198.00	5,510,800	貸付有価証券 2,100株（2,100株）
7744	ノーリツ鋼機	8,500	2,376.00	20,196,000	貸付有価証券 5,800株（5,800株）
7745	エー・アンド・デイ	9,800	748.00	7,330,400	
7747	朝日インテック	45,600	5,020.00	228,912,000	貸付有価証券 13,400株（13,400株）
7762	シチズン時計	117,600	610.00	71,736,000	貸付有価証券 67,800株（67,800株）
7769	リズム時計工業	3,600	1,377.00	4,957,200	
7775	大研医器	8,500	556.00	4,726,000	
7780	メニコン	14,700	3,145.00	46,231,500	
7782	シンシア	1,600	622.00	995,200	
7979	松風	5,200	1,295.00	6,734,000	
8050	セイコーホールディングス	16,600	2,638.00	43,790,800	貸付有価証券 10,200株（10,200株）
8086	ニプロ	74,400	1,425.00	106,020,000	
7811	中本パックス	3,000	1,482.00	4,446,000	
7816	スノーピーク	4,100	1,407.00	5,768,700	
7817	パラマウントベッドホールディングス	12,400	4,810.00	59,644,000	
7818	トランザクション	5,800	714.00	4,141,200	
7819	SHO - B I	3,100	341.00	1,057,100	貸付有価証券 100株（100株）
7820	ニホンフラッシュ	4,600	1,856.00	8,537,600	貸付有価証券 1,400株（1,400株）
7821	前田工織	11,800	2,551.00	30,101,800	貸付有価証券 2,000株（2,000株）
7822	永大産業	14,100	410.00	5,781,000	
7823	アートネイチャー	11,500	636.00	7,314,000	

7832	バンダイナムコホールディングス	111,100	5,140.00	571,054,000	
7833	アイフィスジャパン	2,400	583.00	1,399,200	貸付有価証券 800株(800株)
7838	共立印刷	17,900	216.00	3,866,400	
7839	SHOEI	5,200	4,605.00	23,946,000	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
7840	フランスベッドホールディングス	15,200	910.00	13,832,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
7846	パイロットコーポレーション	18,700	4,320.00	80,784,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
7856	萩原工業	6,000	1,401.00	8,406,000	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
7862	トッパン・フォームズ	23,000	930.00	21,390,000	
7864	フジシールインターナショナル	24,100	3,855.00	92,905,500	
7867	タカラトミー	45,000	1,200.00	54,000,000	
7868	廣済堂	9,100	821.00	7,471,100	貸付有価証券 6,300株(6,300株)
7872	エステールホールディングス	2,900	687.00	1,992,300	
7873	アーク	41,000	98.00	4,018,000	貸付有価証券 5,200株(5,200株)
7885	タカノ	4,200	845.00	3,549,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
7893	プロネクサス	9,200	1,201.00	11,049,200	
7897	ホクシン	6,600	134.00	884,400	
7898	ウッドワン	3,600	1,044.00	3,758,400	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
7905	大建工業	8,100	2,201.00	17,828,100	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
7911	凸版印刷	151,700	1,644.00	249,394,800	
7912	大日本印刷	151,500	2,448.00	370,872,000	
7913	図書印刷	10,100	980.00	9,898,000	
7914	共同印刷	3,300	2,333.00	7,698,900	
7915	NISSHA	22,100	1,140.00	25,194,000	
7916	光村印刷	900	2,359.00	2,123,100	貸付有価証券 100株(100株)
7921	宝印刷	5,200	1,623.00	8,439,600	
7936	アシックス	106,700	1,396.00	148,953,200	貸付有価証券 54,700株(54,700株)
7937	ツツミ	3,400	2,112.00	7,180,800	
7949	小松ウオール工業	3,300	1,885.00	6,220,500	
7951	ヤマハ	63,900	5,470.00	349,533,000	
7952	河合楽器製作所	3,300	3,240.00	10,692,000	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
7955	クリナップ	10,000	572.00	5,720,000	
7956	ビジョン	65,000	4,545.00	295,425,000	貸付有価証券 27,000株(27,000株)
7961	兼松サステック	700	1,595.00	1,116,500	
7962	キングジム	8,900	839.00	7,467,100	

7966	リンテック	25,600	2,374.00	60,774,400	
7972	イトーキ	19,800	508.00	10,058,400	
7974	任天堂	66,200	30,450.00	2,015,790,000	
7976	三菱鉛筆	17,700	2,109.00	37,329,300	貸付有価証券 11,100株(11,100株)
7981	タカラスタンダード	22,200	1,669.00	37,051,800	
7984	コクヨ	51,600	1,582.00	81,631,200	
7987	ナカバヤシ	10,600	539.00	5,713,400	貸付有価証券 4,700株(4,700株)
7990	グローブライド	5,200	2,677.00	13,920,400	
7994	オカムラ	37,500	1,126.00	42,225,000	
8022	美津濃	10,600	2,601.00	27,570,600	
9501	東京電力ホールディングス	858,100	703.00	603,244,300	貸付有価証券 467,000株(467,000株)
9502	中部電力	328,900	1,761.00	579,192,900	
9503	関西電力	438,600	1,710.00	750,006,000	
9504	中国電力	148,600	1,454.00	216,064,400	貸付有価証券 76,100株(76,100株)
9505	北陸電力	105,300	888.00	93,506,400	貸付有価証券 53,900株(53,900株)
9506	東北電力	251,700	1,454.00	365,971,800	
9507	四国電力	96,800	1,371.00	132,712,800	貸付有価証券 42,100株(42,100株)
9508	九州電力	221,500	1,322.00	292,823,000	貸付有価証券 90,100株(90,100株)
9509	北海道電力	100,600	649.00	65,289,400	
9511	沖縄電力	19,900	1,983.00	39,461,700	
9513	電源開発	85,500	2,743.00	234,526,500	
9514	エフオン	5,100	732.00	3,733,200	
9517	イーレックス	18,700	1,051.00	19,653,700	
9519	レノバ	13,200	928.00	12,249,600	
9531	東京瓦斯	210,900	3,072.00	647,884,800	
9532	大阪瓦斯	208,600	2,295.00	478,737,000	
9533	東邦瓦斯	53,200	5,000.00	266,000,000	貸付有価証券 28,000株(28,000株)
9534	北海道瓦斯	5,800	1,441.00	8,357,800	
9535	広島ガス	22,100	350.00	7,735,000	
9536	西部瓦斯	12,100	2,412.00	29,185,200	
9543	静岡ガス	33,100	883.00	29,227,300	
9551	メタウォーター	5,200	3,050.00	15,860,000	
2384	SBSホールディングス	10,600	1,719.00	18,221,400	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
9001	東武鉄道	113,400	3,165.00	358,911,000	
9003	相鉄ホールディングス	36,800	3,320.00	122,176,000	
9005	東京急行電鉄	292,000	1,905.00	556,260,000	

9006	京浜急行電鉄	147,200	1,814.00	267,020,800	
9007	小田急電鉄	172,200	2,604.00	448,408,800	
9008	京王電鉄	60,100	6,930.00	416,493,000	貸付有価証券 28,700株(28,700株)
9009	京成電鉄	80,600	3,885.00	313,131,000	
9010	富士急行	14,700	4,100.00	60,270,000	貸付有価証券 10,500株(10,500株)
9014	新京成電鉄	2,800	2,127.00	5,955,600	
9020	東日本旅客鉄道	191,100	10,530.00	2,012,283,000	
9021	西日本旅客鉄道	96,400	8,248.00	795,107,200	
9022	東海旅客鉄道	96,200	24,580.00	2,364,596,000	
9024	西武ホールディングス	137,000	1,842.00	252,354,000	
9025	鴻池運輸	17,100	1,787.00	30,557,700	
9031	西日本鉄道	29,800	2,670.00	79,566,000	貸付有価証券 20,400株(20,400株)
9037	ハマキョウレックス	8,200	4,225.00	34,645,000	
9039	サカイ引越センター	5,600	6,930.00	38,808,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
9041	近鉄グループホールディングス	101,800	5,080.00	517,144,000	貸付有価証券 16,700株(16,700株)
9042	阪急阪神ホールディングス	135,800	4,050.00	549,990,000	
9044	南海電気鉄道	45,400	3,040.00	138,016,000	
9045	京阪ホールディングス	45,300	4,460.00	202,038,000	貸付有価証券 23,200株(23,200株)
9046	神戸電鉄	2,600	3,995.00	10,387,000	
9048	名古屋鉄道	81,500	3,000.00	244,500,000	
9052	山陽電気鉄道	7,800	2,248.00	17,534,400	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
9062	日本通運	40,000	6,100.00	244,000,000	
9064	ヤマトホールディングス	178,500	2,869.50	512,205,750	
9065	山九	28,300	5,290.00	149,707,000	貸付有価証券 500株(500株)
9067	丸運	5,800	287.00	1,664,600	
9068	丸全昭和運輸	8,200	2,946.00	24,157,200	
9069	センコーグループホールディングス	56,100	916.00	51,387,600	貸付有価証券 35,000株(35,000株)
9070	トナミホールディングス	2,400	6,090.00	14,616,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
9072	ニッコンホールディングス	38,700	2,621.00	101,432,700	
9074	日本石油輸送	1,200	2,892.00	3,470,400	
9075	福山通運	13,000	4,150.00	53,950,000	貸付有価証券 6,600株(6,600株)
9076	セイノーホールディングス	76,200	1,509.00	114,985,800	
9078	エスライン	3,100	1,083.00	3,357,300	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
9081	神奈川中央交通	2,500	3,920.00	9,800,000	
9086	日立物流	22,400	3,255.00	72,912,000	

9090	丸和運輸機関	5,400	3,810.00	20,574,000	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
9099	C & F ロジホールディングス	10,300	1,278.00	13,163,400	貸付有価証券 800株(800株)
9142	九州旅客鉄道	85,400	3,645.00	311,283,000	貸付有価証券 10,200株(10,200株)
9143	S G ホールディングス	96,200	3,170.00	304,954,000	
9101	日本郵船	85,100	1,618.00	137,691,800	貸付有価証券 46,500株(46,500株)
9104	商船三井	60,400	2,382.00	143,872,800	
9107	川崎汽船	31,400	1,179.00	37,020,600	貸付有価証券 25,700株(25,700株)
9110	N S ユナイテッド海運	5,600	2,490.00	13,944,000	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
9115	明治海運	10,800	339.00	3,661,200	貸付有価証券 3,900株(3,900株)
9119	飯野海運	48,200	386.00	18,605,200	貸付有価証券 33,200株(33,200株)
9130	共栄タンカー	900	1,484.00	1,335,600	
9308	乾汽船	9,100	816.00	7,425,600	
9201	日本航空	186,400	3,828.00	713,539,200	
9202	A N A ホールディングス	186,100	3,970.00	738,817,000	貸付有価証券 26,300株(26,300株)
9232	パスコ	2,000	839.00	1,678,000	
9058	トランコム	2,800	6,520.00	18,256,000	貸付有価証券 200株(200株)
9066	日新	8,800	1,822.00	16,033,600	
9301	三菱倉庫	35,200	2,973.00	104,649,600	貸付有価証券 18,000株(18,000株)
9302	三井倉庫ホールディングス	12,500	1,783.00	22,287,500	
9303	住友倉庫	38,300	1,394.00	53,390,200	貸付有価証券 18,500株(18,500株)
9304	澁澤倉庫	5,600	1,694.00	9,486,400	
9306	東陽倉庫	18,400	312.00	5,740,800	貸付有価証券 5,300株(5,300株)
9310	日本トランスシティ	22,400	475.00	10,640,000	
9312	ケイヒン	2,000	1,404.00	2,808,000	
9319	中央倉庫	6,200	1,024.00	6,348,800	
9322	川西倉庫	2,100	1,308.00	2,746,800	
9324	安田倉庫	8,400	915.00	7,686,000	
9325	ファイズ	1,400	779.00	1,090,600	
9351	東洋埠頭	3,100	1,493.00	4,628,300	
9358	宇徳	8,700	552.00	4,802,400	
9364	上組	62,800	2,520.00	158,256,000	
9366	サンリツ	2,400	706.00	1,694,400	
9368	キムラユニティー	2,700	1,107.00	2,988,900	
9369	キューソー流通システム	2,500	2,020.00	5,050,000	

9375	近鉄エクスプレス	19,200	1,740.00	33,408,000	
9380	東海運	5,800	280.00	1,624,000	
9381	エーアイテイー	6,600	1,105.00	7,293,000	
9384	内外トランスライン	3,200	1,319.00	4,220,800	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
9386	日本コンセプト	2,800	926.00	2,592,800	
1973	NEC ネットズエスアイ	11,600	2,610.00	30,276,000	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
2307	クロスキャット	2,100	1,019.00	2,139,900	
2317	システナ	37,600	1,120.00	42,112,000	貸付有価証券 24,000株(24,000株)
2326	デジタルアーツ	5,700	8,760.00	49,932,000	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
2327	新日鉄住金ソリューションズ	15,800	2,906.00	45,914,800	
2335	キューブシステム	5,600	783.00	4,384,800	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
2352	エイジア	2,100	1,369.00	2,874,900	
2359	コア	4,500	1,166.00	5,247,000	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
3040	ソリトンシステムズ	5,900	1,076.00	6,348,400	
3371	ソフトクリエイトホールディングス	4,600	1,481.00	6,812,600	
3626	T I S	35,200	4,995.00	175,824,000	
3627	ネオス	3,800	1,014.00	3,853,200	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
3630	電算システム	4,000	3,310.00	13,240,000	
3632	グリー	72,800	457.00	33,269,600	
3635	コーエーテクモホールディングス	21,600	2,071.00	44,733,600	
3636	三菱総合研究所	4,100	3,350.00	13,735,000	
3639	ボルテージ	1,900	528.00	1,003,200	
3640	電算	1,200	2,115.00	2,538,000	
3648	A G S	6,000	722.00	4,332,000	
3649	ファインデックス	8,900	740.00	6,586,000	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
3655	ブレインパッド	2,000	6,040.00	12,080,000	貸付有価証券 600株(600株)
3656	K L a b	18,900	846.00	15,989,400	貸付有価証券 7,500株(7,500株)
3657	ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	14,000	1,069.00	14,966,000	貸付有価証券 9,600株(9,600株)
3658	イーブックイニシアティブジャパン	1,700	1,562.00	2,655,400	
3659	ネクソン	268,700	1,670.00	448,729,000	貸付有価証券 90,200株(90,200株)
3660	アイスタイル	27,000	822.00	22,194,000	貸付有価証券 4,400株(4,400株)
3661	エムアップ	3,600	2,781.00	10,011,600	貸付有価証券 2,900株(2,900株)
3662	エイチーム	6,600	1,754.00	11,576,400	

3666	テクノスジャパン	8,900	711.00	6,327,900	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
3667	e n i s h	3,700	412.00	1,524,400	貸付有価証券 2,900株(2,900株)
3668	コロブラ	30,200	682.00	20,596,400	貸付有価証券 10,400株(10,400株)
3672	オルトプラス	6,500	291.00	1,891,500	
3673	ブロードリーフ	52,300	572.00	29,915,600	
3675	クロス・マーケティンググループ	2,900	395.00	1,145,500	
3676	デジタルハーツホールディングス	4,800	1,246.00	5,980,800	
3677	システム情報	2,100	1,736.00	3,645,600	
3678	メディアドゥホールディングス	3,200	2,808.00	8,985,600	
3679	じげん	11,200	559.00	6,260,800	
3681	バイキューブ	5,600	458.00	2,564,800	
3682	エンカレッジ・テクノロジー	1,000	1,068.00	1,068,000	
3683	サイバーリンクス	1,600	1,031.00	1,649,600	
3686	ディー・エル・イー	7,400	181.00	1,339,400	
3687	フィックスターズ	10,100	1,314.00	13,271,400	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
3688	C A R T A H O L D I N G S	5,600	996.00	5,577,600	
3694	オブティム	2,300	5,200.00	11,960,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
3696	セレス	3,400	2,036.00	6,922,400	
3724	ベリサーブ	900	6,670.00	6,003,000	
3738	ティーガイア	10,600	1,878.00	19,906,800	
3741	セック	1,700	3,215.00	5,465,500	
3751	日本アジアグループ	11,100	340.00	3,774,000	貸付有価証券 4,100株(4,100株)
3756	豆蔵ホールディングス	7,200	988.00	7,113,600	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
3762	テクマトリックス	7,400	1,790.00	13,246,000	
3763	プロシップ	3,000	1,256.00	3,768,000	
3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	254,200	400.00	101,680,000	貸付有価証券 191,500株(191,500株)
3769	G M O ペイメントゲートウェイ	17,400	7,430.00	129,282,000	貸付有価証券 13,600株(13,600株)
3770	ザッパラス	5,500	414.00	2,277,000	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
3771	システムリサーチ	1,400	2,875.00	4,025,000	貸付有価証券 600株(600株)
3774	インターネットイニシアティブ	17,200	2,251.00	38,717,200	
3778	さくらインターネット	12,600	526.00	6,627,600	貸付有価証券 6,400株(6,400株)
3784	ヴィンクス	3,500	942.00	3,297,000	
3788	G M O クラウド	2,300	3,565.00	8,199,500	
3817	S R A ホールディングス	5,600	2,496.00	13,977,600	

3822	Minorisソリューションズ	2,100	1,579.00	3,315,900	
3826	システムインテグレータ	3,000	778.00	2,334,000	
3834	朝日ネット	8,500	522.00	4,437,000	
3835	eBASE	3,100	2,406.00	7,458,600	
3836	アバント	3,800	1,467.00	5,574,600	
3837	アドソル日進	3,700	1,589.00	5,879,300	
3843	フリービット	6,300	933.00	5,877,900	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
3844	コムチュア	5,900	3,280.00	19,352,000	
3852	サイバーコム	1,900	2,015.00	3,828,500	
3853	アステリア	5,300	949.00	5,029,700	
3901	マークライنز	3,600	1,334.00	4,802,400	
3902	メディカル・データ・ビジョン	9,400	1,090.00	10,246,000	貸付有価証券 4,700株(4,700株)
3903	gumi	13,500	699.00	9,436,500	
3909	ショーケース・ティービー	2,300	704.00	1,619,200	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
3912	モバイルファクトリー	2,900	1,391.00	4,033,900	
3915	テラスカイ	600	3,520.00	2,112,000	
3916	デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,700	1,415.00	6,650,500	
3918	PCIホールディングス	1,800	2,448.00	4,406,400	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
3919	パイプドHD	1,600	859.00	1,374,400	貸付有価証券 600株(600株)
3920	アイビーシー	1,700	1,497.00	2,544,900	貸付有価証券 600株(600株)
3921	ネオジャパン	2,000	887.00	1,774,000	
3922	PR TIMES	700	2,010.00	1,407,000	貸付有価証券 200株(200株)
3924	ランドコンピュータ	1,200	1,192.00	1,430,400	
3925	ダブルスタンダード	700	5,160.00	3,612,000	
3926	オーブンドア	5,200	3,285.00	17,082,000	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
3928	マイネット	3,400	999.00	3,396,600	
3932	アカツキ	3,700	5,840.00	21,608,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
3934	ベネフィットジャパン	600	882.00	529,200	貸付有価証券 200株(200株)
3937	Ubicomホールディングス	1,900	1,328.00	2,523,200	
3938	LINE	32,100	3,775.00	121,177,500	貸付有価証券 10,000株(10,000株)
3939	カナミックネットワーク	1,600	1,902.00	3,043,200	貸付有価証券 500株(500株)
3940	ノムラシステムコーポレーション	900	702.00	631,800	
3962	チェンジ	1,400	3,680.00	5,152,000	貸付有価証券 400株(400株)

3963	シンクロ・フード	4,500	560.00	2,520,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
3964	オークネット	5,500	1,237.00	6,803,500	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
3969	エイトレッド	800	1,192.00	953,600	
3975	A O I T Y O H o l d i n g s	11,500	763.00	8,774,500	
3978	マクロミル	18,700	1,369.00	25,600,300	
3981	ビーグリー	2,000	931.00	1,862,000	
3983	オロ	1,000	5,640.00	5,640,000	
4284	ソルクシーズ	4,500	765.00	3,442,500	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
4295	フェイス	4,200	823.00	3,456,600	貸付有価証券 500株(500株)
4298	プロトコーポレーション	3,300	1,866.00	6,157,800	
4299	ハイマックス	1,300	1,826.00	2,373,800	
4307	野村総合研究所	67,100	4,890.00	328,119,000	
4312	サイバネットシステム	8,700	550.00	4,785,000	
4320	C E ホールディングス	2,800	748.00	2,094,400	
4323	日本システム技術	1,700	1,394.00	2,369,800	貸付有価証券 700株(700株)
4326	インテージホールディングス	13,500	847.00	11,434,500	
4333	東邦システムサイエンス	3,100	917.00	2,842,700	
4344	ソースネクスト	40,900	445.00	18,200,500	貸付有価証券 15,600株(15,600株)
4348	インフォコム	8,700	1,795.00	15,616,500	
4392	F I G	9,300	310.00	2,883,000	貸付有価証券 200株(200株)
4423	アルテリア・ネットワークス	8,800	1,234.00	10,859,200	
4433	ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	2,400	1,585.00	3,804,000	
4662	フォーカスシステムズ	7,100	935.00	6,638,500	
4674	クレスコ	3,200	3,305.00	10,576,000	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
4676	フジ・メディア・ホールディングス	109,400	1,506.00	164,756,400	
4684	オービック	36,600	10,840.00	396,744,000	
4686	ジャストシステム	15,000	2,757.00	41,355,000	
4687	T D C ソフト	9,200	852.00	7,838,400	貸付有価証券 4,700株(4,700株)
4689	ヤフー	687,700	270.00	185,679,000	
4704	トレンドマイクロ	56,200	5,050.00	283,810,000	
4709	インフォメーション・ディベロプメント	3,000	1,415.00	4,245,000	貸付有価証券 100株(100株)
4716	日本オラクル	21,400	7,570.00	161,998,000	貸付有価証券 10,900株(10,900株)
4719	アルファシステムズ	3,300	2,720.00	8,976,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
4722	フューチャー	14,300	1,739.00	24,867,700	

4725	CAC Holdings	7,500	1,363.00	10,222,500	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
4726	ソフトバンク・テクノロジー	4,500	2,436.00	10,962,000	
4728	トーセ	2,800	881.00	2,466,800	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
4733	オービックビジネスコンサルタント	10,800	4,215.00	45,522,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	48,100	2,535.00	121,933,500	
4743	アイティフォー	12,800	917.00	11,737,600	貸付有価証券 10,100株(10,100株)
4746	東計電算	1,600	3,000.00	4,800,000	
4762	エクスネット	1,900	900.00	1,710,000	
4768	大塚商会	57,100	3,870.00	220,977,000	
4776	サイボウズ	12,300	798.00	9,815,400	
4779	ソフトブレーン	8,300	455.00	3,776,500	
4812	電通国際情報サービス	6,500	3,675.00	23,887,500	
4819	デジタルガレージ	20,500	3,035.00	62,217,500	貸付有価証券 9,400株(9,400株)
4820	EMシステムズ	8,600	1,312.00	11,283,200	
4825	ウェザーニューズ	3,600	3,095.00	11,142,000	
4826	C I J	8,200	806.00	6,609,200	
4828	東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	2,255.00	2,480,500	
4829	日本エンタープライズ	10,800	170.00	1,836,000	貸付有価証券 3,700株(3,700株)
4839	WOWOW	5,100	2,969.00	15,141,900	
4845	スカラ	7,400	784.00	5,801,600	
6879	IMAGICA GROUP	8,900	578.00	5,144,200	貸付有価証券 3,100株(3,100株)
7518	ネットワンシステムズ	37,300	2,623.00	97,837,900	貸付有価証券 15,400株(15,400株)
7527	システムソフト	25,000	99.00	2,475,000	貸付有価証券 10,900株(10,900株)
7595	アルゴグラフィックス	4,500	4,450.00	20,025,000	
7844	マーベラス	16,100	877.00	14,119,700	
7860	エイベックス	18,100	1,424.00	25,774,400	
8056	日本ユニシス	32,900	2,796.00	91,988,400	
8096	兼松エレクトロニクス	5,700	3,265.00	18,610,500	
9401	東京放送ホールディングス	70,000	2,029.00	142,030,000	貸付有価証券 46,800株(46,800株)
9404	日本テレビホールディングス	96,800	1,661.00	160,784,800	貸付有価証券 71,200株(71,200株)
9405	朝日放送グループホールディングス	10,500	798.00	8,379,000	
9409	テレビ朝日ホールディングス	29,000	1,954.00	56,666,000	
9412	スカパーJSATホールディングス	80,500	473.00	38,076,500	
9413	テレビ東京ホールディングス	8,600	2,354.00	20,244,400	貸付有価証券 6,700株(6,700株)
9414	日本BS放送	3,600	1,042.00	3,751,200	

9416	ビジョン	3,300	4,800.00	15,840,000	
9417	スマートバリュー	2,300	809.00	1,860,700	
9418	USEN-NEXT HOLDINGS	4,000	881.00	3,524,000	
9419	ワイヤレスゲート	4,600	416.00	1,913,600	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
9422	コネクシオ	7,500	1,407.00	10,552,500	
9424	日本通信	91,000	113.00	10,283,000	貸付有価証券 41,400株(41,400株)
9428	クロップス	1,900	694.00	1,318,600	
9432	日本電信電話	721,400	4,760.00	3,433,864,000	
9433	KDDI	929,500	2,446.50	2,274,021,750	
9434	ソフトバンク	838,700	1,290.50	1,082,342,350	
9435	光通信	12,400	20,510.00	254,324,000	
9437	NTTドコモ	757,400	2,433.50	1,843,132,900	
9438	エムティーアイ	12,200	624.00	7,612,800	貸付有価証券 6,200株(6,200株)
9449	GMOインターネット	38,400	1,788.00	68,659,200	
9466	アйдママーケティングコミュニケーション	2,300	498.00	1,145,400	
9468	カドカワ	30,800	1,183.00	36,436,400	貸付有価証券 18,600株(18,600株)
9470	学研ホールディングス	3,500	5,380.00	18,830,000	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
9474	ゼンリン	21,000	2,515.00	52,815,000	
9475	昭文社	4,900	420.00	2,058,000	
9479	インプレスホールディングス	8,700	142.00	1,235,400	貸付有価証券 6,400株(6,400株)
9600	アイネット	6,000	1,286.00	7,716,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
9601	松竹	7,000	11,770.00	82,390,000	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
9602	東宝	69,400	4,235.00	293,909,000	
9605	東映	4,400	14,950.00	65,780,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	280,800	1,175.00	329,940,000	
9629	ピー・シー・エー	1,300	3,010.00	3,913,000	
9658	ビジネスブレイン太田昭和	1,800	1,836.00	3,304,800	
9682	DTS	11,800	4,050.00	47,790,000	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	49,100	3,790.00	186,089,000	
9692	シーイーシー	11,300	2,023.00	22,859,900	
9697	カプコン	45,200	2,459.00	111,146,800	
9702	アイ・エス・ピー	2,000	1,889.00	3,778,000	貸付有価証券 600株(600株)
9717	ジャステック	6,100	945.00	5,764,500	
9719	SCSK	27,800	4,810.00	133,718,000	
9739	日本システムウエア	3,500	2,257.00	7,899,500	

9742	アイネス	13,400	1,279.00	17,138,600	
9746	T K C	8,900	4,015.00	35,733,500	
9749	富士ソフト	15,700	4,130.00	64,841,000	
9759	N S D	17,300	2,524.00	43,665,200	
9766	コナミホールディングス	43,100	4,850.00	209,035,000	
9790	福井コンピュータホールディングス	3,500	1,932.00	6,762,000	
9889	J B C Cホールディングス	8,300	1,385.00	11,495,500	貸付有価証券 6,500株(6,500株)
9928	ミロク情報サービス	10,500	2,793.00	29,326,500	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
9984	ソフトバンクグループ	440,800	10,705.00	4,718,764,000	
1352	ハウスイ	800	844.00	675,200	
2676	高千穂交易	4,100	995.00	4,079,500	
2692	伊藤忠食品	2,600	4,950.00	12,870,000	
2715	エレマテック	4,900	1,696.00	8,310,400	
2729	J A L U X	3,000	2,595.00	7,785,000	
2733	あらた	5,900	3,805.00	22,449,500	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
2737	トーメンデバイス	1,600	2,495.00	3,992,000	貸付有価証券 800株(800株)
2760	東京エレクトロン デバイス	3,800	1,806.00	6,862,800	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
2767	フィールズ	9,300	702.00	6,528,600	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
2768	双日	584,700	398.00	232,710,600	
2784	アルフレッサ ホールディングス	117,600	3,090.00	363,384,000	
2874	横浜冷凍	27,700	883.00	24,459,100	貸付有価証券 19,300株(19,300株)
3004	神栄	1,500	767.00	1,150,500	貸付有価証券 700株(700株)
3023	ラサ商事	5,600	859.00	4,810,400	
3031	ラクーンホールディングス	5,000	672.00	3,360,000	
3036	アルコニックス	11,200	1,266.00	14,179,200	貸付有価証券 8,400株(8,400株)
3038	神戸物産	16,000	3,895.00	62,320,000	
3076	あい ホールディングス	15,100	1,803.00	27,225,300	
3079	ディーブイエックス	4,100	998.00	4,091,800	
3107	ダイワボウホールディングス	9,600	6,250.00	60,000,000	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
3132	マクニカ・富士エレホールディングス	29,300	1,481.00	43,393,300	貸付有価証券 12,300株(12,300株)
3139	ラクト・ジャパン	2,300	8,570.00	19,711,000	貸付有価証券 800株(800株)
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	19,900	1,074.00	21,372,600	貸付有価証券 13,500株(13,500株)
3153	八洲電機	8,200	827.00	6,781,400	
3154	メディアスホールディングス	6,000	629.00	3,774,000	

3156	UKCホールディングス	6,800	1,941.00	13,198,800	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
3157	ジューテックホールディングス	2,400	1,080.00	2,592,000	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
3160	大光	3,400	652.00	2,216,800	
3166	OCHIホールディングス	3,100	1,306.00	4,048,600	
3167	TOKAIホールディングス	55,900	859.00	48,018,100	
3168	黒谷	1,800	444.00	799,200	
3173	Cominix	1,800	876.00	1,576,800	貸付有価証券 100株(100株)
3176	三洋貿易	5,300	1,832.00	9,709,600	
3180	ビューティガレージ	1,700	1,334.00	2,267,800	貸付有価証券 500株(500株)
3183	ウイン・パートナーズ	6,900	1,199.00	8,273,100	
3321	ミタチ産業	3,200	729.00	2,332,800	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
3360	シップヘルスケアホールディングス	22,100	4,420.00	97,682,000	
3388	明治電機工業	3,300	1,677.00	5,534,100	
3392	デリカフーズホールディングス	1,900	1,313.00	2,494,700	
3393	スターティアホールディングス	2,100	556.00	1,167,600	
3543	コメダホールディングス	24,500	2,083.00	51,033,500	
5009	富士興産	4,100	689.00	2,824,900	
6973	協栄産業	1,300	1,521.00	1,977,300	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
7414	小野建	9,500	1,604.00	15,238,000	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
7417	南陽	2,200	2,099.00	4,617,800	
7420	佐鳥電機	7,800	921.00	7,183,800	貸付有価証券 6,100株(6,100株)
7427	エコトレーディング	2,400	550.00	1,320,000	
7433	伯東	7,200	1,208.00	8,697,600	
7438	コンドーテック	8,200	997.00	8,175,400	
7442	中山福	6,100	565.00	3,446,500	
7447	ナガイレーベン	15,300	2,349.00	35,939,700	貸付有価証券 10,000株(10,000株)
7451	三菱食品	11,600	2,842.00	32,967,200	貸付有価証券 8,500株(8,500株)
7456	松田産業	7,700	1,405.00	10,818,500	
7458	第一興商	15,800	5,430.00	85,794,000	
7459	メディパルホールディングス	114,200	2,566.00	293,037,200	
7466	SPK	2,300	2,361.00	5,430,300	貸付有価証券 300株(300株)
7467	萩原電気ホールディングス	3,900	3,095.00	12,070,500	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
7476	アズワン	7,600	8,670.00	65,892,000	
7480	スズデン	3,700	1,841.00	6,811,700	貸付有価証券 2,400株(2,400株)

7481	尾家産業	3,400	1,283.00	4,362,200	
7482	シモジマ	6,500	1,200.00	7,800,000	
7483	ドウシヤ	10,000	1,730.00	17,300,000	貸付有価証券 1,500株（1,500株）
7487	小津産業	2,300	1,893.00	4,353,900	
7504	高速	6,300	1,218.00	7,673,400	貸付有価証券 1,600株（1,600株）
7510	たけびし	3,700	1,460.00	5,402,000	
7525	リックス	2,400	1,587.00	3,808,800	貸付有価証券 400株（400株）
7537	丸文	9,400	664.00	6,241,600	
7552	ハピネット	8,800	1,520.00	13,376,000	
7570	橋本総業ホールディングス	1,900	1,590.00	3,021,000	
7575	日本ライフライン	33,200	1,788.00	59,361,600	貸付有価証券 5,000株（5,000株）
7590	タカショー	5,100	431.00	2,198,100	
7591	エクセル	3,900	2,510.00	9,789,000	
7594	マルカキカイ	3,400	2,080.00	7,072,000	
7599	I D O M	35,700	317.00	11,316,900	
7600	日本エム・ディ・エム	6,200	1,070.00	6,634,000	
7607	進和	6,300	2,122.00	13,368,600	
7608	エスケイジャパン	2,600	767.00	1,994,200	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
7609	ダイトロン	4,800	1,616.00	7,756,800	
7613	シークス	13,500	1,596.00	21,546,000	貸付有価証券 4,900株（4,900株）
7619	田中商事	3,500	600.00	2,100,000	
7628	オーハシテクニカ	6,000	1,471.00	8,826,000	
7637	白銅	3,400	1,685.00	5,729,000	貸付有価証券 2,000株（2,000株）
8001	伊藤忠商事	740,500	2,023.50	1,498,401,750	
8002	丸紅	1,044,000	785.40	819,957,600	
8007	高島	1,700	1,845.00	3,136,500	
8012	長瀬産業	59,500	1,591.00	94,664,500	貸付有価証券 30,800株（30,800株）
8014	蝶理	6,800	1,569.00	10,669,200	
8015	豊田通商	118,200	3,630.00	429,066,000	
8018	三共生興	18,000	479.00	8,622,000	
8020	兼松	42,300	1,300.00	54,990,000	
8025	ツカモトコーポレーション	1,900	1,274.00	2,420,600	貸付有価証券 600株（600株）
8031	三井物産	872,200	1,763.00	1,537,688,600	
8032	日本紙パルプ商事	6,000	4,315.00	25,890,000	
8036	日立ハイテクノロジーズ	32,200	4,530.00	145,866,000	
8037	カメイ	13,800	1,148.00	15,842,400	

8038	東都水産	1,500	2,516.00	3,774,000	貸付有価証券 800株(800株)
8041	OUGホールディングス	1,700	2,599.00	4,418,300	
8043	スターゼン	3,900	3,925.00	15,307,500	
8051	山善	41,300	1,160.00	47,908,000	
8052	椿本興業	2,400	3,970.00	9,528,000	
8053	住友商事	626,100	1,571.00	983,603,100	
8057	内田洋行	4,900	3,190.00	15,631,000	
8058	三菱商事	742,900	3,182.00	2,363,907,800	
8059	第一実業	4,800	3,245.00	15,576,000	
8060	キャノンマーケティングジャパン	30,300	2,160.00	65,448,000	貸付有価証券 15,500株(15,500株)
8061	西華産業	6,000	1,443.00	8,658,000	貸付有価証券 4,100株(4,100株)
8065	佐藤商事	9,500	906.00	8,607,000	
8068	菱洋エレクトロ	10,700	1,620.00	17,334,000	
8070	東京産業	10,500	512.00	5,376,000	貸付有価証券 3,300株(3,300株)
8074	ユアサ商事	10,800	3,220.00	34,776,000	
8075	神鋼商事	2,400	2,640.00	6,336,000	
8077	小林産業	6,300	342.00	2,154,600	
8078	阪和興業	18,400	3,240.00	59,616,000	
8079	正栄食品工業	5,600	3,020.00	16,912,000	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
8081	カナデン	10,100	1,195.00	12,069,500	
8084	菱電商事	8,400	1,485.00	12,474,000	
8087	フルサト工業	5,800	1,666.00	9,662,800	
8088	岩谷産業	23,500	3,640.00	85,540,000	貸付有価証券 6,200株(6,200株)
8089	すてきナイスグループ	4,500	886.00	3,987,000	
8090	昭光通商	3,800	608.00	2,310,400	
8091	ニチモウ	1,600	1,700.00	2,720,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
8093	極東貿易	3,300	1,619.00	5,342,700	
8095	イワキ	12,700	393.00	4,991,100	
8097	三愛石油	28,400	926.00	26,298,400	
8098	稲畑産業	25,400	1,509.00	38,328,600	
8101	G S Iクレオス	2,800	1,168.00	3,270,400	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
8103	明和産業	9,800	443.00	4,341,400	
8104	クワザワ	2,900	455.00	1,319,500	
8125	ワキタ	22,600	1,094.00	24,724,400	
8129	東邦ホールディングス	31,300	2,719.00	85,104,700	
8130	サンゲツ	32,000	2,006.00	64,192,000	貸付有価証券 16,300株(16,300株)
8131	ミツウロコグループホールディングス	15,300	838.00	12,821,400	

8132	シナネンホールディングス	4,400	2,149.00	9,455,600	
8133	伊藤忠エネクス	23,400	914.00	21,387,600	
8136	サンリオ	32,700	2,495.00	81,586,500	貸付有価証券 13,700株(13,700株)
8137	サンワテクノス	6,400	892.00	5,708,800	
8140	リョーサン	11,700	3,000.00	35,100,000	貸付有価証券 8,100株(8,100株)
8141	新光商事	10,000	1,851.00	18,510,000	貸付有価証券 6,800株(6,800株)
8142	トーヨー	4,800	2,172.00	10,425,600	
8150	三信電気	8,800	1,808.00	15,910,400	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
8151	東陽テクニカ	12,200	870.00	10,614,000	
8153	モスフードサービス	13,900	2,806.00	39,003,400	貸付有価証券 10,200株(10,200株)
8154	加賀電子	10,500	2,063.00	21,661,500	
8158	ソーダニッカ	10,900	571.00	6,223,900	
8159	立花エレテック	7,800	1,677.00	13,080,600	貸付有価証券 600株(600株)
8275	フォーバル	4,600	803.00	3,693,800	
8283	PALTA C	19,100	5,960.00	113,836,000	
8285	三谷産業	12,400	285.00	3,534,000	貸付有価証券 5,200株(5,200株)
8835	太平洋興発	4,200	766.00	3,217,200	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
9260	西本Wismettacホールディングス	2,400	4,395.00	10,548,000	
9265	ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,107.00	996,300	
9274	国際紙パルプ商事	18,500	302.00	5,587,000	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
9305	ヤマタネ	5,300	1,589.00	8,421,700	
9763	丸紅建材リース	1,000	1,986.00	1,986,000	
9810	日鉄住金物産	7,500	4,725.00	35,437,500	
9824	泉州電業	3,500	2,677.00	9,369,500	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
9830	トラスコ中山	22,000	2,887.00	63,514,000	貸付有価証券 12,400株(12,400株)
9832	オートバックスセブン	42,100	1,833.00	77,169,300	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
9837	モリト	7,700	807.00	6,213,900	貸付有価証券 100株(100株)
9869	加藤産業	16,600	3,675.00	61,005,000	貸付有価証券 4,300株(4,300株)
9872	北恵	2,000	901.00	1,802,000	
9880	イノテック	6,300	973.00	6,129,900	
9882	イエローハット	10,000	2,851.00	28,510,000	
9896	J Kホールディングス	9,600	578.00	5,548,800	
9902	日伝	8,800	1,618.00	14,238,400	

9930	北沢産業	7,900	257.00	2,030,300	貸付有価証券 6,400株(6,400株)
9932	杉本商事	5,700	1,730.00	9,861,000	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
9934	因幡電機産業	15,000	4,325.00	64,875,000	
9957	パイテックホールディングス	4,800	1,926.00	9,244,800	
9960	東テク	3,500	2,275.00	7,962,500	
9962	ミスミグループ本社	132,500	2,615.00	346,487,500	貸付有価証券 68,200株(68,200株)
9972	アルテック	7,800	208.00	1,622,400	貸付有価証券 5,600株(5,600株)
9982	タキヒヨー	3,200	1,702.00	5,446,400	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
9986	蔵王産業	1,700	1,356.00	2,305,200	
9987	スズケン	48,300	6,150.00	297,045,000	
9991	ジェコス	7,300	1,021.00	7,453,300	
9995	ルネサスイーストン	9,700	424.00	4,112,800	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
2651	ローソン	26,800	6,140.00	164,552,000	貸付有価証券 18,400株(18,400株)
2659	サンエー	8,000	4,270.00	34,160,000	
2664	カワチ薬品	8,200	1,781.00	14,604,200	
2670	エービーシー・マート	16,500	6,490.00	107,085,000	
2674	ハードオフコーポレーション	4,200	842.00	3,536,400	
2678	アスクル	11,100	2,729.00	30,291,900	
2681	ゲオホールディングス	16,100	1,505.00	24,230,500	
2685	アダストリア	14,700	2,440.00	35,868,000	
2686	ジーフット	6,400	643.00	4,115,200	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,400	719.00	1,006,600	
2695	くらコーポレーション	6,200	5,080.00	31,496,000	貸付有価証券 4,500株(4,500株)
2698	キャンドウ	5,000	1,663.00	8,315,000	
2726	パルグループホールディングス	5,400	3,085.00	16,659,000	
2730	エディオン	44,900	989.00	44,406,100	貸付有価証券 7,300株(7,300株)
2734	サーラコーポレーション	21,500	614.00	13,201,000	貸付有価証券 6,700株(6,700株)
2735	ワッツ	3,500	712.00	2,492,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
2742	ハローズ	4,000	2,104.00	8,416,000	貸付有価証券 900株(900株)
2752	フジオフードシステム	4,400	2,575.00	11,330,000	
2753	あみやき亭	2,300	3,730.00	8,579,000	
2764	ひらまつ	21,100	347.00	7,321,700	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
2791	大黒天物産	2,500	3,760.00	9,400,000	
2792	ハニーズホールディングス	9,300	1,100.00	10,230,000	

2796	ファーマライズホールディングス	2,500	535.00	1,337,500	
3028	アルペン	8,100	1,713.00	13,875,300	貸付有価証券 4,100株（4,100株）
3030	ハブ	3,400	985.00	3,349,000	
3034	クオールホールディングス	15,600	1,450.00	22,620,000	貸付有価証券 5,800株（5,800株）
3046	ジンス	7,200	5,850.00	42,120,000	貸付有価証券 500株（500株）
3048	ビックカメラ	56,500	1,176.00	66,444,000	
3050	DCMホールディングス	57,100	1,027.00	58,641,700	貸付有価証券 26,800株（26,800株）
3053	ベッパーフードサービス	8,300	2,207.00	18,318,100	貸付有価証券 5,300株（5,300株）
3064	Monotaro	66,900	2,368.00	158,419,200	貸付有価証券 46,200株（46,200株）
3067	東京一番フーズ	2,700	624.00	1,684,800	
3073	DDホールディングス	2,300	1,893.00	4,353,900	貸付有価証券 700株（700株）
3082	きちりホールディングス	2,800	761.00	2,130,800	
3085	アークランドサービスホールディングス	7,700	2,038.00	15,692,600	
3086	J.フロント リテイリング	135,400	1,262.00	170,874,800	貸付有価証券 64,000株（64,000株）
3087	ドトール・日レスホールディングス	18,600	2,109.00	39,227,400	
3088	マツモトキヨシホールディングス	43,800	3,590.00	157,242,000	
3091	ブロンコビリー	5,500	2,658.00	14,619,000	貸付有価証券 2,800株（2,800株）
3092	ZOZO	114,400	2,085.00	238,524,000	貸付有価証券 50,700株（50,700株）
3093	トレジャー・ファクトリー	3,100	763.00	2,365,300	
3097	物語コーポレーション	2,600	9,030.00	23,478,000	貸付有価証券 1,400株（1,400株）
3098	ココカラファイン	11,900	4,375.00	52,062,500	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	198,000	1,120.00	221,760,000	貸付有価証券 61,900株（61,900株）
3134	Hamee	3,200	750.00	2,400,000	
3141	ウエルシアホールディングス	28,000	3,580.00	100,240,000	貸付有価証券 13,600株（13,600株）
3148	クリエイトSDホールディングス	15,600	2,693.00	42,010,800	貸付有価証券 600株（600株）
3159	丸善CHIホールディングス	12,400	352.00	4,364,800	
3169	ミサワ	1,900	404.00	767,600	貸付有価証券 500株（500株）
3172	ティールライフ	1,400	882.00	1,234,800	
3175	エー・ピーカンパニー	2,000	548.00	1,096,000	貸付有価証券 700株（700株）
3178	チムニー	3,200	2,689.00	8,604,800	
3179	シュッピン	7,200	788.00	5,673,600	貸付有価証券 4,400株（4,400株）

3186	ネクステージ	16,300	1,182.00	19,266,600	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
3191	ジョイフル本田	31,000	1,344.00	41,664,000	貸付有価証券 12,500株(12,500株)
3193	鳥貴族	3,500	1,692.00	5,922,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
3194	キリン堂ホールディングス	4,200	1,470.00	6,174,000	
3196	ホットランド	5,500	1,507.00	8,288,500	
3197	すかいらーくホールディングス	98,700	1,790.00	176,673,000	
3198	S F Pホールディングス	3,200	1,892.00	6,054,400	
3199	綿半ホールディングス	3,900	2,102.00	8,197,800	貸付有価証券 600株(600株)
3221	ヨシックス	1,700	3,525.00	5,992,500	
3222	ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	30,800	1,097.00	33,787,600	貸付有価証券 21,200株(21,200株)
3319	ゴルフダイジェスト・オンライン	4,300	612.00	2,631,600	
3328	B E E N O S	2,500	1,118.00	2,795,000	
3333	あさひ	8,800	1,507.00	13,261,600	
3341	日本調剤	3,700	3,780.00	13,986,000	
3349	コスモス薬品	4,700	18,730.00	88,031,000	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
3361	トーエル	5,100	787.00	4,013,700	
3376	オンリー	1,800	987.00	1,776,600	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	443,700	4,240.00	1,881,288,000	
3385	薬王堂	4,600	2,581.00	11,872,600	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
3387	クリエイト・レストランツ・ホールディング	28,500	1,338.00	38,133,000	貸付有価証券 8,600株(8,600株)
3391	ツルハホールディングス	23,000	8,960.00	206,080,000	
3395	サンマルクホールディングス	8,400	2,573.00	21,613,200	
3396	フェリシモ	2,300	1,086.00	2,497,800	
3397	トリドールホールディングス	13,100	2,276.00	29,815,600	貸付有価証券 9,400株(9,400株)
3415	T O K Y O B A S E	9,500	979.00	9,300,500	
3538	ウイルプラスホールディングス	1,200	816.00	979,200	
3539	ジャパンミート	4,000	1,894.00	7,576,000	
3544	サツドラホールディングス	1,600	1,834.00	2,934,400	貸付有価証券 200株(200株)
3545	デファクトスタンダード	700	436.00	305,200	
3546	ダイユー・リックホールディングス	5,700	832.00	4,742,400	
3548	パロックジャパンリミテッド	8,600	847.00	7,284,200	
3549	クスリのアオキホールディングス	10,500	7,620.00	80,010,000	貸付有価証券 6,100株(6,100株)
3561	力の源ホールディングス	3,000	780.00	2,340,000	貸付有価証券 900株(900株)
3563	スシローグローバルホールディングス	11,600	7,450.00	86,420,000	
3564	L I X I L ビバ	9,000	1,424.00	12,816,000	

4350	メディカルシステムネットワーク	11,200	518.00	5,801,600	
7416	はるやまホールディングス	5,000	890.00	4,450,000	
7419	ノジマ	18,800	1,963.00	36,904,400	
7421	カップ・クリエイト	14,800	1,529.00	22,629,200	貸付有価証券 10,200株(10,200株)
7445	ライトオン	8,900	740.00	6,586,000	
7448	ジーンズメイト	3,200	414.00	1,324,800	
7453	良品計画	15,000	25,570.00	383,550,000	貸付有価証券 5,700株(5,700株)
7455	三城ホールディングス	13,100	392.00	5,135,200	
7463	アドヴァン	16,200	1,042.00	16,880,400	貸付有価証券 7,900株(7,900株)
7475	アルビス	4,000	2,333.00	9,332,000	
7494	コナカ	13,500	444.00	5,994,000	
7506	ハウス オブ ローゼ	1,300	1,801.00	2,341,300	
7508	G - 7ホールディングス	3,100	2,222.00	6,888,200	
7512	イオン北海道	10,600	750.00	7,950,000	
7513	コジマ	15,600	598.00	9,328,800	
7514	ヒマラヤ	3,300	919.00	3,032,700	
7516	コーナン商事	13,900	2,692.00	37,418,800	
7520	エコス	3,900	1,526.00	5,951,400	
7522	ワタミ	13,900	1,642.00	22,823,800	
7524	マルシェ	2,800	800.00	2,240,000	
7532	バン・パシフィック・インターナショナルホ	63,400	7,040.00	446,336,000	
7545	西松屋チェーン	23,200	933.00	21,645,600	
7550	ゼンショーホールディングス	49,900	2,600.00	129,740,000	貸付有価証券 40,100株(40,100株)
7554	幸楽苑ホールディングス	6,700	2,539.00	17,011,300	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
7561	ハークスレイ	2,200	1,121.00	2,466,200	
7581	サイゼリヤ	17,400	2,138.00	37,201,200	貸付有価証券 12,800株(12,800株)
7593	V Tホールディングス	35,900	426.00	15,293,400	
7596	魚力	2,900	1,454.00	4,216,600	
7601	ポプラ	2,800	526.00	1,472,800	
7605	フジ・コーポレーション	2,100	2,212.00	4,645,200	
7606	ユナイテッドアローズ	12,100	3,695.00	44,709,500	
7611	ハイデイ日高	15,300	2,078.00	31,793,400	
7615	京都きもの友禅	6,700	405.00	2,713,500	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
7616	コロワイド	35,200	2,379.00	83,740,800	貸付有価証券 25,900株(25,900株)
7618	ピーシーデポコーポレーション	14,000	444.00	6,216,000	
7630	壱番屋	7,500	4,685.00	35,137,500	貸付有価証券 3,800株(3,800株)

7640	トップカルチャー	3,800	321.00	1,219,800	貸付有価証券 600株(600株)
7646	P L A N T	2,400	990.00	2,376,000	
7649	スギホールディングス	23,200	4,820.00	111,824,000	
7918	ヴィア・ホールディングス	13,000	689.00	8,957,000	貸付有価証券 5,300株(5,300株)
8005	スクロール	16,300	379.00	6,177,700	貸付有価証券 11,800株(11,800株)
8008	ヨンドシーホールディングス	11,700	2,055.00	24,043,500	貸付有価証券 5,900株(5,900株)
8028	ユニー・ファミリーマートホールディングス	118,400	2,876.00	340,518,400	貸付有価証券 81,600株(81,600株)
8160	木曽路	13,000	2,712.00	35,256,000	貸付有価証券 9,500株(9,500株)
8163	S R Sホールディングス	12,500	1,033.00	12,912,500	
8165	千趣会	19,200	231.00	4,435,200	
8166	タカキュー	8,200	172.00	1,410,400	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
8168	ケーヨー	19,600	489.00	9,584,400	貸付有価証券 11,900株(11,900株)
8173	上新電機	12,500	2,533.00	31,662,500	
8174	日本瓦斯	17,200	3,275.00	56,330,000	
8179	ロイヤルホールディングス	18,500	2,680.00	49,580,000	貸付有価証券 13,000株(13,000株)
8181	東天紅	800	1,236.00	988,800	
8182	いなげや	11,800	1,299.00	15,328,200	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
8184	島忠	24,000	2,832.00	67,968,000	
8185	チヨダ	11,100	1,730.00	19,203,000	
8194	ライフコーポレーション	8,000	2,304.00	18,432,000	
8200	リンガーハット	13,000	2,343.00	30,459,000	貸付有価証券 6,600株(6,600株)
8203	M r M a x H D	14,500	431.00	6,249,500	貸付有価証券 6,800株(6,800株)
8207	テナアライド	9,800	428.00	4,194,400	
8214	A O K Iホールディングス	21,200	1,186.00	25,143,200	貸付有価証券 200株(200株)
8217	オークワ	15,100	1,105.00	16,685,500	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
8218	コメリ	16,300	2,686.00	43,781,800	
8219	青山商事	18,500	2,546.00	47,101,000	
8227	しまむら	12,300	9,300.00	114,390,000	貸付有価証券 6,300株(6,300株)
8230	はせがわ	5,600	397.00	2,223,200	
8233	高島屋	83,100	1,488.00	123,652,800	貸付有価証券 13,700株(13,700株)
8237	松屋	21,300	994.00	21,172,200	貸付有価証券 15,600株(15,600株)

8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	54,300	1,506.00	81,775,800	貸付有価証券 9,100株(9,100株)
8244	近鉄百貨店	4,000	3,385.00	13,540,000	
8251	パルコ	10,200	1,001.00	10,210,200	貸付有価証券 7,400株(7,400株)
8252	丸井グループ	89,600	2,214.00	198,374,400	貸付有価証券 70,800株(70,800株)
8255	アクシアル リテイリング	8,800	3,390.00	29,832,000	
8260	井筒屋	5,400	263.00	1,420,200	貸付有価証券 4,200株(4,200株)
8267	イオン	407,400	2,248.00	915,835,200	貸付有価証券 225,800株(225,800株)
8273	イズミ	21,500	4,955.00	106,532,500	
8276	平和堂	21,500	2,339.00	50,288,500	
8278	フジ	12,800	1,869.00	23,923,200	
8279	ヤオコー	12,000	5,600.00	67,200,000	
8281	ゼビオホールディングス	12,800	1,240.00	15,872,000	
8282	ケースホールディングス	110,000	980.00	107,800,000	
8289	Olympicグループ	6,200	650.00	4,030,000	貸付有価証券 4,500株(4,500株)
8291	日産東京販売ホールディングス	15,600	313.00	4,882,800	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
9267	Genky DrugStores	5,200	2,300.00	11,960,000	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
9277	総合メディカルホールディングス	9,200	1,665.00	15,318,000	
9278	ブックオフグループホールディングス	5,500	830.00	4,565,000	貸付有価証券 4,400株(4,400株)
9627	アインホールディングス	14,200	8,070.00	114,594,000	貸付有価証券 6,600株(6,600株)
9828	元気寿司	3,000	5,140.00	15,420,000	
9831	ヤマダ電機	322,500	560.00	180,600,000	貸付有価証券 249,900株(249,900株)
9842	アークランドサカモト	18,000	1,412.00	25,416,000	
9843	ニトリホールディングス	45,800	13,500.00	618,300,000	貸付有価証券 21,500株(21,500株)
9850	グルメ杵屋	7,500	1,217.00	9,127,500	
9854	愛眼	8,400	302.00	2,536,800	貸付有価証券 6,200株(6,200株)
9856	ケーユーホールディングス	5,500	861.00	4,735,500	
9861	吉野家ホールディングス	37,000	1,735.00	64,195,000	貸付有価証券 26,700株(26,700株)
9887	松屋フーズホールディングス	5,100	3,850.00	19,635,000	貸付有価証券 3,700株(3,700株)
9900	サガミホールディングス	14,200	1,316.00	18,687,200	貸付有価証券 9,900株(9,900株)
9919	関西スーパーマーケット	8,000	1,062.00	8,496,000	
9936	王将フードサービス	7,800	7,320.00	57,096,000	

9945	プレナス	11,900	1,716.00	20,420,400	貸付有価証券 3,800株(3,800株)
9946	ミニストップ	7,800	1,668.00	13,010,400	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
9948	アークス	19,900	2,376.00	47,282,400	
9956	パローホールディングス	22,800	2,668.00	60,830,400	
9966	藤久	800	758.00	606,400	
9974	ベルク	5,200	5,060.00	26,312,000	貸付有価証券 3,800株(3,800株)
9979	大庄	5,700	1,509.00	8,601,300	
9983	ファーストリテイリング	14,200	52,630.00	747,346,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
9989	サンドラッグ	39,800	3,115.00	123,977,000	
9990	サクスパーホールディングス	9,000	1,123.00	10,107,000	
9993	ヤマザワ	2,200	1,657.00	3,645,400	
9994	やまや	1,800	2,358.00	4,244,400	
9997	ベルーナ	26,000	869.00	22,594,000	
7150	島根銀行	2,200	758.00	1,667,600	
7161	じもとホールディングス	71,600	113.00	8,090,800	
7167	めぶきフィナンシャルグループ	550,900	287.00	158,108,300	
7173	東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,300	1,650.00	23,595,000	貸付有価証券 10,800株(10,800株)
7180	九州フィナンシャルグループ	174,000	468.00	81,432,000	貸付有価証券 82,800株(82,800株)
7182	ゆうちょ銀行	300,400	1,238.00	371,895,200	貸付有価証券 170,800株(170,800株)
7184	富山第一銀行	25,300	378.00	9,563,400	
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	675,300	423.00	285,651,900	貸付有価証券 378,000株(378,000株)
7189	西日本フィナンシャルホールディングス	67,900	946.00	64,233,400	
7321	関西みらいフィナンシャルグループ	49,800	834.00	41,533,200	貸付有価証券 33,700株(33,700株)
7322	三十三フィナンシャルグループ	9,200	1,599.00	14,710,800	貸付有価証券 5,500株(5,500株)
7327	第四北越フィナンシャルグループ	18,400	3,150.00	57,960,000	
8303	新生銀行	77,800	1,560.00	121,368,000	
8304	あおぞら銀行	59,200	2,892.00	171,206,400	貸付有価証券 28,200株(28,200株)
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,298,200	553.40	4,038,823,880	
8308	りそなホールディングス	1,163,400	486.70	566,226,780	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	208,400	4,053.00	844,645,200	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	747,200	3,915.00	2,925,288,000	
8331	千葉銀行	375,500	605.00	227,177,500	
8334	群馬銀行	212,100	466.00	98,838,600	
8336	武蔵野銀行	15,800	2,236.00	35,328,800	

8337	千葉興業銀行	29,100	302.00	8,788,200	貸付有価証券 19,700株(19,700株)
8338	筑波銀行	44,100	192.00	8,467,200	貸付有価証券 32,400株(32,400株)
8341	七十七銀行	33,300	1,561.00	51,981,300	
8342	青森銀行	8,200	2,929.00	24,017,800	貸付有価証券 5,700株(5,700株)
8343	秋田銀行	6,800	2,257.00	15,347,600	貸付有価証券 900株(900株)
8344	山形銀行	11,900	1,966.00	23,395,400	貸付有価証券 8,800株(8,800株)
8345	岩手銀行	7,400	3,290.00	24,346,000	貸付有価証券 4,700株(4,700株)
8346	東邦銀行	94,800	299.00	28,345,200	貸付有価証券 69,000株(69,000株)
8349	東北銀行	5,400	1,087.00	5,869,800	貸付有価証券 700株(700株)
8350	みちのく銀行	6,800	1,649.00	11,213,200	貸付有価証券 3,900株(3,900株)
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	86,100	2,491.00	214,475,100	貸付有価証券 16,400株(16,400株)
8355	静岡銀行	266,900	850.00	226,865,000	
8356	十六銀行	14,200	2,318.00	32,915,600	貸付有価証券 6,800株(6,800株)
8358	スルガ銀行	108,500	514.00	55,769,000	
8359	八十二銀行	191,900	454.00	87,122,600	
8360	山梨中央銀行	13,100	1,380.00	18,078,000	貸付有価証券 9,600株(9,600株)
8361	大垣共立銀行	16,800	2,341.00	39,328,800	貸付有価証券 6,800株(6,800株)
8362	福井銀行	9,100	1,678.00	15,269,800	貸付有価証券 4,300株(4,300株)
8363	北國銀行	11,300	3,440.00	38,872,000	貸付有価証券 6,100株(6,100株)
8364	清水銀行	4,400	1,862.00	8,192,800	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
8365	富山銀行	2,000	3,135.00	6,270,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
8366	滋賀銀行	21,300	2,650.00	56,445,000	貸付有価証券 10,200株(10,200株)
8367	南都銀行	12,400	2,147.00	26,622,800	
8368	百五銀行	95,400	364.00	34,725,600	貸付有価証券 19,200株(19,200株)
8369	京都銀行	38,000	4,720.00	179,360,000	
8370	紀陽銀行	37,500	1,539.00	57,712,500	貸付有価証券 30,600株(30,600株)
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	70,600	1,207.00	85,214,200	
8379	広島銀行	156,500	568.00	88,892,000	
8381	山陰合同銀行	62,900	816.00	51,326,400	

8382	中国銀行	68,400	1,084.00	74,145,600	貸付有価証券 15,500株(15,500株)
8383	鳥取銀行	3,600	1,423.00	5,122,800	
8385	伊予銀行	140,500	598.00	84,019,000	貸付有価証券 35,100株(35,100株)
8386	百十四銀行	11,300	2,353.00	26,588,900	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
8387	四国銀行	15,200	1,061.00	16,127,200	
8388	阿波銀行	17,000	2,852.00	48,484,000	貸付有価証券 8,800株(8,800株)
8392	大分銀行	6,500	3,480.00	22,620,000	貸付有価証券 3,300株(3,300株)
8393	宮崎銀行	7,100	2,706.00	19,212,600	
8395	佐賀銀行	6,400	1,883.00	12,051,200	
8396	十八銀行	6,500	2,776.00	18,044,000	
8397	沖縄銀行	9,700	3,575.00	34,677,500	貸付有価証券 7,300株(7,300株)
8399	琉球銀行	24,500	1,197.00	29,326,500	貸付有価証券 16,000株(16,000株)
8410	セブン銀行	358,200	327.00	117,131,400	
8411	みずほフィナンシャルグループ	14,406,200	173.60	2,500,916,320	
8416	高知銀行	3,800	775.00	2,945,000	
8418	山口フィナンシャルグループ	132,300	975.00	128,992,500	貸付有価証券 11,400株(11,400株)
8521	長野銀行	3,500	1,656.00	5,796,000	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
8522	名古屋銀行	8,600	3,545.00	30,487,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
8524	北洋銀行	159,800	283.00	45,223,400	貸付有価証券 81,800株(81,800株)
8527	愛知銀行	3,800	3,535.00	13,433,000	
8530	中京銀行	4,400	2,260.00	9,944,000	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
8537	大光銀行	3,600	1,618.00	5,824,800	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
8541	愛媛銀行	14,800	1,141.00	16,886,800	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
8542	トマト銀行	4,100	1,054.00	4,321,400	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
8544	京葉銀行	46,800	693.00	32,432,400	貸付有価証券 22,500株(22,500株)
8550	栃木銀行	54,900	234.00	12,846,600	貸付有価証券 29,200株(29,200株)
8551	北日本銀行	3,300	2,062.00	6,804,600	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
8558	東和銀行	18,600	736.00	13,689,600	
8562	福島銀行	9,200	372.00	3,422,400	貸付有価証券 4,600株(4,600株)
8563	大東銀行	5,100	638.00	3,253,800	貸付有価証券 3,500株(3,500株)

8600	トモニホールディングス	82,000	426.00	34,932,000	貸付有価証券 59,900株(59,900株)
8713	フィデアホールディングス	102,900	132.00	13,582,800	貸付有価証券 24,000株(24,000株)
8714	池田泉州ホールディングス	112,500	300.00	33,750,000	
7148	F P G	33,300	922.00	30,702,600	
7190	マーキュリアインベストメント	4,100	676.00	2,771,600	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
8473	S B Iホールディングス	126,300	2,389.00	301,730,700	
8518	日本アジア投資	9,000	187.00	1,683,000	貸付有価証券 5,200株(5,200株)
8595	ジャフコ	17,400	3,990.00	69,426,000	
8601	大和証券グループ本社	850,700	548.70	466,779,090	
8604	野村ホールディングス	1,865,500	399.00	744,334,500	
8609	岡三証券グループ	90,300	443.00	40,002,900	貸付有価証券 38,000株(38,000株)
8613	丸三証券	31,500	683.00	21,514,500	貸付有価証券 23,200株(23,200株)
8614	東洋証券	37,900	148.00	5,609,200	貸付有価証券 30,000株(30,000株)
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	126,400	415.00	52,456,000	
8617	光世証券	2,500	702.00	1,755,000	
8622	水戸証券	30,700	209.00	6,416,300	貸付有価証券 24,100株(24,100株)
8624	いちよし証券	22,200	788.00	17,493,600	
8628	松井証券	51,900	1,187.00	61,605,300	貸付有価証券 39,600株(39,600株)
8692	だいこう証券ビジネス	4,300	414.00	1,780,200	貸付有価証券 100株(100株)
8698	マネックスグループ	99,000	394.00	39,006,000	貸付有価証券 76,000株(76,000株)
8703	カブドットコム証券	72,200	560.00	40,432,000	
8706	極東証券	14,200	1,078.00	15,307,600	
8707	岩井コスモホールディングス	10,900	1,299.00	14,159,100	
8708	藍澤證券	19,800	662.00	13,107,600	貸付有価証券 6,800株(6,800株)
8732	マネーパートナーズグループ	12,400	284.00	3,521,600	
8739	スパークス・グループ	25,000	243.00	6,075,000	
8742	小林洋行	3,000	277.00	831,000	貸付有価証券 100株(100株)
7181	かんぽ生命保険	40,000	2,441.00	97,640,000	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
8630	S O M P Oホールディングス	186,900	4,010.00	749,469,000	
8715	アニコムホールディングス	8,700	2,777.00	24,159,900	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
8725	M S & A Dインシュアランスグループホール	277,200	3,353.00	929,451,600	

8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	87,100	2,058.00	179,251,800	
8750	第一生命ホールディングス	599,800	1,556.50	933,588,700	
8766	東京海上ホールディングス	384,300	5,368.00	2,062,922,400	
8795	T & Dホールディングス	327,900	1,139.50	373,642,050	
8798	アドバンスクリエイト	2,500	1,729.00	4,322,500	
7164	全国保証	29,900	4,035.00	120,646,500	
7187	ジェイリース	2,200	382.00	840,400	貸付有価証券 700株(700株)
7191	イントラスト	3,000	457.00	1,371,000	
7192	日本モーゲージサービス	1,400	1,328.00	1,859,200	
7196	C a s a	3,600	993.00	3,574,800	
7198	アルヒ	9,600	2,109.00	20,246,400	貸付有価証券 3,300株(3,300株)
7199	プレミアグループ	2,300	3,385.00	7,785,500	
8253	クレディセゾン	74,300	1,515.00	112,564,500	
8424	芙蓉総合リース	12,100	5,580.00	67,518,000	
8425	興銀リース	19,900	2,736.00	54,446,400	
8439	東京センチュリー	21,400	4,625.00	98,975,000	貸付有価証券 6,700株(6,700株)
8511	日本証券金融	46,700	620.00	28,954,000	貸付有価証券 34,400株(34,400株)
8515	アイフル	161,700	282.00	45,599,400	
8566	リコーリース	8,300	3,510.00	29,133,000	
8570	イオンフィナンシャルサービス	67,700	2,267.00	153,475,900	
8572	アコム	213,100	388.00	82,682,800	貸付有価証券 108,100株(108,100株)
8584	ジャックス	11,700	1,867.00	21,843,900	貸付有価証券 300株(300株)
8585	オリエントコーポレーション	286,700	116.00	33,257,200	貸付有価証券 166,900株(166,900株)
8586	日立キャピタル	25,000	2,622.00	65,550,000	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
8589	アプラスフィナンシャル	50,900	84.00	4,275,600	貸付有価証券 11,700株(11,700株)
8591	オリックス	707,300	1,618.00	1,144,411,400	
8593	三菱UFJリース	239,200	554.00	132,516,800	
8596	九州リースサービス	5,200	699.00	3,634,800	
8697	日本取引所グループ	286,400	1,944.00	556,761,600	
8771	イー・ギャランティ	9,900	1,059.00	10,484,100	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
8772	アサックス	4,400	549.00	2,415,600	
8793	NECキャピタルソリューション	4,300	1,786.00	7,679,800	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
2337	いちご	134,800	372.00	50,145,600	
2353	日本駐車場開発	127,900	164.00	20,975,600	

3003	ヒューリック	221,300	1,067.00	236,127,100	貸付有価証券 91,600株(91,600株)
3228	三栄建築設計	4,200	1,596.00	6,703,200	
3230	スター・マイカ	4,900	1,381.00	6,766,900	
3231	野村不動産ホールディングス	70,600	2,156.00	152,213,600	
3232	三重交通グループホールディングス	21,500	577.00	12,405,500	
3244	サムティ	14,600	1,473.00	21,505,800	
3245	ディア・ライフ	13,600	421.00	5,725,600	
3246	コーセーアールイー	3,100	710.00	2,201,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
3250	エー・ディー・ワークス	163,400	34.00	5,555,600	
3252	日本商業開発	6,600	1,603.00	10,579,800	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
3254	プレサンスコーポレーション	16,800	1,388.00	23,318,400	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
3258	ユニゾホールディングス	16,000	2,092.00	33,472,000	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
3271	THEグローバル社	5,400	489.00	2,640,600	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
3276	日本管理センター	7,000	781.00	5,467,000	
3277	サンセイランディック	2,800	717.00	2,007,600	
3280	エストラスト	1,400	709.00	992,600	
3284	フージャースホールディングス	23,000	677.00	15,571,000	貸付有価証券 8,200株(8,200株)
3288	オープンハウス	17,300	3,825.00	66,172,500	貸付有価証券 6,400株(6,400株)
3289	東急不動産ホールディングス	285,200	653.00	186,235,600	
3291	飯田グループホールディングス	88,400	2,011.00	177,772,400	
3294	イーグランド	1,500	716.00	1,074,000	貸付有価証券 100株(100株)
3299	ムゲンエステート	7,300	600.00	4,380,000	
3452	ビーロット	1,600	1,441.00	2,305,600	
3454	ファーストブラザーズ	2,900	1,068.00	3,097,200	
3457	ハウズドゥ	5,800	1,384.00	8,027,200	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
3458	シーアールイー	3,500	955.00	3,342,500	
3464	プロパティエージェント	1,100	1,152.00	1,267,200	貸付有価証券 200株(200株)
3465	ケイアイスター不動産	2,800	1,723.00	4,824,400	
3467	アグレ都市デザイン	1,300	564.00	733,200	
3475	グッドコムアセット	1,800	1,521.00	2,737,800	
3480	ジェイ・エス・ビー	400	3,800.00	1,520,000	
3484	テンポイノベーション	900	1,530.00	1,377,000	
3486	グローバル・リンク・マネジメント	800	681.00	544,800	
4666	パーク24	62,000	2,426.00	150,412,000	貸付有価証券 28,400株(28,400株)

4809	パラカ	2,700	1,946.00	5,254,200	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
8801	三井不動産	562,500	2,770.50	1,558,406,250	
8802	三菱地所	742,800	1,993.50	1,480,771,800	
8803	平和不動産	20,100	2,142.00	43,054,200	
8804	東京建物	115,900	1,328.00	153,915,200	
8806	ダイビル	31,200	1,041.00	32,479,200	
8818	京阪神ビルディング	18,900	1,023.00	19,334,700	
8830	住友不動産	238,300	4,654.00	1,109,048,200	貸付有価証券 55,800株(55,800株)
8841	テーオーシー	24,300	763.00	18,540,900	
8842	東京楽天地	1,500	4,810.00	7,215,000	
8848	レオパレス21	130,800	236.00	30,868,800	貸付有価証券 52,000株(52,000株)
8850	スターツコーポレーション	14,400	2,328.00	33,523,200	貸付有価証券 6,800株(6,800株)
8860	フジ住宅	13,500	821.00	11,083,500	貸付有価証券 5,500株(5,500株)
8864	空港施設	12,400	549.00	6,807,600	
8869	明和地所	5,800	637.00	3,694,600	
8871	ゴールドクレスト	8,400	1,530.00	12,852,000	
8877	日本エスリード	4,100	1,708.00	7,002,800	
8881	日神不動産	15,700	462.00	7,253,400	
8892	日本エスコン	19,100	724.00	13,828,400	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
8897	タカラレーベン	49,700	368.00	18,289,600	貸付有価証券 34,500株(34,500株)
8904	サンヨーハウジング名古屋	6,000	903.00	5,418,000	
8905	イオンモール	53,100	1,784.00	94,730,400	貸付有価証券 35,100株(35,100株)
8908	毎日コムネット	2,300	755.00	1,736,500	
8917	ファースト住建	3,900	1,198.00	4,672,200	
8918	ランド	432,800	8.00	3,462,400	貸付有価証券 149,600株(149,600株)
8919	カチタス	11,800	3,505.00	41,359,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
8923	トーセイ	14,600	1,005.00	14,673,000	
8928	穴吹興産	1,200	2,865.00	3,438,000	
8934	サンフロンティア不動産	14,600	1,175.00	17,155,000	
8935	エフ・ジェー・ネクスト	9,300	891.00	8,286,300	
8940	インテリックス	3,000	681.00	2,043,000	
8944	ランドビジネス	5,400	788.00	4,255,200	貸付有価証券 3,700株(3,700株)
8999	グランディハウス	9,300	471.00	4,380,300	
9706	日本空港ビルデング	33,800	4,725.00	159,705,000	貸付有価証券 25,500株(25,500株)

1954	日本工営	6,900	2,295.00	15,835,500	貸付有価証券 5,600株(5,600株)
2120	L I F U L L	39,800	558.00	22,208,400	貸付有価証券 19,800株(19,800株)
2124	ジェイエイシーリクルートメント	8,300	2,285.00	18,965,500	
2127	日本M&Aセンター	76,600	3,025.00	231,715,000	貸付有価証券 51,200株(51,200株)
2130	メンバーズ	3,400	1,793.00	6,096,200	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
2139	中広	1,100	558.00	613,800	貸付有価証券 600株(600株)
2151	タケエイ	10,700	729.00	7,800,300	
2153	E・Jホールディングス	1,300	1,077.00	1,400,100	貸付有価証券 400株(400株)
2154	トラスト・テック	5,700	3,535.00	20,149,500	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
2157	コシダカホールディングス	27,500	1,603.00	44,082,500	貸付有価証券 11,500株(11,500株)
2163	アルトナー	1,900	869.00	1,651,100	
2168	パソナグループ	12,500	1,494.00	18,675,000	
2169	C D S	2,500	1,181.00	2,952,500	
2170	リンクアンドモチベーション	18,900	780.00	14,742,000	貸付有価証券 13,500株(13,500株)
2174	G C A	10,400	807.00	8,392,800	
2175	エス・エム・エス	37,700	1,881.00	70,913,700	貸付有価証券 20,600株(20,600株)
2180	サニーサイドアップ	1,100	1,799.00	1,978,900	
2181	パーソルホールディングス	102,700	1,781.00	182,908,700	貸付有価証券 6,200株(6,200株)
2183	リニカル	5,800	1,394.00	8,085,200	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
2193	クックパッド	32,300	269.00	8,688,700	
2196	エスクリ	2,800	647.00	1,811,600	
2198	アイ・ケイ・ケイ	5,000	795.00	3,975,000	
2301	学情	4,200	1,231.00	5,170,200	
2305	スタジオアリス	5,200	2,241.00	11,653,200	
2309	シミックホールディングス	5,700	1,566.00	8,926,200	
2325	N J S	2,300	1,418.00	3,261,400	
2331	総合警備保障	40,900	4,640.00	189,776,000	
2371	カカクコム	76,900	1,989.00	152,954,100	
2372	アイロムグループ	3,900	1,459.00	5,690,100	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
2374	セントケア・ホールディング	5,600	545.00	3,052,000	
2376	サイネックス	1,700	725.00	1,232,500	
2378	ルネサンス	5,700	2,049.00	11,679,300	
2379	ディップ	16,600	1,828.00	30,344,800	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
2389	オプトホールディング	6,300	1,707.00	10,754,100	

2395	新日本科学	13,900	829.00	11,523,100	
2398	ツクイ	24,200	718.00	17,375,600	
2410	キャリアデザインセンター	2,600	1,271.00	3,304,600	
2412	ベネフィット・ワン	28,500	1,954.00	55,689,000	
2413	エムスリー	216,200	1,770.00	382,674,000	
2418	ツカダ・グローバルホールディング	6,500	597.00	3,880,500	
2424	プラス	800	592.00	473,600	
2427	アウトソーシング	54,100	1,319.00	71,357,900	貸付有価証券 13,000株(13,000株)
2428	ウェルネット	9,700	1,055.00	10,233,500	
2429	ワールドホールディングス	2,800	1,793.00	5,020,400	
2432	ディー・エヌ・エー	55,400	1,697.00	94,013,800	
2433	博報堂DYホールディングス	142,800	1,738.00	248,186,400	
2440	ぐるなび	14,600	710.00	10,366,000	貸付有価証券 9,600株(9,600株)
2445	エスアールジータカミヤ	10,600	660.00	6,996,000	貸付有価証券 4,100株(4,100株)
2453	ジャパンベストレスキューシステム	8,100	1,576.00	12,765,600	貸付有価証券 5,800株(5,800株)
2461	ファンコミュニケーションズ	28,200	569.00	16,045,800	
2462	ライク	4,000	910.00	3,640,000	貸付有価証券 3,300株(3,300株)
2464	ビジネス・ブレークスルー	4,300	398.00	1,711,400	
2475	WDBホールディングス	4,700	3,020.00	14,194,000	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
2485	ティア	5,200	659.00	3,426,800	
2487	CDG	900	1,292.00	1,162,800	貸付有価証券 400株(400株)
2491	パリュウコマース	6,900	2,228.00	15,373,200	
2492	インフォマート	56,300	1,305.00	73,471,500	貸付有価証券 27,000株(27,000株)
2749	JPHホールディングス	29,300	290.00	8,497,000	
3521	エコナックホールディングス	18,500	121.00	2,238,500	
4282	EPSホールディングス	15,500	1,824.00	28,272,000	
4286	レッグス	2,500	855.00	2,137,500	貸付有価証券 700株(700株)
4290	プレステージ・インターナショナル	19,200	1,281.00	24,595,200	貸付有価証券 9,600株(9,600株)
4301	アミューズ	6,200	2,444.00	15,152,800	貸付有価証券 4,600株(4,600株)
4310	ドリームインキュベータ	3,100	1,592.00	4,935,200	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
4318	クイック	6,400	1,776.00	11,366,400	
4319	TAC	5,600	222.00	1,243,200	貸付有価証券 4,300株(4,300株)
4321	ケネディクス	90,200	554.00	49,970,800	
4324	電通	125,100	4,575.00	572,332,500	貸付有価証券 54,200株(54,200株)

4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	3,900	1,414.00	5,514,600	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
4337	ぴあ	2,900	4,525.00	13,122,500	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
4343	イオンファンタジー	3,300	2,781.00	9,177,300	
4345	シーティーエス	11,600	619.00	7,180,400	
4346	ネクシィーズグループ	3,000	2,194.00	6,582,000	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
4544	みらかホールディングス	28,700	2,780.00	79,786,000	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
4641	アルプス技研	9,000	1,781.00	16,029,000	
4651	サニックス	18,000	235.00	4,230,000	
4653	ダイオーズ	2,400	1,391.00	3,338,400	
4658	日本空調サービス	11,600	681.00	7,899,600	
4661	オリエンタルランド	121,400	12,300.00	1,493,220,000	
4665	ダスキン	27,600	2,611.00	72,063,600	貸付有価証券 9,300株(9,300株)
4668	明光ネットワークジャパン	13,000	957.00	12,441,000	貸付有価証券 6,200株(6,200株)
4671	ファルコホールディングス	5,600	1,376.00	7,705,600	
4678	秀英予備校	2,200	499.00	1,097,800	
4679	田谷	1,900	650.00	1,235,000	
4680	ラウンドワン	31,900	1,389.00	44,309,100	
4681	リゾートトラスト	43,500	1,526.00	66,381,000	貸付有価証券 34,600株(34,600株)
4694	ビー・エム・エル	13,200	3,175.00	41,910,000	
4696	ワタベウェディング	1,700	644.00	1,094,800	
4708	りらいあコミュニケーションズ	18,600	975.00	18,135,000	
4714	リソー教育	52,100	485.00	25,268,500	
4718	早稲田アカデミー	1,500	1,421.00	2,131,500	
4732	ユー・エス・エス	125,400	1,988.00	249,295,200	
4745	東京個別指導学院	3,600	1,069.00	3,848,400	
4751	サイバーエージェント	63,300	4,175.00	264,277,500	貸付有価証券 23,000株(23,000株)
4755	楽天	478,800	1,033.00	494,600,400	貸付有価証券 272,500株(272,500株)
4763	クリーク・アンド・リバー社	6,000	1,108.00	6,648,000	
4767	テー・オー・ダブリュー	9,000	708.00	6,372,000	
4792	山田コンサルティンググループ	2,900	2,380.00	6,902,000	
4801	セントラルスポーツ	3,800	3,380.00	12,844,000	
4848	フルキャストホールディングス	10,300	2,277.00	23,453,100	
4849	エン・ジャパン	11,200	3,055.00	34,216,000	
5261	リソルホールディングス	1,100	4,400.00	4,840,000	
6028	テクノプロ・ホールディングス	20,600	6,510.00	134,106,000	貸付有価証券 7,300株(7,300株)

6029	アトラ	2,000	366.00	732,000	貸付有価証券 700株(700株)
6032	インターワークス	2,000	758.00	1,516,000	
6035	アイ・アールジャパンホールディングス	3,100	1,715.00	5,316,500	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
6036	Keepers 技研	3,800	1,184.00	4,499,200	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
6037	ファーストロジック	2,000	601.00	1,202,000	
6044	三機サービス	2,100	1,353.00	2,841,300	
6047	Gunosy	7,100	2,275.00	16,152,500	
6048	デザインワン・ジャパン	2,000	300.00	600,000	
6050	イー・ガーディアン	4,900	2,101.00	10,294,900	
6054	リブセンス	5,600	263.00	1,472,800	
6055	ジャパンマテリアル	28,100	1,254.00	35,237,400	
6058	ベクトル	12,500	1,355.00	16,937,500	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
6059	ウチヤマホールディングス	5,100	458.00	2,335,800	
6062	チャーム・ケア・コーポレーション	2,500	1,427.00	3,567,500	
6065	ライクキッズネクスト	2,400	856.00	2,054,400	
6070	キャリアリンク	3,800	398.00	1,512,400	
6071	I B J	6,900	913.00	6,299,700	
6073	アサンテ	4,100	2,226.00	9,126,600	
6077	N・フィールド	6,600	735.00	4,851,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
6078	パリュールHR	2,200	2,430.00	5,346,000	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
6080	M&Aキャピタルパートナーズ	2,600	5,060.00	13,156,000	貸付有価証券 400株(400株)
6082	ライドオンエクスプレスホールディングス	4,200	1,219.00	5,119,800	
6083	ERIホールディングス	2,900	844.00	2,447,600	貸付有価証券 800株(800株)
6087	アピスト	1,600	3,330.00	5,328,000	
6088	シグマクシス	4,900	1,010.00	4,949,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
6089	ウィルグループ	6,700	1,295.00	8,676,500	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
6093	エスクロー・エージェント・ジャパン	14,100	242.00	3,412,200	
6097	日本ビューホテル	3,200	1,126.00	3,603,200	
6098	リクルートホールディングス	735,800	3,015.00	2,218,437,000	
6099	エラン	7,100	1,301.00	9,237,100	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
6171	土木管理総合試験所	4,500	482.00	2,169,000	
6178	日本郵政	841,900	1,309.00	1,102,047,100	
6183	ベルシステム24ホールディングス	17,200	1,407.00	24,200,400	
6184	鎌倉新書	7,500	1,375.00	10,312,500	貸付有価証券 3,200株(3,200株)

6185	ソネット・メディア・ネットワークス	1,000	1,001.00	1,001,000	
6186	一蔵	1,100	575.00	632,500	
6187	LITALICO	2,300	1,810.00	4,163,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
6189	グローバルグループ	1,200	984.00	1,180,800	
6191	エボラブルアジア	3,000	2,370.00	7,110,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
6194	アトラエ	2,000	3,680.00	7,360,000	
6196	ストライク	2,600	2,268.00	5,896,800	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
6197	ソラスト	25,000	1,231.00	30,775,000	貸付有価証券 8,700株（8,700株）
6199	セラク	2,300	539.00	1,239,700	
6200	インソース	3,400	2,416.00	8,214,400	
6532	バイカレント・コンサルティング	5,400	3,510.00	18,954,000	
6533	Orchestra Holdings	1,300	842.00	1,094,600	
6535	アイモバイル	2,400	996.00	2,390,400	
6538	キャリアインデックス	3,500	876.00	3,066,000	
6539	MS - Japan	4,100	1,580.00	6,478,000	貸付有価証券 1,400株（1,400株）
6540	船場	1,600	954.00	1,526,400	
6541	グレイステクノロジー	2,800	2,077.00	5,815,600	貸付有価証券 900株（900株）
6544	ジャパンエレベーターサービスホールディング	6,100	2,364.00	14,420,400	貸付有価証券 2,000株（2,000株）
6546	フルテック	1,100	1,147.00	1,261,700	貸付有価証券 300株（300株）
6547	グリーンズ	2,900	1,412.00	4,094,800	
6551	ツナグ・ソリューションズ	900	686.00	617,400	
6553	ソウルドアウト	800	3,840.00	3,072,000	
6555	MS & Consulting	1,100	1,007.00	1,107,700	
6569	日総工産	2,500	2,365.00	5,912,500	
6571	キュービーネットホールディングス	4,700	2,001.00	9,404,700	
7030	スプリックス	2,900	2,582.00	7,487,800	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
8769	アドバンテッジリスクマネジメント	4,000	859.00	3,436,000	
8876	リログループ	56,100	3,015.00	169,141,500	
8920	東祥	6,400	3,165.00	20,256,000	
9603	エイチ・アイ・エス	18,300	3,980.00	72,834,000	
9612	ラックランド	2,100	2,011.00	4,223,100	貸付有価証券 300株（300株）
9616	共立メンテナンス	15,700	5,700.00	89,490,000	
9619	イチネンホールディングス	10,700	1,183.00	12,658,100	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
9621	建設技術研究所	7,100	1,460.00	10,366,000	貸付有価証券 4,800株（4,800株）

9622	スペース	6,700	1,363.00	9,132,100	
9624	長大	4,100	711.00	2,915,100	
9628	燦ホールディングス	2,200	2,471.00	5,436,200	貸付有価証券 800株(800株)
9632	スバル興業	700	5,660.00	3,962,000	
9633	東京テアトル	4,000	1,340.00	5,360,000	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
9644	タナベ経営	2,000	1,260.00	2,520,000	
9663	ナガワ	2,900	6,050.00	17,545,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
9671	よみうりランド	2,200	4,465.00	9,823,000	
9672	東京都競馬	6,700	3,385.00	22,679,500	貸付有価証券 4,600株(4,600株)
9675	常磐興産	4,100	1,688.00	6,920,800	
9678	カナモト	15,400	2,575.00	39,655,000	
9681	東京ドーム	38,400	1,072.00	41,164,800	貸付有価証券 26,500株(26,500株)
9699	西尾レントオール	10,400	3,150.00	32,760,000	
9704	アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	56,400	33.00	1,861,200	貸付有価証券 37,000株(37,000株)
9715	トランス・コスモス	11,400	2,195.00	25,023,000	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
9716	乃村工藝社	24,000	2,973.00	71,352,000	貸付有価証券 17,600株(17,600株)
9722	藤田観光	4,100	2,692.00	11,037,200	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
9726	KNT-CTホールディングス	5,500	1,371.00	7,540,500	貸付有価証券 3,800株(3,800株)
9728	日本管財	11,000	1,927.00	21,197,000	
9729	トーカイ	9,900	2,691.00	26,640,900	
9731	白洋舎	1,200	2,893.00	3,471,600	
9735	セコム	109,000	9,337.00	1,017,733,000	
9740	セントラル警備保障	4,900	4,640.00	22,736,000	
9743	丹青社	19,400	1,271.00	24,657,400	
9744	メイテック	13,000	4,845.00	62,985,000	
9755	応用地質	11,000	1,096.00	12,056,000	
9757	船井総研ホールディングス	21,200	2,600.00	55,120,000	貸付有価証券 17,200株(17,200株)
9760	進学会ホールディングス	4,700	565.00	2,655,500	
9765	オオバ	8,100	598.00	4,843,800	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
9768	いであ	2,100	989.00	2,076,900	
9769	学究社	3,400	1,357.00	4,613,800	
9783	ベネッセホールディングス	37,600	2,873.00	108,024,800	貸付有価証券 19,300株(19,300株)
9787	イオンディライト	12,700	4,055.00	51,498,500	
9788	ナック	6,500	1,091.00	7,091,500	

9792	ニチイ学館	14,600	1,291.00	18,848,600	
9793	ダイセキ	17,200	2,623.00	45,115,600	貸付有価証券 8,500株（8,500株）
9795	ステップ	3,800	1,441.00	5,475,800	
合計		125,044,100		243,354,142,420	

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

## (2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

## 外国株式インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

[平成31年 3月25日現在]

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	12,425,810,355
コール・ローン	1,018,362,209
株式	334,289,412,086
投資証券	8,906,535,434
派生商品評価勘定	17,772,788
未収入金	552,525
未収配当金	677,668,162
差入委託証拠金	3,685,341,061
流動資産合計	361,021,454,620
資産合計	361,021,454,620
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	149,457,001
未払金	49,770,542
未払解約金	776,354,543
未払利息	1,744
流動負債合計	975,583,830
負債合計	975,583,830
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	132,770,502,287
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	227,275,368,503
元本等合計	360,045,870,790

[平成31年 3月25日現在]

純資産合計	360,045,870,790
負債純資産合計	361,021,454,620

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[平成31年 3月25日現在]
1. 期首	平成30年 3月27日
期首元本額	139,129,072,725円
期中追加設定元本額	102,951,517,104円
期中一部解約元本額	109,310,087,542円
元本の内訳	
ファンド・マネジャー（海外株式）	88,851,862円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,276,707,188円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,309,497,250円
eMAXIS バランス（波乗り型）	440,039,366円
コアバランス	163,450円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	10,101,149円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	17,721,990円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	14,776,620円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	13,955,593,817円
海外株式セレクション（ラップ向け）	1,583,111,459円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	1,036,397,285円
つみたて先進国株式	1,206,348,644円
つみたて8資産均等バランス	322,260,137円
つみたて4資産均等バランス	80,247,898円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,065,056円

	[平成31年 3月25日現在]
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,530,588円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	1,736,495円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	2,317,586円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	2,067,966円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	1,999,091円
eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本)	1,514,869,926円
eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)	111,578,559円
eMAXIS Slim 全世界株式(オール・カンントリー)	677,126,832円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	863,912円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	12,824,250,908円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,603,424,576円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	543,724,188円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	900,700,306円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	281,773,860円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	112,767,104円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	503,142,396円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	138,299,973円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	31,491,508円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	48,899,625円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	193,835,515円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	144,439,645円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	373,171,068円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	42,565,661円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	9,910,038,143円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)	148,563,967円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	1,749,816,408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)	40,343,702,437円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定)	48,785,868円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	15,157,234円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,360,410,222円
MSCIコクサイインデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	3,164,848,615円
MUAM 全世界株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	8,995,270,446円
アドバンスト・バランス (FOFs用)(適格機関投資家限定)	35,788,492円
アドバンスト・バランス (FOFs用)(適格機関投資家限定)	215,138,891円

	[平成31年 3月25日現在]
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）	708,206,142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）	285,149,938円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	459,299,398円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	39,690,347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）	17,058,718円
MUKAM 外国株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	1,419,354,411円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,397,777,585円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	1,447,218円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	5,996,715円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	7,087,682円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	6,869,417円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	54,854,021円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	13,619,944円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	93,572,860円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	19,236,413円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	120,097,206円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	4,738,761,160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）	162,932,689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）	641,204,519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）	627,109,802円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	564,194,920円
合計	132,770,502,287円
2. 受益権の総数	132,770,502,287口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成30年 3月27日 至 平成31年 3月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

区分	自 平成30年 3月27日 至 平成31年 3月25日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[ 平成31年 3月25日現在 ]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品            上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[平成31年 3月25日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	
株式	37,810,918	
投資証券	808,338,396	
合計	846,149,314	

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[平成31年 3月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	17,226,550,520		17,096,178,357	130,372,163
合計		17,226,550,520		17,096,178,357	130,372,163

(注)時価の算定方法

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

通貨関連

[平成31年 3月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	352,959,360		351,664,000	1,295,360
	カナダドル	24,538,080		24,537,000	1,080
	オーストラリアドル	19,430,750		19,427,500	3,250
	イギリスポンド	28,994,800		28,994,000	800
	スイスフラン	27,634,250		27,632,500	1,750
	スウェーデンクローネ	10,064,340		10,064,000	340
	ノルウェークローネ	10,263,520		10,256,000	7,520
ユーロ	80,660,450		80,658,500	1,950	
合計		554,545,550		553,233,500	1,312,050

## （注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	[平成31年 3月25日現在]
1口当たり純資産額	2.7118円
(1万口当たり純資産額)	(27,118円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

（単位：円）

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	44,374	43.23	1,918,288.02	
	APACHE CORP	33,815	34.82	1,177,438.30	
	BAKER HUGHES A GE CO	43,022	27.16	1,168,477.52	
	CABOT OIL & GAS CORP	38,740	25.96	1,005,690.40	
	CHENIERE ENERGY INC	19,128	67.60	1,293,052.80	
	CHEVRON CORP	164,433	123.09	20,240,057.97	
	CIMAREX ENERGY CO	8,343	67.90	566,489.70	
	CONCHO RESOURCES INC	17,420	104.51	1,820,564.20	
	CONOCOPHILLIPS	98,627	66.07	6,516,285.89	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	9,070	42.38	384,386.60	
	DEVON ENERGY CORP	40,521	30.34	1,229,407.14	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,833	101.37	1,402,251.21	

EOG RESOURCES INC	49,703	93.68	4,656,177.04
EXXON MOBIL CORP	364,338	80.48	29,321,922.24
HALLIBURTON CO	76,303	28.73	2,192,185.19
HELMERICH & PAYNE	8,879	54.48	483,727.92
HESS CORP	23,174	58.75	1,361,472.50
HOLLYFRONTIER CORP	13,550	50.61	685,765.50
KINDER MORGAN INC	173,105	19.90	3,444,789.50
MARATHON OIL CORP	69,984	16.68	1,167,333.12
MARATHON PETROLEUM CORP	59,690	61.30	3,658,997.00
NATIONAL OILWELL VARCO INC	32,566	26.63	867,232.58
NOBLE ENERGY INC	41,322	23.97	990,488.34
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	65,625	65.24	4,281,375.00
ONEOK INC	35,186	69.01	2,428,185.86
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,325	18.26	371,134.50
PHILLIPS 66	38,120	95.98	3,658,757.60
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,697	140.56	2,065,810.32
SCHLUMBERGER LTD	119,551	42.47	5,077,330.97
TARGA RESOURCES CORP	18,732	40.73	762,954.36
TECHNIPFMC PLC	36,699	22.66	831,599.34
VALERO ENERGY CORP	36,179	84.63	3,061,828.77
WILLIAMS COS INC	104,337	28.47	2,970,474.39
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	18,966	186.30	3,533,365.80
ALBEMARLE CORP	8,903	82.72	736,456.16
AVERY DENNISON CORP	7,313	108.99	797,043.87
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	19,585	24.88	487,274.80
BALL CORP	27,347	57.94	1,584,485.18
CELANESE CORP	11,351	98.14	1,113,987.14
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,934	39.01	777,625.34
CHEMOURS CO/THE	13,587	38.30	520,382.10
CROWN HOLDINGS INC	12,482	54.05	674,652.10
DOWDUPONT INC	197,405	53.92	10,644,077.60
EASTMAN CHEMICAL CO	12,630	75.14	949,018.20
ECOLAB INC	22,385	173.38	3,881,111.30
FMC CORP	12,179	74.98	913,181.42
FREEMPORT-MCMORAN INC	121,754	12.18	1,482,963.72
INTERNATIONAL PAPER CO	32,230	44.40	1,431,012.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,564	124.69	943,155.16
LINDE PLC	47,374	169.86	8,046,947.64
LYONDELLBASELL INDU-CL A	28,167	85.07	2,396,166.69
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,489	192.11	1,054,491.79
MOSAIC CO/THE	30,975	26.85	831,678.75
NEWMONT MINING CORP	46,546	34.50	1,605,837.00

NUCOR CORP	27,779	57.00	1,583,403.00
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,676	95.13	730,217.88
PPG INDUSTRIES INC	20,891	106.69	2,228,860.79
SEALED AIR CORP	13,562	45.04	610,832.48
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,341	420.72	3,088,505.52
STEEL DYNAMICS INC	20,151	33.97	684,529.47
VULCAN MATERIALS CO	11,023	113.45	1,250,559.35
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,087	66.08	203,988.96
WESTROCK CO	21,765	36.75	799,863.75
3M CO	50,079	204.66	10,249,168.14
ACUITY BRANDS INC	3,210	118.95	381,829.50
AERCAP HOLDINGS NV	11,872	44.90	533,052.80
ALLEGION PLC	7,694	87.22	671,070.68
AMETEK INC	20,362	79.41	1,616,946.42
ARCONIC INC	37,740	18.72	706,492.80
BOEING CO/THE	46,425	362.17	16,813,742.25
CATERPILLAR INC	50,780	129.77	6,589,720.60
CUMMINS INC	13,300	155.63	2,069,879.00
DEERE & CO	26,301	155.94	4,101,377.94
DOVER CORP	12,927	90.30	1,167,308.10
EATON CORP PLC	37,718	79.02	2,980,476.36
EMERSON ELECTRIC CO	54,194	66.86	3,623,410.84
FASTENAL CO	24,519	61.70	1,512,822.30
FLOWSERVE CORP	12,340	43.51	536,913.40
FLUOR CORP	11,662	35.59	415,050.58
FORTIVE CORP	25,701	82.23	2,113,393.23
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	12,083	45.01	543,855.83
GENERAL DYNAMICS CORP	21,714	165.85	3,601,266.90
GENERAL ELECTRIC CO	748,393	9.98	7,468,962.14
HARRIS CORP	9,814	159.28	1,563,173.92
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,525	41.71	647,547.75
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	63,642	155.83	9,917,332.86
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3,912	203.13	794,644.56
IDEX CORP	6,420	147.93	949,710.60
ILLINOIS TOOL WORKS	25,367	141.65	3,593,235.55
INGERSOLL-RAND PLC	20,932	104.23	2,181,742.36
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,986	73.07	802,747.02
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	19,100	64.15	1,225,265.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	18,100	37.86	685,266.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	79,428	36.13	2,869,733.64
L3 TECHNOLOGIES INC	6,750	205.30	1,385,775.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,070	257.13	789,389.10

LOCKHEED MARTIN CORP	22,014	294.01	6,472,336.14
MASCO CORP	25,772	38.25	985,779.00
MIDDLEBY CORP	4,709	126.05	593,569.45
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,226	268.36	3,817,689.36
OWENS CORNING	10,287	46.28	476,082.36
PACCAR INC	30,100	67.03	2,017,603.00
PARKER HANNIFIN CORP	11,374	163.39	1,858,397.86
PENTAIR PLC	14,686	42.26	620,630.36
RAYTHEON COMPANY	24,462	179.99	4,402,915.38
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,253	169.93	1,742,292.29
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,746	329.47	2,881,544.62
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	14,145	45.70	646,426.50
SMITH (A.O.) CORP	11,803	51.74	610,687.22
SNAP-ON INC	4,806	149.96	720,707.76
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	9,358	89.40	836,605.20
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,318	130.90	1,743,326.20
TEXTRON INC	21,691	49.97	1,083,899.27
TRANSDIGM GROUP INC	4,113	444.71	1,829,092.23
UNITED RENTALS INC	7,024	110.96	779,383.04
UNITED TECHNOLOGIES CORP	70,499	125.15	8,822,949.85
WABCO HOLDINGS INC	4,664	143.36	668,631.04
WABTEC CORP	11,887	70.05	832,684.35
WW GRAINGER INC	4,155	292.51	1,215,379.05
XYLEM INC	15,845	77.06	1,221,015.70
CINTAS CORP	7,966	194.55	1,549,785.30
COPART INC	17,867	59.25	1,058,619.75
COSTAR GROUP INC	3,062	465.08	1,424,074.96
EQUIFAX INC	10,163	112.88	1,147,199.44
IHS MARKIT LTD	33,746	54.54	1,840,506.84
MANPOWERGROUP INC	5,311	80.75	428,863.25
NIELSEN HOLDINGS PLC	30,106	26.86	808,647.16
REPUBLIC SERVICES INC	18,926	78.90	1,493,261.40
ROBERT HALF INTL INC	10,058	63.73	640,996.34
ROLLINS INC	13,438	40.38	542,626.44
TRANSUNION	16,097	65.41	1,052,904.77
VERISK ANALYTICS INC	13,444	128.89	1,732,797.16
WASTE CONNECTIONS INC	22,663	85.34	1,934,060.42
WASTE MANAGEMENT INC	36,930	101.90	3,763,167.00
AMERCO	657	359.00	235,863.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,768	30.57	298,607.76
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,769	84.68	996,598.92
CSX CORP	68,978	72.51	5,001,594.78

DELTA AIR LINES INC	14,988	49.76	745,802.88
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,585	74.12	1,081,040.20
FEDEX CORP	21,641	173.99	3,765,317.59
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,468	97.54	728,428.72
KANSAS CITY SOUTHERN	8,569	112.46	963,669.74
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,111	31.37	317,182.07
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,479	177.94	4,177,853.26
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,220	142.72	744,998.40
RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR	2,000	71.46	142,920.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	12,959	49.32	639,137.88
UNION PACIFIC CORP	63,372	160.62	10,178,810.64
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	5,859	79.63	466,552.17
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	59,785	107.35	6,417,919.75
XPO LOGISTICS INC	11,475	49.46	567,553.50
APTIV PLC	22,988	77.61	1,784,098.68
AUTOLIV INC	6,972	73.93	515,439.96
BORGWARNER INC	17,531	36.24	635,323.44
FORD MOTOR CO	319,982	8.54	2,732,646.28
GENERAL MOTORS CO	109,430	36.44	3,987,629.20
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	19,139	17.40	333,018.60
HARLEY-DAVIDSON INC	13,910	33.84	470,714.40
LEAR CORP	5,774	132.12	762,860.88
TESLA INC	11,178	264.53	2,956,916.34
CAPRI HOLDINGS LTD	13,465	43.70	588,420.50
DR HORTON INC	29,934	40.93	1,225,198.62
GARMIN LTD	9,485	83.58	792,756.30
HANESBRANDS INC	31,400	16.92	531,288.00
HASBRO INC	10,186	83.51	850,632.86
LEGGETT & PLATT INC	11,829	40.77	482,268.33
LENNAR CORP-A	24,203	47.84	1,157,871.52
LULULEMON ATHLETICA INC	8,431	143.21	1,207,403.51
MATTEL INC	31,264	13.21	412,997.44
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,539	124.86	691,599.54
NEWELL BRANDS INC	37,442	15.00	561,630.00
NIKE INC -CL B	109,550	82.19	9,003,914.50
NVR INC	287	2,780.91	798,121.17
POLARIS INDUSTRIES INC	5,484	79.58	436,416.72
PULTEGROUP INC	22,982	26.58	610,861.56
PVH CORP	6,275	107.21	672,742.75
RALPH LAUREN CORP	4,891	120.23	588,044.93
TAPESTRY INC	24,591	30.93	760,599.63
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	13,777	20.72	285,459.44

UNDER ARMOUR INC-CLASS C	17,239	18.41	317,369.99
VF CORP	29,266	83.72	2,450,149.52
WHIRLPOOL CORP	5,647	129.04	728,688.88
ARAMARK	20,664	28.91	597,396.24
CARNIVAL CORP	36,343	56.42	2,050,472.06
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,087	671.46	1,401,337.02
DARDEN RESTAURANTS INC	10,355	117.44	1,216,091.20
DOMINO'S PIZZA INC	3,599	239.25	861,060.75
H&R BLOCK INC	18,342	24.13	442,592.46
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	24,330	84.57	2,057,588.10
LAS VEGAS SANDS CORP	33,873	59.57	2,017,814.61
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	24,943	124.50	3,105,403.50
MCDONALD'S CORP	66,334	186.81	12,391,854.54
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	22,377	21.62	483,790.74
MGM RESORTS INTERNATIONAL	42,520	26.09	1,109,346.80
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	18,122	55.62	1,007,945.64
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,696	115.58	1,698,563.68
STARBUCKS CORP	106,772	71.96	7,683,313.12
VAIL RESORTS INC	3,680	211.79	779,387.20
WYNN RESORTS LTD	8,302	116.91	970,586.82
YUM! BRANDS INC	26,912	98.97	2,663,480.64
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,601	46.87	2,887,238.87
ALPHABET INC-CL A	25,729	1,207.65	31,071,626.85
ALPHABET INC-CL C	27,071	1,205.50	32,634,090.50
ALTICE USA INC- A	27,650	21.37	590,880.50
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	28,020	45.06	1,262,581.20
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,855	360.78	4,998,606.90
COMCAST CORP-CLASS A	390,539	39.46	15,410,668.94
DISCOVERY INC - A	12,579	26.67	335,481.93
DISCOVERY INC-C	26,507	25.45	674,603.15
DISH NETWORK CORP-A	21,121	31.27	660,453.67
ELECTRONIC ARTS INC	25,994	102.34	2,660,225.96
FACEBOOK INC-CLASS A	206,731	164.34	33,974,172.54
FOX CORP - CLASS A	29,936	38.72	1,159,121.92
FOX CORP- CLASS B	11,981	37.46	448,808.26
IAC/INTERACTIVECORP	6,913	219.57	1,517,887.41
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	31,846	21.13	672,905.98
LIBERTY BROADBAND-C	8,866	92.81	822,853.46
LIBERTY GLOBAL PLC- C	42,571	25.36	1,079,600.56
LIBERTY GLOBAL PLC-A	18,163	26.03	472,782.89
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	7,102	38.82	275,699.64
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	15,261	39.02	595,484.22

LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	16,786	34.14	573,074.04
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	13,374	62.95	841,893.30
NETFLIX INC	37,528	361.01	13,547,983.28
NEWS CORP - CLASS A	35,571	12.63	449,261.73
OMNICOM GROUP	19,659	73.07	1,436,483.13
SIRIUS XM HOLDINGS INC	147,233	5.76	848,062.08
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,367	96.02	899,419.34
TRIPADVISOR INC	9,995	50.75	507,246.25
TWITTER INC	57,625	33.02	1,902,777.50
VIACOM INC-CLASS B	30,124	25.34	763,342.16
WALT DISNEY CO/THE	169,870	108.23	18,385,030.10
ZILLOW GROUP INC - C	9,580	35.71	342,101.80
ADVANCE AUTO PARTS INC	6,244	164.84	1,029,260.96
AMAZON.COM INC	35,766	1,764.77	63,118,763.82
AUTOZONE INC	2,169	981.27	2,128,374.63
BEST BUY CO INC	20,839	70.11	1,461,022.29
BOOKING HOLDINGS INC	3,986	1,721.59	6,862,257.74
BURLINGTON STORES INC	6,076	145.99	887,035.24
CARMAX INC	14,978	61.63	923,094.14
DOLLAR GENERAL CORP	22,500	117.47	2,643,075.00
DOLLAR TREE INC	20,460	101.43	2,075,257.80
EBAY INC	79,700	36.65	2,921,005.00
EXPEDIA GROUP INC	10,831	121.64	1,317,482.84
GAP INC/THE	19,267	24.52	472,426.84
GENUINE PARTS CO	12,658	107.48	1,360,481.84
GRUBHUB INC	8,422	68.59	577,664.98
HOME DEPOT INC	97,175	188.75	18,341,781.25
KOHL'S CORP	14,104	67.03	945,391.12
L BRANDS INC	20,700	26.67	552,069.00
LKQ CORP	25,950	28.36	735,942.00
LOWE'S COS INC	69,339	104.95	7,277,128.05
MACY'S INC	26,297	23.31	612,983.07
MERCADOLIBRE INC	3,674	497.37	1,827,337.38
NORDSTROM INC	9,614	42.93	412,729.02
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,844	376.30	2,575,397.20
QURATE RETAIL INC	35,552	17.02	605,095.04
ROSS STORES INC	31,805	89.53	2,847,501.65
TARGET CORP	42,231	78.32	3,307,531.92
TIFFANY & CO	9,653	103.21	996,286.13
TJX COMPANIES INC	106,412	52.34	5,569,604.08
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10,349	92.68	959,145.32
ULTA BEAUTY INC	4,996	330.52	1,651,277.92

WAYFAIR INC- CLASS A	5,110	158.50	809,935.00
COSTCO WHOLESALE CORP	37,680	237.56	8,951,260.80
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	27,000	7.91	213,570.00
KROGER CO	69,612	24.34	1,694,356.08
SYSCO CORP	41,789	65.56	2,739,686.84
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	69,355	62.41	4,328,445.55
WALMART INC	124,911	98.28	12,276,253.08
ALTRIA GROUP INC	161,616	55.92	9,037,566.72
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,890	42.62	2,041,071.80
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,312	51.74	1,154,422.88
BUNGE LTD	12,099	51.70	625,518.30
CAMPBELL SOUP CO	14,637	38.24	559,718.88
COCA-COLA CO/THE	347,791	45.93	15,974,040.63
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	18,943	49.42	936,163.06
CONAGRA BRANDS INC	42,264	26.45	1,117,882.80
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,424	169.53	2,445,300.72
GENERAL MILLS INC	51,780	50.74	2,627,317.20
HERSHEY CO/THE	12,479	112.00	1,397,648.00
HORMEL FOODS CORP	24,534	43.59	1,069,437.06
INGREDION INC	6,169	94.01	579,947.69
JM SMUCKER CO/THE	10,083	114.30	1,152,486.90
KELLOGG CO	21,585	56.74	1,224,732.90
KRAFT HEINZ CO/THE	53,245	32.29	1,719,281.05
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,894	71.66	923,984.04
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,408	142.37	1,481,786.96
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,747	59.45	936,159.15
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	124,978	49.13	6,140,169.14
MONSTER BEVERAGE CORP	35,833	53.51	1,917,423.83
PEPSICO INC	121,399	120.72	14,655,287.28
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	133,749	91.17	12,193,896.33
TYSON FOODS INC-CL A	25,675	66.61	1,710,211.75
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,621	67.10	1,450,769.10
CLOROX COMPANY	11,095	158.13	1,754,452.35
COLGATE-PALMOLIVE CO	70,801	66.00	4,672,866.00
COTY INC-CL A	40,836	11.22	458,179.92
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	18,962	159.50	3,024,439.00
KIMBERLY-CLARK CORP	30,075	122.05	3,670,653.75
PROCTER & GAMBLE CO/THE	214,237	101.66	21,779,333.42
ABBOTT LABORATORIES	151,072	77.97	11,779,083.84
ABIOMED INC	3,806	323.21	1,230,137.26
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,524	269.62	1,759,000.88
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,797	78.77	1,086,789.69

ANTHEM INC	22,249	301.51	6,708,295.99
BAXTER INTERNATIONAL INC	42,864	77.24	3,310,815.36
BECTON DICKINSON AND CO	23,059	240.12	5,536,927.08
BOSTON SCIENTIFIC CORP	119,001	37.30	4,438,737.30
CARDINAL HEALTH INC	25,673	48.64	1,248,734.72
CENTENE CORP	35,831	57.14	2,047,383.34
CERNER CORP	25,955	56.96	1,478,396.80
CIGNA CORP	32,715	166.09	5,433,634.35
COOPER COS INC/THE	4,384	291.76	1,279,075.84
CVS HEALTH CORP	111,245	56.04	6,234,169.80
DANAHER CORP	54,227	129.69	7,032,699.63
DAVITA INC	11,882	54.05	642,222.10
DENTSPLY SIRONA INC	18,574	49.24	914,583.76
DEXCOM INC	7,633	129.03	984,885.99
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	18,244	188.99	3,447,933.56
HCA HEALTHCARE INC	24,068	134.44	3,235,701.92
HENRY SCHEIN INC	12,952	59.80	774,529.60
HOLOGIC INC	24,927	46.85	1,167,829.95
HUMANA INC	11,932	272.60	3,252,663.20
IDEXX LABORATORIES INC	7,574	219.43	1,661,962.82
INTUITIVE SURGICAL INC	9,825	561.26	5,514,379.50
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,538	154.32	1,317,584.16
MCKESSON CORP	17,194	118.54	2,038,176.76
MEDTRONIC PLC	115,480	90.39	10,438,237.20
QUEST DIAGNOSTICS INC	11,944	89.24	1,065,882.56
RESMED INC	12,701	100.14	1,271,878.14
STRYKER CORP	28,953	194.44	5,629,621.32
TELEFLEX INC	3,951	301.69	1,191,977.19
UNITEDHEALTH GROUP INC	82,761	247.09	20,449,415.49
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,356	135.31	995,340.36
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,519	138.59	1,042,058.21
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	10,742	123.12	1,322,555.04
WELLCARE HEALTH PLANS INC	4,287	241.84	1,036,768.08
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,879	126.68	2,264,911.72
ABBVIE INC	129,453	79.76	10,325,171.28
AGILENT TECHNOLOGIES INC	27,413	78.99	2,165,352.87
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,371	130.21	2,522,297.91
ALKERMES PLC	12,980	33.96	440,800.80
ALLERGAN PLC	29,147	149.30	4,351,647.10
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,161	84.52	689,767.72
AMGEN INC	54,837	186.70	10,238,067.90
BEIGENE LTD-ADR	2,558	124.46	318,368.68

BIOGEN INC	17,340	216.71	3,757,751.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	15,275	88.05	1,344,963.75
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	140,370	48.16	6,760,219.20
CELGENE CORP	60,183	88.15	5,305,131.45
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	23,060	32.72	754,523.20
ELI LILLY & CO	76,871	128.30	9,862,549.30
GILEAD SCIENCES INC	111,322	63.77	7,099,003.94
ILLUMINA INC	12,680	308.79	3,915,457.20
INCYTE CORP	15,984	85.34	1,364,074.56
IQVIA HOLDINGS INC	13,765	141.65	1,949,812.25
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,035	136.60	687,781.00
JOHNSON & JOHNSON	230,735	136.91	31,589,928.85
MERCK & CO. INC.	223,703	82.29	18,408,519.87
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,183	702.07	1,532,618.81
MYLAN NV	44,457	28.69	1,275,471.33
NEKTAR THERAPEUTICS	15,595	32.17	501,691.15
PERRIGO CO PLC	10,460	47.25	494,235.00
PFIZER INC	497,280	41.85	20,811,168.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,783	391.80	2,657,579.40
SEATTLE GENETICS INC	9,288	73.99	687,219.12
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	85,275	16.33	1,392,540.75
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	34,629	263.81	9,135,476.49
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,166	120.80	503,252.80
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,996	181.53	3,992,933.88
WATERS CORP	6,378	245.37	1,564,969.86
ZOETIS INC	41,520	97.93	4,066,053.60
BANK OF AMERICA CORP	802,303	27.01	21,670,204.03
BB&T CORP	67,018	45.09	3,021,841.62
CIT GROUP INC	9,372	46.12	432,236.64
CITIGROUP INC	210,191	60.98	12,817,447.18
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,777	31.77	1,263,715.29
COMERICA INC	13,971	72.07	1,006,889.97
EAST WEST BANCORP INC	11,889	46.63	554,384.07
FIFTH THIRD BANCORP	65,903	24.62	1,622,531.86
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,415	98.10	1,414,111.50
HUNTINGTON BANCSHARES INC	92,782	12.25	1,136,579.50
JPMORGAN CHASE & CO	286,135	99.76	28,544,827.60
KEYCORP	87,480	14.97	1,309,575.60
M & T BANK CORP	11,235	153.79	1,727,830.65
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	32,704	15.89	519,666.56
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39,694	119.18	4,730,730.92
REGIONS FINANCIAL CORP	86,818	13.53	1,174,647.54

SIGNATURE BANK	4,475	126.10	564,297.50
SUNTRUST BANKS INC	39,131	57.40	2,246,119.40
SVB FINANCIAL GROUP	4,649	212.19	986,471.31
US BANCORP	132,031	48.28	6,374,456.68
WELLS FARGO & CO	384,755	48.31	18,587,514.05
ZIONS BANCORP NA	16,637	43.64	726,038.68
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,850	99.16	480,926.00
ALLY FINANCIAL INC	36,686	26.07	956,404.02
AMERICAN EXPRESS CO	62,521	109.46	6,843,548.66
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,899	124.13	1,477,022.87
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	18,600	19.72	366,792.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	85,462	50.50	4,315,831.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	111,405	200.55	22,342,272.75
BLACKROCK INC	10,243	417.36	4,275,018.48
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	40,326	80.00	3,226,080.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,355	95.44	892,841.20
CME GROUP INC	30,790	163.32	5,028,622.80
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,518	70.35	2,076,591.30
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,199	45.02	954,378.98
EATON VANCE CORP	10,791	39.76	429,050.16
FRANKLIN RESOURCES INC	26,923	32.10	864,228.30
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,831	188.96	5,447,905.76
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	49,443	72.76	3,597,472.68
INVESCO LTD	33,181	19.06	632,429.86
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,624	18.47	473,275.28
KKR & CO INC -A	40,778	23.66	964,807.48
MOODY'S CORP	14,729	177.89	2,620,141.81
MORGAN STANLEY	111,136	41.72	4,636,593.92
MSCI INC	7,709	191.86	1,479,048.74
NASDAQ INC	9,700	83.89	813,733.00
NORTHERN TRUST CORP	18,466	88.59	1,635,902.94
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,668	76.76	818,875.68
S&P GLOBAL INC	21,610	205.49	4,440,638.90
SCHWAB (CHARLES) CORP	104,613	41.80	4,372,823.40
SEI INVESTMENTS COMPANY	11,604	50.36	584,377.44
STATE STREET CORP	32,400	65.00	2,106,000.00
SYNCHRONY FINANCIAL	54,508	31.83	1,734,989.64
T ROWE PRICE GROUP INC	20,494	98.76	2,023,987.44
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,546	49.70	1,170,236.20
VOYA FINANCIAL INC	13,039	48.32	630,044.48
AFLAC INC	64,734	49.46	3,201,743.64
ALLEGHANY CORP	1,277	613.68	783,669.36

ALLSTATE CORP	29,296	94.17	2,758,804.32
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,954	94.71	658,613.34
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	77,185	42.62	3,289,624.70
AON PLC	20,987	166.31	3,490,347.97
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,531	32.06	1,107,063.86
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,113	78.88	1,270,993.44
ASSURANT INC	4,061	94.56	384,008.16
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	14,528	41.13	597,536.64
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	9,073	35.54	322,454.42
CHUBB LTD	39,607	136.62	5,411,108.34
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,956	84.64	1,096,595.84
EVEREST RE GROUP LTD	3,429	214.99	737,200.71
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	24,261	36.53	886,254.33
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	31,461	48.53	1,526,802.33
LINCOLN NATIONAL CORP	17,714	57.68	1,021,743.52
LOEWS CORP	22,852	47.33	1,081,585.16
MARKEL CORP	1,224	984.51	1,205,040.24
MARSH & MCLENNAN COS	43,401	92.07	3,995,930.07
METLIFE INC	71,385	41.79	2,983,179.15
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25,129	49.45	1,242,629.05
PROGRESSIVE CORP	50,340	72.78	3,663,745.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	35,550	89.96	3,198,078.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,414	141.80	767,705.20
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,165	143.31	453,576.15
TORCHMARK CORP	9,321	80.31	748,569.51
TRAVELERS COS INC/THE	22,767	134.90	3,071,268.30
UNUM GROUP	19,313	33.37	644,474.81
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,280	174.61	1,969,600.80
WR BERKLEY CORP	8,996	83.53	751,435.88
CBRE GROUP INC - A	27,801	48.25	1,341,398.25
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	94,100	7.25	682,225.00
JONES LANG LASALLE INC	3,625	148.20	537,225.00
SBA COMMUNICATIONS CORP	9,940	197.12	1,959,372.80
ACCENTURE PLC-CL A	54,892	165.24	9,070,354.08
ADOBE INC	42,004	259.69	10,908,018.76
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	14,312	71.23	1,019,443.76
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,324	164.56	711,557.44
ANSYS INC	7,252	177.18	1,284,909.36
AUTODESK INC	18,828	154.22	2,903,654.16
AUTOMATIC DATA PROCESSING	37,656	153.81	5,791,869.36
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	9,612	100.37	964,756.44
CADENCE DESIGN SYS INC	24,172	61.76	1,492,862.72

CDK GLOBAL INC	10,924	56.23	614,256.52
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,512	125.43	1,318,520.16
CITRIX SYSTEMS INC	11,297	100.46	1,134,896.62
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	50,078	70.89	3,550,029.42
DXC TECHNOLOGY CO	24,683	64.34	1,588,104.22
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	27,787	110.41	3,067,962.67
FIRST DATA CORP- CLASS A	46,602	25.38	1,182,758.76
FISERV INC	34,592	85.58	2,960,383.36
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,690	237.46	1,826,067.40
FORTINET INC	12,219	85.19	1,040,936.61
GARTNER INC	7,715	145.91	1,125,695.65
GLOBAL PAYMENTS INC	13,840	134.00	1,854,560.00
GODADDY INC - CLASS A	15,461	74.99	1,159,420.39
INTL BUSINESS MACHINES CORP	78,187	139.45	10,903,177.15
INTUIT INC	21,219	252.68	5,361,616.92
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,674	135.77	906,128.98
LEIDOS HOLDINGS INC	12,335	62.99	776,981.65
MASTERCARD INC - A	79,056	230.76	18,242,962.56
MICROSOFT CORP	627,517	117.05	73,450,864.85
ORACLE CORP	228,162	52.77	12,040,108.74
PALO ALTO NETWORKS INC	8,363	242.36	2,026,856.68
PAYCHEX INC	27,545	78.44	2,160,629.80
PAYPAL HOLDINGS INC	96,329	101.27	9,755,237.83
PTC INC	9,853	93.12	917,511.36
RED HAT INC	15,210	181.70	2,763,657.00
SABRE CORP	22,958	21.03	482,806.74
SALESFORCE.COM INC	65,829	161.50	10,631,383.50
SERVICENOW INC	15,458	241.21	3,728,624.18
SPLUNK INC	12,660	125.68	1,591,108.80
SQUARE INC - A	26,385	75.09	1,981,249.65
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,701	62.14	1,224,220.14
SYMANTEC CORP	53,730	22.86	1,228,267.80
SYNOPSYS INC	13,232	110.31	1,459,621.92
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	5,991	127.85	765,949.35
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	14,451	93.33	1,348,711.83
VERISIGN INC	9,148	181.67	1,661,917.16
VISA INC-CLASS A SHARES	151,402	153.07	23,175,104.14
VMWARE INC-CLASS A	6,910	183.70	1,269,367.00
WESTERN UNION CO	38,397	18.25	700,745.25
WIX.COM LTD	3,400	117.98	401,132.00
WORKDAY INC-CLASS A	13,030	191.08	2,489,772.40
WORLDPAY INC-CLASS A	25,971	110.39	2,866,938.69

AMPHENOL CORP-CL A	25,629	94.54	2,422,965.66
APPLE INC	408,366	191.05	78,018,324.30
ARISTA NETWORKS INC	4,665	300.16	1,400,246.40
ARROW ELECTRONICS INC	7,788	76.66	597,028.08
CDW CORP/DE	12,702	95.87	1,217,740.74
CISCO SYSTEMS INC	387,082	52.74	20,414,704.68
COGNEX CORP	15,243	50.10	763,674.30
COMMSCOPE HOLDING CO INC	16,514	21.24	350,757.36
CORNING INC	69,756	33.83	2,359,845.48
DELL TECHNOLOGIES -C	12,956	59.55	771,529.80
F5 NETWORKS INC	5,179	152.24	788,450.96
FLEX LTD	43,666	10.19	444,956.54
FLIR SYSTEMS INC	12,376	47.54	588,355.04
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	123,970	15.29	1,895,501.30
HP INC	138,532	19.34	2,679,208.88
IPG PHOTONICS CORP	3,076	144.77	445,312.52
JUNIPER NETWORKS INC	30,548	26.32	804,023.36
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	16,213	84.76	1,374,213.88
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,976	138.64	1,937,632.64
NETAPP INC	22,078	66.84	1,475,693.52
SEAGATE TECHNOLOGY	23,082	46.93	1,083,238.26
TE CONNECTIVITY LTD	29,737	81.69	2,429,215.53
TRIMBLE INC	21,386	39.43	843,249.98
WESTERN DIGITAL CORP	24,875	48.39	1,203,701.25
XEROX CORP	19,745	31.07	613,477.15
AT&T INC	626,242	31.07	19,457,338.94
CENTURYLINK INC	80,155	12.17	975,486.35
SPRINT CORP	72,427	6.25	452,668.75
T-MOBILE US INC	29,022	71.90	2,086,681.80
VERIZON COMMUNICATIONS INC	355,561	59.76	21,248,325.36
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	17,058	28.29	482,570.82
AES CORP	58,414	18.06	1,054,956.84
ALLIANT ENERGY CORP	20,844	47.55	991,132.20
AMEREN CORPORATION	21,184	73.75	1,562,320.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	42,812	85.14	3,645,013.68
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,521	106.78	1,657,332.38
ATMOS ENERGY CORP	10,615	102.81	1,091,328.15
CENTERPOINT ENERGY INC	44,401	30.72	1,363,998.72
CMS ENERGY CORP	23,897	55.64	1,329,629.08
CONSOLIDATED EDISON INC	27,471	84.91	2,332,562.61
DOMINION ENERGY INC	64,757	75.52	4,890,448.64
DTE ENERGY COMPANY	15,747	124.89	1,966,642.83

DUKE ENERGY CORP	61,412	90.70	5,570,068.40	
EDISON INTERNATIONAL	28,320	64.69	1,832,020.80	
ENERGY CORP	15,768	96.12	1,515,620.16	
EVERGY INC	23,606	58.00	1,369,148.00	
EVERSOURCE ENERGY	27,495	71.69	1,971,116.55	
EXELON CORP	83,435	50.28	4,195,111.80	
FIRSTENERGY CORP	43,422	41.77	1,813,736.94	
NEXTERA ENERGY INC	41,155	193.93	7,981,189.15	
NISOURCE INC	32,276	28.61	923,416.36	
NRG ENERGY INC	24,006	42.49	1,020,014.94	
OGE ENERGY CORP	17,982	43.11	775,204.02	
PINNACLE WEST CAPITAL	9,570	96.72	925,610.40	
PPL CORP	60,992	32.19	1,963,332.48	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	43,902	59.63	2,617,876.26	
SEMPRA ENERGY	23,288	126.07	2,935,918.16	
SOUTHERN CO/THE	88,675	51.88	4,600,459.00	
UGI CORP	15,681	55.69	873,274.89	
VISTRA ENERGY CORP	27,938	25.98	725,829.24	
WEC ENERGY GROUP INC	27,218	79.33	2,159,203.94	
XCEL ENERGY INC	44,506	57.07	2,539,957.42	
ADVANCED MICRO DEVICES	79,845	26.37	2,105,512.65	
ANALOG DEVICES INC	31,446	107.40	3,377,300.40	
APPLIED MATERIALS INC	85,403	39.86	3,404,163.58	
BROADCOM INC	35,603	292.65	10,419,217.95	
INTEL CORP	392,901	53.26	20,925,907.26	
KLA-TENCOR CORP	13,715	120.53	1,653,068.95	
LAM RESEARCH CORP	13,201	179.45	2,368,919.45	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	56,112	19.71	1,105,967.52	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,227	54.21	1,259,135.67	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,460	85.42	1,747,693.20	
MICRON TECHNOLOGY INC	97,814	41.62	4,071,018.68	
NVIDIA CORP	49,896	177.50	8,856,540.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	29,282	90.66	2,654,706.12	
ON SEMICONDUCTOR CORP	37,034	21.64	801,415.76	
QORVO INC	10,646	71.67	762,998.82	
QUALCOMM INC	104,420	56.82	5,933,144.40	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,883	82.59	1,229,186.97	
TEXAS INSTRUMENTS INC	82,784	109.68	9,079,749.12	
XILINX INC	22,006	126.89	2,792,341.34	
アメリカドル 小計	25,992,069		2,062,499,765.72 (226,689,349,250)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	25,100	9.52	238,952.00

CAMECO CORP	34,900	15.85	553,165.00
CANADIAN NATURAL RESOURCES	104,100	37.02	3,853,782.00
CENOVUS ENERGY INC	91,200	11.77	1,073,424.00
ENBRIDGE INC	174,100	49.17	8,560,497.00
ENCANA CORP	122,200	9.43	1,152,346.00
HUSKY ENERGY INC	26,678	13.59	362,554.02
IMPERIAL OIL LTD	23,300	36.43	848,819.00
INTER PIPELINE LTD	35,800	21.78	779,724.00
KEYERA CORP	17,500	31.14	544,950.00
PEMBINA PIPELINE CORP	43,232	49.61	2,144,739.52
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	21,088	18.54	390,971.52
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	22,800	10.63	242,364.00
SUNCOR ENERGY INC	139,200	45.19	6,290,448.00
TOURMALINE OIL CORP	20,800	21.35	444,080.00
TRANSCANADA CORP	79,200	60.67	4,805,064.00
VERMILION ENERGY INC	12,900	33.60	433,440.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	20,900	59.47	1,242,923.00
BARRICK GOLD CORP	150,700	18.36	2,766,852.00
CCL INDUSTRIES INC - CL B	12,400	52.96	656,704.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	63,600	14.10	896,760.00
FRANCO-NEVADA CORP	15,400	101.94	1,569,876.00
GOLDCORP INC	70,700	14.51	1,025,857.00
KINROSS GOLD CORP	110,200	4.68	515,736.00
LUNDIN MINING CORP	47,500	5.98	284,050.00
METHANEX CORP	5,500	77.50	426,250.00
NUTRIEN LTD	52,259	67.73	3,539,502.07
TECK RESOURCES LTD-CLS B	44,500	30.25	1,346,125.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	105,800	2.21	233,818.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,900	64.36	315,364.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	38,800	32.93	1,277,684.00
BOMBARDIER INC-B	174,600	2.72	474,912.00
CAE INC	23,200	29.57	686,024.00
FINNING INTERNATIONAL INC	16,200	23.03	373,086.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,300	34.56	459,648.00
WSP GLOBAL INC	8,300	72.27	599,841.00
THOMSON REUTERS CORP	18,132	77.69	1,408,675.08
CANADIAN NATL RAILWAY CO	62,600	116.20	7,274,120.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	12,400	269.11	3,336,964.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,300	63.70	1,739,010.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,600	49.01	862,576.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	19,910	85.25	1,697,327.50
STARS GROUP INC/THE	14,000	23.05	322,700.00

SHAW COMMUNICATIONS INC-B	42,100	27.71	1,166,591.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	5,200	142.47	740,844.00
DOLLARAMA INC	26,600	34.91	928,606.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	36,800	72.71	2,675,728.00
EMPIRE CO LTD 'A'	15,400	28.89	444,906.00
LOBLAW COMPANIES LTD	16,800	65.63	1,102,584.00
METRO INC	20,200	48.94	988,588.00
WESTON (GEORGE) LTD	6,711	95.25	639,222.75
SAPUTO INC	21,400	44.64	955,296.00
AURORA CANNABIS INC	62,100	12.10	751,410.00
BAUSCH HEALTH COS INC	28,700	33.18	952,266.00
CANOPY GROWTH CORP	17,700	59.54	1,053,858.00
BANK OF MONTREAL	55,100	100.74	5,550,774.00
BANK OF NOVA SCOTIA	105,600	71.39	7,538,784.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	38,500	109.28	4,207,280.00
NATIONAL BANK OF CANADA	29,800	61.34	1,827,932.00
ROYAL BANK OF CANADA	123,800	102.13	12,643,694.00
TORONTO-DOMINION BANK	157,500	74.00	11,655,000.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	73,600	61.63	4,535,968.00
CI FINANCIAL CORP	18,400	17.94	330,096.00
IGM FINANCIAL INC	7,800	33.72	263,016.00
ONEX CORPORATION	7,700	74.92	576,884.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,300	596.25	1,371,375.00
GREAT-WEST LIFECO INC	24,300	32.25	783,675.00
IA FINANCIAL CORP INC	10,100	49.39	498,839.00
INTACT FINANCIAL CORP	11,900	109.28	1,300,432.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	168,900	22.36	3,776,604.00
POWER CORP OF CANADA	32,600	30.93	1,008,318.00
POWER FINANCIAL CORP	19,900	31.21	621,079.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	52,400	50.32	2,636,768.00
FIRST CAPITAL REALTY INC	13,800	20.97	289,386.00
BLACKBERRY LTD	40,000	12.12	484,800.00
CGI INC	21,000	90.59	1,902,390.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,700	1,103.49	1,875,933.00
OPEN TEXT CORP	24,400	50.27	1,226,588.00
SHOPIFY INC - CLASS A	7,600	267.02	2,029,352.00
BCE INC	13,800	59.17	816,546.00
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	31,600	72.70	2,297,320.00
TELUS CORP	11,600	48.80	566,080.00
ALTAGAS LTD	22,300	17.87	398,501.00
ATCO LTD -CLASS I	7,600	45.45	345,420.00
CANADIAN UTILITIES LTD-A	12,100	36.46	441,166.00

	EMERA INC	5,400	49.98	269,892.00
	FORTIS INC	38,200	49.71	1,898,922.00
	HYDRO ONE LTD	28,500	20.55	585,675.00
	カナダドル 小計	3,664,310		157,006,093.46 (12,843,098,445)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	25,272	26.49	669,455.28
	OIL SEARCH LTD	127,654	8.27	1,055,698.58
	ORIGIN ENERGY LTD	157,296	7.56	1,189,157.76
	SANTOS LTD	151,359	7.19	1,088,271.21
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	9,200	28.93	266,156.00
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	81,047	35.80	2,901,482.60
	WORLEYPARSONS LTD	25,816	14.85	383,367.60
	ALUMINA LTD	225,269	2.61	587,952.09
	AMCOR LIMITED	103,552	15.19	1,572,954.88
	BHP GROUP LTD	254,342	37.61	9,565,802.62
	BLUESCOPE STEEL LTD	42,276	13.85	585,522.60
	BORAL LTD	94,778	4.59	435,031.02
	FORTECUE METALS GROUP LTD	140,288	6.59	924,497.92
	INCITEC PIVOT LTD	126,246	3.21	405,249.66
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	36,179	17.93	648,689.47
	NEWCREST MINING LTD	67,175	25.39	1,705,573.25
	ORICA LTD	34,209	18.56	634,919.04
	RIO TINTO LTD	31,619	94.17	2,977,561.23
	SOUTH32 LTD	428,480	3.87	1,658,217.60
	CIMIC GROUP LTD	9,442	50.46	476,443.32
	BRAMBLES LTD	133,242	12.11	1,613,560.62
	SEEK LTD	31,170	18.19	566,982.30
	AURIZON HOLDINGS LTD	189,493	4.55	862,193.15
	SYDNEY AIRPORT	102,091	7.15	729,950.65
	TRANSURBAN GROUP	236,687	12.86	3,043,794.82
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	49,392	24.82	1,225,909.44
	CROWN RESORTS LTD	37,909	11.71	443,914.39
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,782	41.21	155,856.22
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	5,195	42.64	221,514.80
	TABCORP HOLDINGS LTD	174,683	4.72	824,503.76
	REA GROUP LTD	5,094	75.71	385,666.74
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	55,261	3.81	210,544.41
WESFARMERS LTD	99,228	34.80	3,453,134.40	
COLES GROUP LTD	97,597	11.68	1,139,932.96	
WOOLWORTHS GROUP LTD	112,097	30.51	3,420,079.47	
COCA-COLA AMATIL LTD	40,556	8.44	342,292.64	
TREASURY WINE ESTATES LTD	60,920	15.44	940,604.80	

	COCHLEAR LTD	4,813	178.89	860,997.57
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,638	64.86	754,840.68
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,382	24.63	920,718.66
	CSL LTD	39,039	197.19	7,698,100.41
	AUST AND NZ BANKING GROUP	247,610	26.52	6,566,617.20
	BANK OF QUEENSLAND LTD	37,621	9.18	345,360.78
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	43,844	9.62	421,779.28
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	152,680	71.43	10,905,932.40
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	236,443	25.09	5,932,354.87
	WESTPAC BANKING CORP	296,445	26.51	7,858,756.95
	AMP LTD	245,353	2.20	539,776.60
	ASX LTD	16,172	69.89	1,130,261.08
	CHALLENGER LTD	43,119	7.48	322,530.12
	MACQUARIE GROUP LTD	27,693	126.97	3,516,180.21
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	202,865	7.69	1,560,031.85
	MEDIBANK PRIVATE LTD	261,276	2.70	705,445.20
	QBE INSURANCE GROUP LTD	116,277	12.54	1,458,113.58
	SUNCORP GROUP LTD	111,040	13.44	1,492,377.60
	LENDLEASE GROUP	54,281	12.15	659,514.15
	COMPUTERSHARE LTD	37,675	17.76	669,108.00
	TELSTRA CORP LTD	348,216	3.28	1,142,148.48
	TPG TELECOM LTD	34,153	6.72	229,508.16
	AGL ENERGY LTD	54,455	22.04	1,200,188.20
	AUSNET SERVICES	186,905	1.78	332,690.90
	オーストラリアドル 小計	6,452,891		106,535,772.23 (8,281,025,575)
イギリスポンド	BP PLC	1,727,119	5.52	9,535,423.99
	JOHN WOOD GROUP PLC	54,127	5.45	295,316.91
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	388,074	23.91	9,280,789.71
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	322,255	24.06	7,753,455.30
	ANGLO AMERICAN PLC	89,556	19.62	1,757,267.83
	ANTOFAGASTA PLC	35,213	9.37	330,086.66
	BHP GROUP PLC	182,131	17.60	3,205,869.86
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,801	48.97	528,924.97
	FRESNILLO PLC	21,178	8.33	176,539.80
	GLENCORE PLC	969,533	3.11	3,018,640.99
	JOHNSON MATTHEY PLC	15,647	31.00	485,057.00
	MONDI PLC	30,592	17.09	522,817.28
	RIO TINTO PLC	99,548	42.31	4,211,875.88
	ASHTREAD GROUP PLC	40,579	18.60	754,769.40
	BAE SYSTEMS PLC	276,596	4.70	1,300,001.20
	BUNZL PLC	28,973	24.68	715,053.64

DCC PLC	8,391	65.40	548,771.40
FERGUSON PLC	20,389	52.69	1,074,296.41
MEGGITT PLC	69,804	5.08	354,883.53
MELROSE INDUSTRIES PLC	400,391	1.81	726,309.27
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	145,309	9.04	1,313,593.36
SMITHS GROUP PLC	32,667	14.31	467,628.10
WEIR GROUP PLC/THE	19,960	15.74	314,170.40
BABCOCK INTL GROUP PLC	22,771	5.08	115,722.22
EXPERIAN PLC	78,661	20.29	1,596,031.69
G4S PLC	144,441	1.86	268,876.92
INTERTEK GROUP PLC	13,170	47.34	623,467.80
RELX PLC	170,473	16.15	2,753,138.95
EASYJET PLC	11,359	11.57	131,480.42
ROYAL MAIL PLC	65,843	2.40	158,220.72
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	92,555	5.86	542,742.52
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	10,105	37.80	381,969.00
BURBERRY GROUP PLC	35,286	18.39	648,909.54
PERSIMMON PLC	28,412	21.38	607,448.56
TAYLOR WIMPEY PLC	264,986	1.74	462,400.57
CARNIVAL PLC	15,252	41.36	630,822.72
COMPASS GROUP PLC	134,369	17.40	2,338,020.60
GVC HOLDINGS PLC	52,382	5.19	271,862.58
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	14,214	45.38	645,102.39
MERLIN ENTERTAINMENT	68,173	3.37	230,220.22
TUI AG-DI	35,838	7.85	281,471.65
WHITBREAD PLC	15,404	49.46	761,881.84
AUTO TRADER GROUP PLC	85,259	5.12	436,696.59
INFORMA PLC	104,851	7.41	777,155.61
ITV PLC	334,154	1.30	434,567.27
PEARSON PLC	65,170	8.49	553,423.64
WPP PLC	110,785	8.24	912,868.40
KINGFISHER PLC	189,573	2.28	433,363.87
MARKS & SPENCER GROUP PLC	147,491	2.68	396,013.33
NEXT PLC	12,317	53.80	662,654.60
SAINSBURY (J) PLC	143,744	2.36	340,385.79
TESCO PLC	834,080	2.33	1,945,074.56
WM MORRISON SUPERMARKETS	202,381	2.24	454,041.77
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	32,004	23.35	747,293.40
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	197,350	30.86	6,091,207.75
COCA-COLA HBC AG-DI	17,740	25.92	459,820.80
DIAGEO PLC	208,766	30.85	6,441,474.93
IMPERIAL BRANDS PLC	80,929	25.88	2,094,847.16

	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	57,727	64.08	3,699,146.16
	UNILEVER PLC	95,315	43.29	4,126,662.92
	CONVATEC GROUP PLC	123,670	1.34	166,026.97
	NMC HEALTH PLC	8,269	24.24	200,440.56
	SMITH & NEPHEW PLC	75,546	15.03	1,135,834.11
	ASTRAZENECA PLC	109,002	63.51	6,922,717.02
	GLAXOSMITHKLINE PLC	426,881	15.55	6,637,999.55
	BARCLAYS PLC	1,491,088	1.55	2,317,747.18
	HSBC HOLDINGS PLC	1,724,165	6.13	10,569,131.45
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,130,321	0.62	3,819,803.01
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	418,575	2.48	1,038,903.15
	STANDARD CHARTERED PLC	242,282	5.78	1,401,843.65
	3I GROUP PLC	79,948	9.59	767,340.90
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	23,257	17.73	412,462.89
	INVESTEC PLC	62,469	4.37	273,239.40
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	27,303	45.94	1,254,299.82
	SCHRODERS PLC	11,925	26.67	318,039.75
	ST JAMES'S PLACE PLC	42,849	10.07	431,489.43
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	217,559	2.59	564,565.60
	ADMIRAL GROUP PLC	18,321	21.42	392,435.82
	AVIVA PLC	341,827	4.09	1,401,148.87
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	109,265	3.55	388,000.01
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	514,625	2.68	1,383,826.62
	PRUDENTIAL PLC	223,152	15.59	3,480,055.44
	RSA INSURANCE GROUP PLC	83,796	5.05	423,169.80
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	37,344	19.39	724,100.16
	SAGE GROUP PLC/THE	90,812	6.85	622,607.07
	BT GROUP PLC	722,757	2.25	1,631,262.54
	VODAFONE GROUP PLC	2,300,313	1.44	3,318,431.53
	CENTRICA PLC	515,200	1.19	614,633.60
	NATIONAL GRID PLC	296,977	8.86	2,632,107.15
	SEVERN TRENT PLC	19,421	20.71	402,208.91
	SSE PLC	88,819	12.22	1,085,812.27
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	60,628	8.63	523,583.40
	イギリスポンド 小計	25,820,529		150,383,299.98 (21,802,570,831)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	15,377	20.93	321,840.61
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	746	561.00	418,506.00
	GIVAUDAN-REG	794	2,531.00	2,009,614.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	41,663	48.86	2,035,654.18
	SIKA AG-REG	11,341	138.40	1,569,594.40
	ABB LTD-REG	160,526	18.50	2,969,731.00

	GEBERIT AG-REG	3,244	406.00	1,317,064.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,880	201.60	379,008.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,548	208.40	739,403.20
	ADECCO GROUP AG-REG	13,331	51.46	686,013.26
	SGS SA-REG	449	2,523.00	1,132,827.00
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4,400	134.00	589,600.00
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	45,482	70.60	3,211,029.20
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	2,565	282.30	724,099.50
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	4,905	54.70	268,303.50
	DUFREY AG-REG	2,549	104.80	267,135.20
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	215	1,776.00	381,840.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	88	6,675.00	587,400.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	9	77,000.00	693,000.00
	NESTLE SA-REG	263,405	93.86	24,723,193.30
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,617	192.75	889,926.75
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	888	791.50	702,852.00
	LONZA GROUP AG-REG	6,453	288.50	1,861,690.50
	NOVARTIS AG-REG	186,427	93.04	17,345,168.08
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	60,421	269.40	16,277,417.40
	VIFOR PHARMA AG	3,784	132.65	501,947.60
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	220,339	11.45	2,522,881.55
	JULIUS BAER GROUP LTD	19,648	40.98	805,175.04
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,664	78.00	285,792.00
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,560	699.00	1,090,440.00
	UBS GROUP AG-REG	333,939	11.84	3,953,837.76
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,975	162.30	645,142.50
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,863	428.70	1,227,368.10
	SWISS RE AG	26,197	96.44	2,526,438.68
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,015	328.80	4,279,332.00
	SWISS PRIME SITE-REG	6,098	86.55	527,781.90
	TEMENOS AG - REG	5,327	141.80	755,368.60
	SWISSCOM AG-REG	2,322	483.20	1,121,990.40
	スイスフラン 小計	1,478,054		102,345,407.21 (11,312,237,858)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	234,368	83.80	19,640,038.40
	NWS HOLDINGS LTD	142,500	16.64	2,371,200.00
	MTR CORP	134,000	47.30	6,338,200.00
	MINH GROUP LTD	52,000	24.10	1,253,200.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	111,500	50.70	5,653,050.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	76,500	26.50	2,027,250.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	210,000	53.85	11,308,500.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	88,400	16.00	1,414,400.00

	SANDS CHINA LTD	212,800	38.45	8,182,160.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	122,000	11.30	1,378,600.00	
	SJM HOLDINGS LTD	175,000	9.01	1,576,750.00	
	WYNN MACAU LTD	116,800	19.10	2,230,880.00	
	WH GROUP LTD	723,000	8.47	6,123,810.00	
	BANK OF EAST ASIA LTD	113,620	25.65	2,914,353.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	308,000	33.00	10,164,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	66,900	191.60	12,818,040.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	103,000	272.80	28,098,400.00	
	AIA GROUP LTD	1,040,200	77.10	80,199,420.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	225,368	68.20	15,370,097.60	
	HANG LUNG GROUP LTD	88,000	24.65	2,169,200.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	186,000	19.06	3,545,160.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	119,947	47.65	5,715,474.55	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	57,000	41.70	2,376,900.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	60,500	34.25	2,072,125.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	502,000	12.28	6,164,560.00	
	SINO LAND CO	281,400	14.70	4,136,580.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	137,000	130.70	17,905,900.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	45,000	99.70	4,486,500.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	105,000	33.35	3,501,750.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	90,000	23.20	2,088,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	102,000	58.05	5,921,100.00	
	WHEELOCK & CO LTD	74,000	56.30	4,166,200.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	347,000	12.48	4,330,560.00	
	PCCW LTD	406,000	4.73	1,920,380.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	62,000	63.50	3,937,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	144,500	91.15	13,171,175.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	809,484	18.32	14,829,746.88	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	117,000	53.90	6,306,300.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	24,400	90.50	2,208,200.00	
	香港ドル 小計	8,014,187		330,015,160.43 (4,623,512,397)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	125,600	6.22	781,232.00	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	92,600	2.55	236,130.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	146,800	3.75	550,500.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	208,500	1.51	314,835.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	198,300	2.53	501,699.00	
	SATS LTD	65,000	5.09	330,850.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	43,940	9.75	428,415.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	543,000	1.03	559,290.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	152,850	2.43	371,425.50	

	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,600	32.59	215,094.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	639,560	0.28	179,076.80	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	149,400	3.31	494,514.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	155,800	25.35	3,949,530.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	272,500	11.16	3,041,100.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	116,900	25.20	2,945,880.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,100	7.32	454,572.00	
	CAPITALAND LTD	204,700	3.47	710,309.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,800	9.04	341,712.00	
	UOL GROUP LTD	44,300	6.73	298,139.00	
	VENTURE CORP LTD	22,000	18.01	396,220.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	702,860	2.97	2,087,494.20	
	シンガポールドル 小計	3,991,110		19,188,017.50	(1,559,026,421)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	63,834	4.69	299,381.46	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	85,484	7.88	674,041.34	
	A2 MILK CO LTD	66,214	13.81	914,415.34	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,792	15.40	705,196.80	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,094	11.70	422,299.80	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	161,393	3.58	577,786.94	
	MERIDIAN ENERGY LTD	123,719	4.08	504,773.52	
	ニュージーランドドル 小計	582,530		4,097,895.20	(309,882,835)
スウェーデンクローネ	LUNDIN PETROLEUM AB	16,985	315.70	5,362,164.50	
	BOLIDEN AB	22,350	251.40	5,618,790.00	
	ALFA LAVAL AB	27,023	200.30	5,412,706.90	
	ASSA ABLOY AB-B	85,783	194.05	16,646,191.15	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	55,679	246.25	13,710,953.75	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	34,993	226.95	7,941,661.35	
	EPIROC AB-A	57,066	89.54	5,109,689.64	
	EPIROC AB-B	31,407	85.07	2,671,793.49	
	SANDVIK AB	98,799	151.65	14,982,868.35	
	SKANSKA AB-B SHS	30,531	170.50	5,205,535.50	
	SKF AB-B SHARES	30,150	155.00	4,673,250.00	
	VOLVO AB-B SHS	134,334	134.75	18,101,506.50	
	SECURITAS AB-B SHS	28,849	144.55	4,170,122.95	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,811	239.70	4,508,996.70	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,224	75.12	2,871,386.88	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	73,092	136.08	9,946,359.36	
	ICA GRUPPEN AB	7,273	371.70	2,703,374.10	
	SWEDISH MATCH AB	15,331	464.40	7,119,716.40	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	53,505	268.30	14,355,391.50		

	NORDEA BANK ABP	256,159	83.00	21,261,197.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	134,763	94.06	12,675,807.78	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	132,170	103.20	13,639,944.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	79,297	176.20	13,972,131.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	15,069	194.30	2,927,906.70	
	INVESTOR AB-B SHS	39,374	416.00	16,379,584.00	
	KINNEVIK AB - B	22,197	237.00	5,260,689.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	6,638	284.20	1,886,519.60	
	ERICSSON LM-B SHS	261,986	86.84	22,750,864.24	
	HEXAGON AB-B SHS	22,895	475.90	10,895,730.50	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,008	568.00	3,412,544.00	
	TELE2 AB-B SHS	46,335	127.45	5,905,395.75	
	TELIA CO AB	233,342	42.15	9,835,365.30	
	スウェーデンクローネ 小計	2,116,418		291,916,138.29 (3,456,287,077)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	8,795	305.20	2,684,234.00	
	EQUINOR ASA	101,632	193.50	19,665,792.00	
	NORSK HYDRO ASA	104,142	34.90	3,634,555.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	14,527	359.30	5,219,551.10	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	8,069	323.50	2,610,321.50	
	MOWI ASA	38,534	199.75	7,697,166.50	
	ORKLA ASA	66,800	66.94	4,471,592.00	
	DNB ASA	85,109	162.55	13,834,467.95	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	19,329	158.40	3,061,713.60	
	TELENOR ASA	61,959	174.30	10,799,453.70	
	ノルウェークローネ 小計	508,896		73,678,848.15 (945,299,621)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,285	697.00	5,774,645.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	18,811	315.90	5,942,394.90	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	16,865	542.00	9,140,830.00	
	ISS A/S	15,801	206.00	3,255,006.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	368	8,270.00	3,043,360.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	537	8,682.00	4,662,234.00	
	DSV A/S	16,441	546.80	8,989,938.80	
	PANDORA A/S	10,430	305.20	3,183,236.00	
	CARLSBERG AS-B	8,964	819.60	7,346,894.40	
	COLOPLAST-B	9,884	717.40	7,090,781.60	
	DEMANT A/S	7,961	206.80	1,646,334.80	
	GENMAB A/S	5,253	1,153.00	6,056,709.00	
	H LUNDBECK A/S	6,277	298.90	1,876,195.30	
	NOVO NORDISK A/S-B	156,279	336.35	52,564,441.65	
DANSKE BANK A/S	59,575	121.55	7,241,341.25		

	TRYG A/S	12,190	183.10	2,231,989.00
	ORSTED A/S	15,956	508.60	8,115,221.60
	デンマーククローネ 小計	369,877		138,161,553.30 (2,297,626,631)
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	53,782	18.32	985,286.24
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,216	463.20	1,026,451.20
	BANK HAPOALIM BM	85,294	24.80	2,115,291.20
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	127,843	24.58	3,142,380.94
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,539	73.22	918,105.58
	AZRIELI GROUP LTD	3,746	211.40	791,904.40
	NICE LTD	5,490	425.50	2,335,995.00
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	186,511	2.59	484,369.06
	イスラエルシェケル 小計	477,421		11,799,783.62 (358,241,430)
ユーロ	ENAGAS SA	20,240	26.90	544,456.00
	ENI SPA	219,807	15.70	3,450,969.90
	GALP ENERGIA SGPS SA	41,429	13.83	573,170.21
	NESTE OYJ	10,676	94.00	1,003,544.00
	OMV AG	12,373	47.94	593,161.62
	REPSOL SA	119,513	15.21	1,817,792.73
	SNAM SPA	188,064	4.59	864,154.08
	TENARIS SA	38,516	12.89	496,471.24
	TOTAL SA	207,924	49.43	10,277,683.32
	VOPAK	6,680	41.58	277,754.40
	AIR LIQUIDE SA	36,874	110.65	4,080,108.10
	AKZO NOBEL N.V.	19,417	79.53	1,544,234.01
	ARCELORMITTAL	55,152	18.36	1,013,031.93
	ARKEMA	5,588	85.84	479,673.92
	BASF SE	79,104	65.51	5,182,103.04
	COVESTRO AG	16,419	47.12	773,663.28
	CRH PLC	71,435	27.19	1,942,317.65
	EVONIK INDUSTRIES AG	15,472	24.21	374,577.12
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	6,711	37.32	250,454.52
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,105	64.16	840,816.80
	IMERYS SA	3,250	45.04	146,380.00
	KONINKLIJKE DSM NV	15,853	95.94	1,520,936.82
	LANXESS AG	7,123	48.44	345,038.12
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	20,805	25.52	530,943.60
	SOLVAY SA	6,607	96.40	636,914.80
	STORA ENSO OYJ-R SHS	47,201	10.77	508,590.77
SYMRISE AG	10,398	78.96	821,026.08	
THYSSENKRUPP AG	35,418	12.32	436,526.85	

UMICORE	17,505	40.28	705,101.40
UPM-KYMMENE OYJ	47,006	25.50	1,198,653.00
VOESTALPINE AG	9,030	27.61	249,318.30
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21,609	38.63	834,755.67
AIRBUS SE	50,108	114.60	5,742,376.80
ALSTOM	13,755	38.31	526,954.05
ANDRITZ AG	7,357	39.88	293,397.16
BOUYGUES SA	17,851	31.70	565,876.70
BRENTAG AG	13,323	45.88	611,259.24
CNH INDUSTRIAL NV	86,254	9.27	799,574.58
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	43,355	31.13	1,349,641.15
DASSAULT AVIATION SA	234	1,326.00	310,284.00
EIFFAGE	7,044	85.08	599,303.52
FERROVIAL SA	43,883	20.56	902,234.48
GEA GROUP AG	14,475	22.50	325,687.50
HOCHTIEF AG	1,825	142.60	260,245.00
KINGSPAN GROUP PLC	12,275	40.22	493,700.50
KION GROUP AG	5,354	47.21	252,762.34
KONE OYJ-B	29,911	44.31	1,325,356.41
LEGRAND SA	22,202	58.62	1,301,481.24
LEONARDO SPA	33,278	10.13	337,272.53
METSO OYJ	7,877	30.30	238,673.10
MTU AERO ENGINES AG	4,451	195.50	870,170.50
OSRAM LICHT AG	8,336	34.75	289,676.00
PRYSMIAN SPA	19,187	16.70	320,422.90
REXEL SA	22,189	10.00	222,000.94
SAFRAN SA	28,749	118.10	3,395,256.90
SCHNEIDER ELECTRIC SE	47,490	67.74	3,216,972.60
SIEMENS AG-REG	65,826	95.28	6,271,901.28
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	22,258	13.72	305,379.76
THALES SA	9,248	105.70	977,513.60
VINCI SA	43,677	84.84	3,705,556.68
WARTSILA OYJ ABP	36,487	13.90	507,169.30
BUREAU VERITAS SA	21,145	21.09	445,948.05
EDENRED	20,509	40.49	830,409.41
RANDSTAD NV	9,698	44.72	433,694.56
SOCIETE BIC SA	1,760	78.50	138,160.00
TELEPERFORMANCE	5,022	162.00	813,564.00
WOLTERS KLUWER	24,643	58.38	1,438,658.34
ADP	2,367	172.80	409,017.60
AENA SME SA	5,951	159.45	948,886.95
ATLANTIA SPA	41,994	22.17	931,006.98

BOLLORE	84,640	3.92	331,958.08
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	18,785	19.65	369,125.25
DEUTSCHE POST AG-REG	84,684	28.56	2,418,575.04
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	4,018	67.72	272,098.96
GETLINK SE	37,574	13.23	497,291.89
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,630	69.60	1,923,048.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	5,372	60.50	325,006.00
CONTINENTAL AG	9,642	137.85	1,329,149.70
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	78,463	50.50	3,962,381.50
FAURECIA	6,208	37.71	234,103.68
FERRARI NV	10,284	114.40	1,176,489.60
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	93,387	12.77	1,193,112.31
MICHELIN (CGDE)	14,850	102.95	1,528,807.50
NOKIAN RENKAAT OYJ	11,259	30.83	347,114.97
PEUGEOT SA	50,504	21.75	1,098,462.00
PIRELLI & C SPA	32,400	5.93	192,261.60
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	13,846	55.36	766,514.56
RENAULT SA	16,060	57.58	924,734.80
VALEO SA	21,342	26.19	558,946.98
VOLKSWAGEN AG	2,738	144.00	394,272.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	15,741	139.14	2,190,202.74
ADIDAS AG	15,538	209.90	3,261,426.20
ESSILORLUXOTTICA	24,413	97.96	2,391,497.48
HERMES INTERNATIONAL	2,744	583.20	1,600,300.80
HUGO BOSS AG -ORD	5,635	60.28	339,677.80
KERING	6,574	492.20	3,235,722.80
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	23,908	313.45	7,493,962.60
MONCLER SPA	14,273	35.34	504,407.82
PUMA SE	692	499.50	345,654.00
SEB SA	2,189	143.20	313,464.80
ACCOR SA	15,620	36.96	577,315.20
PADDY POWER BETFAIR PLC	6,731	67.95	457,371.45
SODEXO SA	7,529	96.96	730,011.84
AXEL SPRINGER SE	4,921	45.72	224,988.12
EUTELSAT COMMUNICATIONS	16,972	16.25	275,795.00
JCDECAUX SA	6,778	27.34	185,310.52
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	18,729	14.00	262,206.00
PUBLICIS GROUPE	17,599	48.70	857,071.30
RTL GROUP	4,202	49.84	209,427.68
SES	32,596	14.03	457,321.88
TELENET GROUP HOLDING NV	3,831	42.40	162,434.40
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,965	79.50	553,717.50

VIVENDI	90,554	25.51	2,310,032.54
DELIVERY HERO SE	7,441	34.66	257,905.06
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	93,701	26.27	2,461,525.27
ZALANDO SE	10,445	34.21	357,323.45
CARREFOUR SA	52,739	16.90	891,289.10
CASINO GUICHARD PERRACHON	5,205	38.21	198,883.05
COLRUYT SA	5,320	65.98	351,013.60
JERONIMO MARTINS	24,315	13.26	322,416.90
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	102,951	23.62	2,432,217.37
METRO AG	18,366	14.83	272,367.78
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	65,561	71.81	4,707,935.41
DANONE	53,106	67.70	3,595,276.20
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	51,941	8.47	439,940.27
HEINEKEN HOLDING NV	9,551	88.25	842,875.75
HEINEKEN NV	22,139	92.74	2,053,170.86
KERRY GROUP PLC-A	13,954	96.65	1,348,654.10
PERNOD RICARD SA	18,525	157.50	2,917,687.50
REMY COINTREAU	2,083	115.00	239,545.00
BEIERSDORF AG	8,290	89.86	744,939.40
HENKEL AG & CO KGAA	9,345	82.20	768,159.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	14,686	88.38	1,297,948.68
L'OREAL	21,631	234.70	5,076,795.70
UNILEVER NV-CVA	132,521	51.08	6,769,172.68
BIOMERIEUX	4,033	72.80	293,602.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	19,085	68.38	1,305,032.30
FRESENIUS SE & CO KGAA	35,197	46.24	1,627,509.28
KONINKLIJKE PHILIPS NV	80,416	35.31	2,839,488.96
SARTORIUS AG-VORZUG	2,824	147.20	415,692.80
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,704	37.50	476,400.00
BAYER AG-REG	80,248	59.30	4,758,706.40
EUROFINS SCIENTIFIC	1,052	360.00	378,720.00
GRIFOLS SA	24,058	23.48	564,881.84
IPSEN	3,463	119.55	414,001.65
MERCK KGAA	10,773	98.68	1,063,079.64
ORION OYJ-CLASS B	9,952	34.90	347,324.80
QIAGEN N.V.	19,313	35.04	676,727.52
RECORDATI SPA	9,589	35.64	341,751.96
SANOFI	96,921	78.31	7,589,883.51
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,226	111.10	247,308.60
UCB SA	10,664	75.80	808,331.20
ABN AMRO GROUP NV-CVA	35,126	19.50	684,957.00
AIB GROUP PLC	66,715	3.77	251,648.98

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	577,227	5.18	2,994,653.67
BANCO DE SABADELL SA	521,939	0.91	474,964.49
BANCO SANTANDER SA	1,398,621	4.14	5,798,682.66
BANK OF IRELAND GROUP PLC	76,621	5.24	401,494.04
BANKIA SA	91,569	2.35	215,187.15
BANKINTER SA	53,132	6.93	368,629.81
BNP PARIBAS	96,872	41.62	4,032,297.00
CAIXABANK SA	299,707	2.80	839,479.30
COMMERZBANK AG	89,477	6.90	617,659.73
CREDIT AGRICOLE SA	100,365	10.51	1,054,836.15
ERSTE GROUP BANK AG	25,348	32.32	819,247.36
ING GROEP NV	335,888	10.46	3,514,732.03
INTESA SANPAOLO	1,297,377	2.15	2,797,793.50
IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD	47,248		
KBC GROUP NV	21,780	61.42	1,337,727.60
MEDIOBANCA SPA	52,475	8.94	469,441.35
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	10,971	20.07	220,187.97
SOCIETE GENERALE SA	66,929	25.52	1,708,362.72
UNICREDIT SPA	171,614	11.38	1,952,967.32
AMUNDI SA	4,665	55.72	259,933.80
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	172,490	7.27	1,255,209.73
DEUTSCHE BOERSE AG	16,531	111.90	1,849,818.90
EURAZEO SE	3,350	67.30	225,455.00
EXOR NV	10,180	56.16	571,708.80
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,699	84.82	568,209.18
NATIXIS	74,547	4.59	342,170.73
WENDEL	2,050	111.80	229,190.00
AEGON NV	151,884	4.31	654,620.04
AGEAS	15,831	42.53	673,292.43
ALLIANZ SE-REG	36,560	196.34	7,178,190.40
ASSICURAZIONI GENERALI	100,856	16.35	1,648,995.60
AXA SA	166,959	22.33	3,728,194.47
CNP ASSURANCES	13,151	19.86	261,178.86
HANNOVER RUECK SE	4,927	125.60	618,831.20
MAPFRE SA	98,407	2.49	245,230.24
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	12,684	207.50	2,631,930.00
NN GROUP NV	25,277	36.37	919,324.49
POSTE ITALIANE SPA	46,417	8.56	397,329.52
SAMPO OYJ-A SHS	38,297	42.23	1,617,282.31
SCOR SE	13,432	38.22	513,371.04
AROUNDTOWN SA	72,627	7.77	564,674.92
DEUTSCHE WOHNEN SE	31,195	44.17	1,377,883.15

VONOVIA SE	42,811	46.50	1,990,711.50
ADYEN NV	872	657.80	573,601.60
AMADEUS IT GROUP SA	37,158	67.28	2,499,990.24
ATOS SE	8,611	85.48	736,068.28
CAPGEMINI SE	14,005	103.75	1,453,018.75
DASSAULT SYSTEMES SA	11,410	129.90	1,482,159.00
SAP SE	84,578	98.68	8,346,157.04
WIRECARD AG	10,425	99.00	1,032,075.00
INGENICO GROUP	5,690	63.18	359,494.20
NOKIA OYJ	479,869	5.23	2,512,594.08
1&1 DRILLISCH AG	3,933	38.00	149,454.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	287,271	15.64	4,494,354.79
ELISA OYJ	13,285	40.41	536,846.85
ILIAD SA	2,411	87.86	211,830.46
KONINKLIJKE KPN NV	278,292	2.84	791,740.74
ORANGE	170,347	14.41	2,454,700.27
PROXIMUS	13,891	25.05	347,969.55
TELECOM ITALIA SPA	1,075,600	0.52	565,550.48
TELECOM ITALIA-RSP	441,476	0.47	208,244.22
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	67,973	2.96	201,200.08
TELEFONICA SA	403,855	7.60	3,069,298.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,786	34.14	334,094.04
E.ON SE	189,706	9.97	1,891,748.23
EDF	51,714	12.47	644,873.58
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	210,641	3.43	722,498.63
ENDESA SA	27,806	23.14	643,430.84
ENEL SPA	703,320	5.63	3,962,504.88
ENGIE	159,162	13.24	2,108,100.69
FORTUM OYJ	37,029	19.68	728,730.72
IBERDROLA SA	536,108	7.72	4,143,042.62
INNOGY SE	11,254	41.00	461,414.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	30,862	24.67	761,365.54
RED ELECTRICA CORPORACION SA	36,318	19.41	704,932.38
RWE AG	43,893	23.75	1,042,458.75
SUEZ	35,823	11.80	422,711.40
TERNA SPA	131,285	5.54	727,844.04
UNIPER SE	16,310	27.46	447,872.60
VEOLIA ENVIRONNEMENT	48,509	19.96	968,482.18
VERBUND AG	5,672	43.36	245,937.92
ASML HOLDING NV	35,352	167.30	5,914,389.60
INFINEON TECHNOLOGIES AG	98,527	19.23	1,894,674.21
STMICROELECTRONICS NV	58,532	14.53	850,469.96

ユーロ 小計	16,899,795		320,825,640.39 (39,811,253,715)
合 計	96,368,087		334,289,412,086 (334,289,412,086)

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

## (2)株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
アメリカ ドル	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	46,484	836,712.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,245	1,310,201.40	
		AMERICAN TOWER CORP	37,864	7,332,363.60	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	115,813	1,187,083.25	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,631	2,321,431.29	
		BOSTON PROPERTIES INC	13,153	1,729,751.03	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	12,602	257,206.82	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,555	754,064.55	
		CROWN CASTLE INTL CORP	35,661	4,475,455.50	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	17,694	2,107,709.28	
		DUKE REALTY CORP	29,582	907,279.94	
		EQUINIX INC	7,000	3,160,500.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	31,376	2,334,374.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,619	1,633,499.49	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	11,183	1,125,121.63	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,024	810,348.48	
		HCP INC	40,806	1,291,509.90	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	62,059	1,166,709.20	
		INVITATION HOMES INC	25,975	623,919.50	
		IRON MOUNTAIN INC	22,541	791,639.92	
		KIMCO REALTY CORP	33,904	614,679.52	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	12,966	623,794.26	
		MACERICH CO/THE	9,914	434,034.92	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,951	1,074,110.94	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	13,112	710,408.16	
		PROLOGIS INC	54,304	3,859,385.28	
		PUBLIC STORAGE	13,350	2,965,302.00	
		REALTY INCOME CORP	25,468	1,848,976.80	
REGENCY CENTERS CORP	13,727	907,491.97			
SIMON PROPERTY GROUP INC	26,580	4,720,608.00			
SL GREEN REALTY CORP	7,274	652,623.28			

		UDR INC	23,256	1,046,054.88
		VENTAS INC	30,601	1,965,502.23
		VEREIT INC	83,590	704,663.70
		VORNADO REALTY TRUST	14,355	959,201.10
		WELLTOWER INC	32,284	2,512,340.88
		WEYERHAEUSER CO	65,945	1,698,743.20
		WP CAREY INC	13,972	1,086,602.44
アメリカドル合計			1,034,420	64,541,404.74 (7,093,745,794)
カナダドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	12,200	283,772.00
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	13,900	365,570.00
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,700	198,075.00
カナダドル合計			31,800	847,417.00 (69,318,710)
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS	92,174	1,166,001.10
		GOODMAN GROUP	146,851	1,966,334.89
		GPT GROUP	158,264	968,575.68
		MIRVAC GROUP	333,821	914,669.54
		SCENTRE GROUP	474,719	1,936,853.52
		STOCKLAND	199,333	757,465.40
		VICINITY CENTRES	265,261	679,068.16
オーストラリアドル合計			1,670,423	8,388,968.29 (652,074,505)
イギリスポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	80,363	474,302.42
		HAMMERSON PLC	75,483	257,019.61
		LAND SECURITIES GROUP PLC	60,292	550,707.12
		SEGRO PLC	91,863	607,398.15
イギリスポンド合計			308,001	1,889,427.30 (273,929,169)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	183,000	16,113,150.00
香港ドル合計			183,000	16,113,150.00 (225,745,231)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	227,200	649,792.00
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	207,200	404,040.00
		CAPITALAND MALL TRUST	244,300	583,877.00
		SUNTEC REIT	173,200	339,472.00
シンガポールドル合計			851,900	1,977,181.00 (160,645,956)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	3,966	372,804.00
		GECINA SA	3,712	485,529.60
		ICADE	3,212	239,133.40
		KLEPIERRE	18,251	559,575.66

	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	11,942	1,816,855.88	
ユーロ合計		41,083	3,473,898.54 (431,076,069)	
	合計		8,906,535,434 (8,906,535,434)	

(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	597銘柄	96.97%	66.05%
	投資証券	38銘柄		2.07%
カナダドル	株式	88銘柄	99.46%	3.74%
	投資証券	3銘柄		0.02%
オーストラリアドル	株式	61銘柄	92.70%	2.41%
	投資証券	7銘柄		0.19%
イギリスポンド	株式	92銘柄	98.76%	6.35%
	投資証券	4銘柄		0.08%
スイスフラン	株式	38銘柄	100.00%	3.30%
香港ドル	株式	39銘柄	95.34%	1.35%
	投資証券	1銘柄		0.07%
シンガポールドル	株式	21銘柄	90.66%	0.45%
	投資証券	4銘柄		0.05%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.00%	0.09%
スウェーデンクローネ	株式	32銘柄	100.00%	1.01%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.00%	0.28%
デンマーククローネ	株式	17銘柄	100.00%	0.67%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.00%	0.10%
ユーロ	株式	238銘柄	98.93%	11.60%
	投資証券	5銘柄		0.13%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

## 日本債券インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

[平成31年 3月25日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,033,783,825
国債証券	494,193,238,010
地方債証券	30,830,720,825
特殊債証券	38,732,100,119
社債証券	28,185,413,810
派生商品評価勘定	557,840
未収入金	3,295,569,400
未収利息	670,199,269
前払費用	12,925,613
差入委託証拠金	780,000
流動資産合計	598,955,288,711
資産合計	598,955,288,711
負債の部	
流動負債	
前受金	420,000
未払金	283,167,200
未払解約金	200,513,031
未払利息	5,198
流動負債合計	484,105,429
負債合計	484,105,429
純資産の部	
元本等	
元本	442,251,214,744
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	156,219,968,538
元本等合計	598,471,183,282
純資産合計	598,471,183,282
負債純資産合計	598,955,288,711

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[平成31年 3月25日現在]
1. 期首	平成30年 3月27日
期首元本額	364,702,866,394円

	[平成31年 3月25日現在]
期中追加設定元本額	207,303,216,370円
期中一部解約元本額	129,754,868,020円
元本の内訳	
ファンド・マネジャー(国内債券)	104,053,792,022円
eMAXIS 国内債券インデックス	10,231,069,842円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,418,288,519円
eMAXIS バランス(波乗り型)	73,948,861円
コアバランス	2,488,102円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	151,027,129円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	92,533,730円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	43,178,611円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	2,510,332,656円
国内債券セレクション(ラップ向け)	3,726,196,761円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	1,974,709,543円
つみたて8資産均等バランス	614,966,426円
つみたて4資産均等バランス	159,825,169円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,642,723円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	610,742円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	54,586円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	18,103,425円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	7,962,250円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	4,620,209円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	1,968,234円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	11,485,463,995円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	11,866,215,278円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	1,483,765,808円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	2,376,785,773円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	7,577,230,201円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	253,372,348円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	301,316,439円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	71,270,824円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	273,217,822円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	347,531,714円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	243,194,230円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	481,361,536円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	57,486,017円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	11,688,657円

	[平成31年 3月25日現在]
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	103,318,857円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	12,254,791,817円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)	1,220,019,095円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	5,273,465,607円
MUAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	188,490,942,570円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)	561,051,916円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投資家限定)	11,345,480円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	25,428,307円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定)	140,166,059円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	30,561,748円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,984,991,904円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	3,403,469,991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)	14,933,532,050円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	6,012,565,514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)	3,117,169,283円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	169,168,674円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	19,635,250,126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)	257,075,965円
MUKAM 日本債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	5,293,231,089円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	16,824,766円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	33,975,363円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	23,234,418円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	14,847,168円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	136,540,988円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	288,375,012円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	102,376,291円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	200,673,055円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	3,789,229,597円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(安定型)	1,894,916,230円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(安定成長型)	3,675,284,090円

	[平成31年 3月25日現在]
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)	2,020,200,538円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)	1,218,970,994円
合計	442,251,214,744円
2. 受益権の総数	442,251,214,744口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

## 1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成30年 3月27日 至 平成31年 3月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成31年 3月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。

区分	[平成31年 3月25日現在]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	[平成31年 3月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	7,231,567,130
地方債証券	53,896,051
特殊債券	183,229,567
社債券	2,785,350
合計	7,465,907,398

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## 債券関連

[平成31年 3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	債券先物取引 買建	305,660,000		306,220,000	560,000
	合計	305,660,000		306,220,000	560,000

## (注)時価の算定方法

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	[平成31年 3月25日現在]
1口当たり純資産額	1.3532円
(1万口当たり純資産額)	(13,532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387回利付国債(2年)	1,200,000,000	1,203,732,000	
	第388回利付国債(2年)	850,000,000	852,805,000	
	第389回利付国債(2年)	850,000,000	852,924,000	
	第390回利付国債(2年)	4,750,000,000	4,767,432,500	
	第391回利付国債(2年)	4,700,000,000	4,718,424,000	
	第392回利付国債(2年)	3,300,000,000	3,313,530,000	
	第393回利付国債(2年)	900,000,000	903,897,000	
	第394回利付国債(2年)	2,550,000,000	2,561,679,000	
	第395回利付国債(2年)	2,000,000,000	2,009,620,000	
	第396回利付国債(2年)	1,800,000,000	1,809,108,000	
	第397回利付国債(2年)	1,900,000,000	1,910,070,000	
	第124回利付国債(5年)	2,430,000,000	2,438,723,700	
	第125回利付国債(5年)	4,400,000,000	4,418,700,000	
	第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	2,974,681,600	
	第127回利付国債(5年)	3,870,000,000	3,891,942,900	
	第128回利付国債(5年)	3,850,000,000	3,875,063,500	
	第129回利付国債(5年)	3,100,000,000	3,122,444,000	
	第130回利付国債(5年)	4,950,000,000	4,989,451,500	
	第131回利付国債(5年)	4,310,000,000	4,348,143,500	
	第132回利付国債(5年)	3,650,000,000	3,685,040,000	
	第133回利付国債(5年)	5,970,000,000	6,032,864,100	
	第134回利付国債(5年)	4,610,000,000	4,663,798,700	
	第135回利付国債(5年)	4,480,000,000	4,534,835,200	
	第136回利付国債(5年)	4,300,000,000	4,356,029,000	
	第137回利付国債(5年)	4,200,000,000	4,257,036,000	
	第138回利付国債(5年)	5,600,000,000	5,678,960,000	

第1回利付国債(40年)	475,000,000	718,005,250
第2回利付国債(40年)	870,000,000	1,277,281,800
第3回利付国債(40年)	733,000,000	1,084,752,040
第4回利付国債(40年)	1,098,000,000	1,637,524,260
第5回利付国債(40年)	1,175,000,000	1,695,630,750
第6回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,520,587,700
第7回利付国債(40年)	1,190,000,000	1,624,861,700
第8回利付国債(40年)	1,250,000,000	1,593,087,500
第9回利付国債(40年)	1,940,000,000	1,830,875,000
第10回利付国債(40年)	1,850,000,000	2,053,426,000
第11回利付国債(40年)	1,780,000,000	1,913,624,600
第308回利付国債(10年)	1,374,000,000	1,399,350,300
第309回利付国債(10年)	3,700,000,000	3,759,089,000
第310回利付国債(10年)	2,136,000,000	2,173,743,120
第311回利付国債(10年)	2,100,000,000	2,130,849,000
第312回利付国債(10年)	6,860,000,000	7,025,531,800
第313回利付国債(10年)	3,469,000,000	3,571,543,640
第314回利付国債(10年)	1,190,000,000	1,220,440,200
第315回利付国債(10年)	3,633,000,000	3,746,349,600
第316回利付国債(10年)	2,280,000,000	2,346,028,800
第317回利付国債(10年)	1,957,000,000	2,020,093,680
第318回利付国債(10年)	2,480,000,000	2,553,755,200
第319回利付国債(10年)	1,719,000,000	1,780,007,310
第320回利付国債(10年)	1,980,000,000	2,044,825,200
第321回利付国債(10年)	2,515,000,000	2,605,187,900
第322回利付国債(10年)	1,470,000,000	1,518,304,200
第323回利付国債(10年)	1,675,000,000	1,734,713,750
第324回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,890,692,000
第325回利付国債(10年)	3,835,000,000	3,968,956,550
第326回利付国債(10年)	730,000,000	754,732,400
第327回利付国債(10年)	2,540,000,000	2,635,631,000
第328回利付国債(10年)	3,700,000,000	3,818,844,000
第329回利付国債(10年)	5,860,000,000	6,110,280,600
第330回利付国債(10年)	3,330,000,000	3,480,782,400
第331回利付国債(10年)	1,060,000,000	1,098,393,200
第332回利付国債(10年)	5,040,000,000	5,232,780,000
第333回利付国債(10年)	5,350,000,000	5,565,391,000
第334回利付国債(10年)	4,330,000,000	4,513,245,600
第335回利付国債(10年)	4,970,000,000	5,162,985,100
第336回利付国債(10年)	4,080,000,000	4,245,729,600
第337回利付国債(10年)	940,000,000	967,269,400
第338回利付国債(10年)	3,730,000,000	3,865,510,900

第339回利付国債(10年)	4,960,000,000	5,147,884,800
第340回利付国債(10年)	5,350,000,000	5,560,950,500
第341回利付国債(10年)	4,120,000,000	4,260,656,800
第342回利付国債(10年)	2,680,000,000	2,737,888,000
第343回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,864,815,200
第344回利付国債(10年)	3,660,000,000	3,742,020,600
第345回利付国債(10年)	4,190,000,000	4,285,406,300
第346回利付国債(10年)	4,790,000,000	4,900,601,100
第347回利付国債(10年)	3,750,000,000	3,836,137,500
第348回利付国債(10年)	5,600,000,000	5,727,736,000
第349回利付国債(10年)	4,190,000,000	4,282,724,700
第350回利付国債(10年)	6,100,000,000	6,230,357,000
第351回利付国債(10年)	6,800,000,000	6,939,672,000
第352回利付国債(10年)	5,910,000,000	6,026,072,400
第353回利付国債(10年)	4,200,000,000	4,278,372,000
第1回利付国債(30年)	76,000,000	98,575,800
第2回利付国債(30年)	98,000,000	124,125,820
第3回利付国債(30年)	117,000,000	147,416,490
第4回利付国債(30年)	127,000,000	170,022,520
第5回利付国債(30年)	108,000,000	136,620,000
第6回利付国債(30年)	169,000,000	219,355,240
第7回利付国債(30年)	164,000,000	212,070,040
第8回利付国債(30年)	142,000,000	175,121,500
第9回利付国債(30年)	116,000,000	136,804,600
第10回利付国債(30年)	185,000,000	210,657,650
第11回利付国債(30年)	137,000,000	167,766,090
第12回利付国債(30年)	220,000,000	282,431,600
第13回利付国債(30年)	205,000,000	260,809,200
第14回利付国債(30年)	493,000,000	657,474,660
第15回利付国債(30年)	346,000,000	468,158,760
第16回利付国債(30年)	302,000,000	409,729,440
第17回利付国債(30年)	327,000,000	439,775,760
第18回利付国債(30年)	427,000,000	568,968,960
第19回利付国債(30年)	303,000,000	404,647,410
第20回利付国債(30年)	495,000,000	678,882,600
第21回利付国債(30年)	379,000,000	508,303,430
第22回利付国債(30年)	570,000,000	785,334,600
第23回利付国債(30年)	554,000,000	765,018,600
第24回利付国債(30年)	411,000,000	568,799,340
第25回利付国債(30年)	742,000,000	1,003,747,920
第26回利付国債(30年)	884,000,000	1,214,218,200
第27回利付国債(30年)	860,000,000	1,201,927,400

第28回利付国債(30年)	911,000,000	1,279,007,560	
第29回利付国債(30年)	1,450,000,000	2,016,181,500	
第30回利付国債(30年)	1,496,000,000	2,060,081,760	
第31回利付国債(30年)	1,358,000,000	1,850,655,240	
第32回利付国債(30年)	1,739,000,000	2,416,044,870	
第33回利付国債(30年)	1,644,000,000	2,192,668,560	
第34回利付国債(30年)	2,116,000,000	2,921,032,200	
第35回利付国債(30年)	2,389,000,000	3,207,399,730	
第36回利付国債(30年)	1,829,000,000	2,465,711,480	
第37回利付国債(30年)	2,057,000,000	2,737,085,340	
第38回利付国債(30年)	1,185,000,000	1,554,862,200	
第39回利付国債(30年)	1,540,000,000	2,059,457,400	
第40回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,606,300,800	
第41回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,489,871,000	
第42回利付国債(30年)	1,250,000,000	1,620,937,500	
第43回利付国債(30年)	1,320,000,000	1,715,300,400	
第44回利付国債(30年)	1,290,000,000	1,677,877,200	
第45回利付国債(30年)	1,190,000,000	1,491,962,500	
第46回利付国債(30年)	1,550,000,000	1,944,444,000	
第47回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,266,237,200	
第48回利付国債(30年)	1,310,000,000	1,614,077,200	
第49回利付国債(30年)	2,480,000,000	3,056,848,000	
第50回利付国債(30年)	1,470,000,000	1,589,966,700	
第51回利付国債(30年)	1,650,000,000	1,574,661,000	
第52回利付国債(30年)	1,660,000,000	1,668,051,000	
第53回利付国債(30年)	980,000,000	1,010,017,400	
第54回利付国債(30年)	1,870,000,000	2,025,116,500	
第55回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,623,390,000	
第56回利付国債(30年)	1,490,000,000	1,611,494,600	
第57回利付国債(30年)	1,560,000,000	1,686,063,600	
第58回利付国債(30年)	2,160,000,000	2,332,886,400	
第59回利付国債(30年)	790,000,000	832,423,000	
第60回利付国債(30年)	1,580,000,000	1,749,154,800	
第61回利付国債(30年)	1,190,000,000	1,251,606,300	
第47回利付国債(20年)	114,000,000	118,062,960	
第48回利付国債(20年)	209,000,000	218,831,360	
第49回利付国債(20年)	515,000,000	538,545,800	
第51回利付国債(20年)	200,000,000	209,844,000	
第52回利付国債(20年)	214,000,000	226,262,200	
第54回利付国債(20年)	480,000,000	511,560,000	
第55回利付国債(20年)	241,000,000	256,850,570	
第56回利付国債(20年)	449,000,000	481,009,210	

第58回利付国債(20年)	147,000,000	157,813,320	
第59回利付国債(20年)	589,000,000	631,131,170	
第61回利付国債(20年)	289,000,000	302,924,020	
第63回利付国債(20年)	442,000,000	479,658,400	
第64回利付国債(20年)	441,000,000	482,824,440	
第65回利付国債(20年)	318,000,000	349,850,880	
第66回利付国債(20年)	500,000,000	547,690,000	
第68回利付国債(20年)	846,000,000	947,959,920	
第70回利付国債(20年)	422,000,000	479,923,720	
第71回利付国債(20年)	160,000,000	180,268,800	
第72回利付国債(20年)	534,000,000	601,978,200	
第73回利付国債(20年)	620,000,000	698,957,000	
第74回利付国債(20年)	318,000,000	360,341,700	
第75回利付国債(20年)	575,000,000	654,890,500	
第76回利付国債(20年)	200,000,000	225,366,000	
第77回利付国債(20年)	210,000,000	237,904,800	
第78回利付国債(20年)	410,000,000	464,218,400	
第79回利付国債(20年)	50,000,000	56,927,500	
第80回利付国債(20年)	315,000,000	360,630,900	
第81回利付国債(20年)	350,000,000	400,477,000	
第82回利付国債(20年)	662,000,000	761,822,980	
第83回利付国債(20年)	413,000,000	477,539,510	
第84回利付国債(20年)	670,000,000	770,131,500	
第85回利付国債(20年)	490,000,000	569,414,300	
第86回利付国債(20年)	515,000,000	605,753,300	
第87回利付国債(20年)	450,000,000	526,117,500	
第88回利付国債(20年)	804,000,000	950,520,960	
第89回利付国債(20年)	410,000,000	481,713,100	
第90回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,298,704,000	
第91回利付国債(20年)	468,000,000	556,091,640	
第92回利付国債(20年)	1,432,000,000	1,688,170,480	
第93回利付国債(20年)	390,000,000	458,491,800	
第94回利付国債(20年)	615,000,000	727,987,800	
第95回利付国債(20年)	1,017,000,000	1,226,298,600	
第96回利付国債(20年)	320,000,000	380,512,000	
第97回利付国債(20年)	343,000,000	412,471,220	
第98回利付国債(20年)	470,000,000	561,151,800	
第99回利付国債(20年)	1,345,000,000	1,611,484,850	
第100回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,283,903,800	
第101回利付国債(20年)	573,000,000	704,451,930	
第102回利付国債(20年)	530,000,000	654,120,700	
第103回利付国債(20年)	640,000,000	783,910,400	

第104回利付国債(20年)	300,000,000	361,860,000	
第105回利付国債(20年)	870,000,000	1,052,821,800	
第106回利付国債(20年)	711,000,000	867,220,920	
第107回利付国債(20年)	567,000,000	688,632,840	
第108回利付国債(20年)	800,000,000	955,912,000	
第109回利付国債(20年)	800,000,000	958,928,000	
第110回利付国債(20年)	1,096,000,000	1,335,782,880	
第111回利付国債(20年)	711,000,000	876,933,180	
第112回利付国債(20年)	1,340,000,000	1,638,927,200	
第113回利付国債(20年)	1,382,000,000	1,695,257,940	
第114回利付国債(20年)	1,320,000,000	1,624,603,200	
第115回利付国債(20年)	1,154,000,000	1,432,737,160	
第116回利付国債(20年)	1,346,000,000	1,676,766,040	
第117回利付国債(20年)	1,210,000,000	1,494,011,200	
第118回利付国債(20年)	776,000,000	952,516,720	
第119回利付国債(20年)	660,000,000	795,260,400	
第120回利付国債(20年)	810,000,000	957,760,200	
第121回利付国債(20年)	989,000,000	1,206,243,740	
第122回利付国債(20年)	760,000,000	918,201,600	
第123回利付国債(20年)	1,368,000,000	1,705,170,960	
第124回利付国債(20年)	750,000,000	926,047,500	
第125回利付国債(20年)	1,054,000,000	1,330,274,480	
第126回利付国債(20年)	890,000,000	1,101,980,200	
第127回利付国債(20年)	440,000,000	539,532,400	
第128回利付国債(20年)	1,014,000,000	1,246,672,440	
第129回利付国債(20年)	450,000,000	547,767,000	
第130回利付国債(20年)	1,682,000,000	2,052,376,400	
第131回利付国債(20年)	480,000,000	579,724,800	
第132回利付国債(20年)	1,187,000,000	1,436,697,320	
第133回利付国債(20年)	1,740,000,000	2,128,072,200	
第134回利付国債(20年)	1,885,000,000	2,310,519,900	
第135回利付国債(20年)	600,000,000	727,704,000	
第136回利付国債(20年)	650,000,000	779,961,000	
第137回利付国債(20年)	1,132,000,000	1,375,776,200	
第138回利付国債(20年)	400,000,000	475,636,000	
第139回利付国債(20年)	100,000,000	120,222,000	
第140回利付国債(20年)	2,397,000,000	2,919,042,630	
第141回利付国債(20年)	2,220,000,000	2,708,666,400	
第142回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,344,733,000	
第143回利付国債(20年)	1,980,000,000	2,392,869,600	
第144回利付国債(20年)	350,000,000	418,148,500	
第145回利付国債(20年)	2,810,000,000	3,441,041,700	

第146回利付国債(20年)	2,260,000,000	2,772,432,400	
第147回利付国債(20年)	2,410,000,000	2,926,487,100	
第148回利付国債(20年)	3,720,000,000	4,465,748,400	
第149回利付国債(20年)	2,220,000,000	2,668,395,600	
第150回利付国債(20年)	2,620,000,000	3,113,346,000	
第151回利付国債(20年)	2,540,000,000	2,943,225,000	
第152回利付国債(20年)	2,740,000,000	3,176,673,800	
第153回利付国債(20年)	3,110,000,000	3,656,551,400	
第154回利付国債(20年)	2,760,000,000	3,203,062,800	
第155回利付国債(20年)	2,800,000,000	3,157,644,000	
第156回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,394,727,400	
第157回利付国債(20年)	2,240,000,000	2,223,312,000	
第158回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,521,349,600	
第159回利付国債(20年)	2,070,000,000	2,191,177,800	
第160回利付国債(20年)	3,250,000,000	3,495,667,500	
第161回利付国債(20年)	1,810,000,000	1,912,138,300	
第162回利付国債(20年)	2,710,000,000	2,859,917,200	
第163回利付国債(20年)	2,730,000,000	2,877,829,500	
第164回利付国債(20年)	2,960,000,000	3,063,570,400	
第165回利付国債(20年)	1,730,000,000	1,788,041,500	
第166回利付国債(20年)	2,500,000,000	2,674,250,000	
第167回利付国債(20年)	1,200,000,000	1,236,648,000	
国債証券 合計	450,181,000,000	494,193,238,010	
地方債証券			
第1回東京都公募公債(20年)	20,000,000	21,296,400	
第7回東京都公募公債(30年)	10,000,000	13,723,000	
第8回東京都公募公債(30年)	80,000,000	105,576,800	
第16回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,927,000	
第20回東京都公募公債(20年)	80,000,000	96,675,200	
第21回東京都公募公債(20年)	80,000,000	97,819,200	
第22回東京都公募公債(20年)	120,000,000	144,028,800	
第24回東京都公募公債(20年)	70,000,000	85,294,300	
第28回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,422,000	
第686回東京都公募公債	100,000,000	101,316,000	
第687回東京都公募公債	100,000,000	101,640,000	
第693回東京都公募公債	100,000,000	102,706,000	
第705回東京都公募公債	170,000,000	175,292,100	
第709回東京都公募公債	100,000,000	102,476,000	
第722回東京都公募公債	100,000,000	103,346,000	
第729回東京都公募公債	100,000,000	103,386,000	
第749回東京都公募公債	300,000,000	308,283,000	
第752回東京都公募公債	100,000,000	100,787,000	
第754回東京都公募公債	120,000,000	120,417,600	

第755回東京都公募公債	300,000,000	301,044,000	
第758回東京都公募公債	300,000,000	300,432,000	
第765回東京都公募公債	300,000,000	304,785,000	
平成22年度第8回北海道公募公債	100,000,000	101,493,000	
平成25年度第4回北海道公募公債	100,000,000	103,532,000	
平成25年度第7回北海道公募公債	150,000,000	155,182,500	
平成25年度第9回北海道公募公債	300,000,000	309,381,000	
平成27年度第9回北海道公募公債	200,000,000	206,146,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	101,384,000	
平成29年度第15回北海道公募公債	117,000,000	119,029,950	
第29回1号宮城県公募公債	100,000,000	103,072,000	
第2回神奈川県公募公債(20年)	80,000,000	89,744,000	
第2回神奈川県公募公債(30年)	80,000,000	112,726,400	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,257,000	
第189回神奈川県公募公債	400,000,000	410,428,000	
第191回神奈川県公募公債	100,000,000	102,638,000	
第226回神奈川県公募公債	300,000,000	304,425,000	
第228回神奈川県公募公債	200,000,000	203,206,000	
第5回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	122,090,000	
第11回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	239,432,000	
第343回大阪府公募公債	70,000,000	71,065,400	
第348回大阪府公募公債	10,000,000	10,260,600	
第351回大阪府公募公債	100,000,000	102,727,000	
第358回大阪府公募公債	56,000,000	57,550,080	
第359回大阪府公募公債	56,000,000	57,625,680	
第376回大阪府公募公債	106,000,000	109,822,360	
第380回大阪府公募公債	100,000,000	103,596,000	
第385回大阪府公募公債	200,000,000	206,616,000	
第388回大阪府公募公債	400,000,000	411,444,000	
第393回大阪府公募公債	110,000,000	112,920,500	
第414回大阪府公募公債	100,000,000	100,130,000	
第416回大阪府公募公債	108,000,000	109,395,360	
第429回大阪府公募公債	103,000,000	104,529,550	
第431回大阪府公募公債	300,000,000	303,405,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	121,756,000	
平成23年度第9回京都府公募公債	140,000,000	144,142,600	
平成24年度第3回京都府公募公債(20年)	200,000,000	236,826,000	
平成24年度第10回京都府公募公債	100,000,000	102,633,000	
平成25年度第2回京都府公募公債(15年)	100,000,000	109,248,000	
第1回兵庫県公募公債(18年)	200,000,000	226,142,000	
第2回兵庫県公募公債(30年)	40,000,000	54,237,600	
第4回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	110,971,000	

第5回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	111,450,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	109,704,000	
第15回兵庫県公募公債(20年)	300,000,000	354,027,000	
第16回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	119,067,000	
平成27年度第6回兵庫県公募公債	200,000,000	206,900,000	
第3回静岡県公募公債(15年)	100,000,000	111,708,000	
平成22年度第1回静岡県公募公債	101,700,000	103,268,214	
平成22年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	101,542,000	
平成22年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	101,481,000	
平成25年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	102,321,000	
平成25年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	103,968,000	
平成25年度第8回静岡県公募公債	130,000,000	134,104,100	
平成27年度第3回静岡県公募公債	121,000,000	124,976,060	
平成27年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	103,540,000	
平成30年度第9回静岡県公募公債	100,000,000	102,027,000	
平成23年度第7回愛知県公募公債	100,000,000	102,567,000	
平成23年度第9回愛知県公募公債	100,000,000	102,529,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債	100,000,000	102,660,000	
平成23年度第17回愛知県公募公債	100,000,000	102,799,000	
平成24年度第13回愛知県公募公債	100,000,000	102,804,000	
平成24年度第14回愛知県公募公債(15年)	300,000,000	334,065,000	
平成26年度第9回愛知県公募公債	100,000,000	103,066,000	
平成26年度第12回愛知県公募公債	100,000,000	102,819,000	
平成27年度第18回愛知県公募公債	100,000,000	101,449,000	
平成28年度第1回愛知県公募公債	100,000,000	100,496,000	
平成28年度第8回愛知県公募公債	108,000,000	108,439,560	
平成22年度第5回広島県公募公債	200,000,000	203,290,000	
平成22年度第8回広島県公募公債	26,650,000	27,350,628	
平成23年度第1回広島県公募公債	100,000,000	102,551,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	100,000,000	103,111,000	
平成29年度第5回広島県公募公債	100,000,000	102,119,000	
第4回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	236,912,000	
平成23年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,831,000	
平成23年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	102,771,000	
平成24年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	102,827,000	
平成26年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	101,901,000	
平成27年度第6回埼玉県公募公債	200,000,000	206,444,000	
平成29年度第8回埼玉県公募公債	200,000,000	204,238,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	70,000,000	96,971,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	80,000,000	106,388,000	
平成22年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	101,551,000	
平成22年度第5回福岡県公募公債	20,000,000	20,294,800	

平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	111,356,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	102,478,000	
平成26年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	103,381,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	103,069,000	
第2回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	116,823,000	
第9回千葉県公募公債(20年)	80,000,000	95,446,400	
平成22年度第11回千葉県公募公債	80,000,000	81,830,400	
平成22年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	102,432,000	
平成22年度第14回千葉県公募公債	100,000,000	102,629,000	
平成23年度第9回千葉県公募公債	20,000,000	20,590,800	
平成24年度第1回千葉県公募公債	20,000,000	20,638,200	
平成24年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	102,931,000	
平成25年度第1回千葉県公募公債	82,500,000	84,419,775	
平成25年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	103,080,000	
平成28年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	101,084,000	
平成28年度第8回千葉県公募公債	200,000,000	203,356,000	
第7回群馬県公募公債	400,000,000	407,116,000	
第15回群馬県公募公債	200,000,000	201,072,000	
平成28年度第1回岐阜県公募公債	100,000,000	100,379,000	
平成24年度第1回大分県公募公債	100,260,000	103,102,371	
第90回共同発行市場公募地方債	30,000,000	30,498,300	
第91回共同発行市場公募地方債	175,000,000	177,448,250	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,251,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,432,000	
第99回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,198,000	
第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,781,000	
第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,504,000	
第103回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,548,000	
第107回共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,721,000	
第109回共同発行市場公募地方債	170,000,000	175,424,700	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,769,000	
第113回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,580,000	
第114回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,813,000	
第117回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,320,000	
第120回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,677,000	
第126回共同発行市場公募地方債	210,000,000	217,566,300	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,072,000	
第129回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,650,000	
第130回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,626,000	
第132回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,496,000	
第135回共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,218,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,610,000	

第142回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,910,000	
第144回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,526,000	
第145回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,411,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,690,000	
第150回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,747,000	
第153回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,103,000	
第163回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,134,000	
第166回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,993,000	
第172回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,606,000	
第178回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,882,000	
平成24年度第2回堺市公募公債	200,000,000	205,268,000	
平成25年度第1回長崎県公募公債	200,000,000	207,214,000	
平成23年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	102,697,000	
平成25年度第1回栃木県公募公債	100,000,000	102,995,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債	50,000,000	51,411,500	
平成22年度第1回新潟市公募公債	54,980,000	56,130,181	
平成23年度第1回浜松市公募公債	38,200,000	39,250,500	
平成24年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	103,200,000	
平成25年度第1回浜松市公募公債	161,000,000	166,842,690	
第1回大阪市公募公債（15年）	200,000,000	225,462,000	
第5回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	122,850,000	
平成23年度第10回大阪市公募公債	10,000,000	10,267,500	
平成26年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	103,209,000	
第1回名古屋市公募公債（20年）	200,000,000	218,756,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	400,000,000	478,032,000	
第10回名古屋市公募公債（20年）	80,000,000	97,882,400	
第477回名古屋市公募公債	100,000,000	102,790,000	
第1回京都市公募公債（20年）	200,000,000	224,432,000	
第5回京都市公募公債（20年）	50,000,000	59,078,000	
平成23年度第2回京都市公募公債	100,000,000	102,505,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,815,000	
平成26年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,969,000	
平成20年度第24回神戸市公募公債（20年）	300,000,000	358,119,000	
平成22年度第4回神戸市公募公債	100,000,000	119,867,000	
平成22年度第9回神戸市公募公債（20年）	80,000,000	98,044,800	
第7回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	227,610,000	
第17回横浜市公募公債（20年）	80,000,000	95,421,600	
第20回横浜市公募公債（20年）	80,000,000	96,733,600	
平成24年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	103,127,000	
第25回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	119,476,000	
平成27年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	206,944,000	
第27回横浜市公募公債（20年）	60,000,000	71,070,600	

平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)	80,000,000	107,703,200	
平成23年度第3回札幌市公募公債	300,000,000	365,031,000	
平成26年度第5回札幌市公募公債	100,000,000	108,943,000	
平成27年度第9回札幌市公募公債	100,000,000	101,218,000	
第3回川崎市公募公債(15年)	100,000,000	103,145,000	
第44回川崎市公募公債(5年)	130,400,000	130,636,024	
第17回北九州市公募公債(20年)	100,000,000	118,083,000	
平成22年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,179,000	
平成25年度第3回北九州市公募公債	300,000,000	310,239,000	
平成22年度第9回福岡市公募公債	106,500,000	109,278,585	
平成23年度第6回福岡市公募公債	100,000,000	102,556,000	
平成24年度第4回福岡市公募公債	200,000,000	205,670,000	
平成25年度第4回福岡市公募公債	50,000,000	51,535,000	
平成26年度第6回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	115,858,000	
平成25年度第2回広島市公募公債	100,000,000	103,377,000	
平成29年度第6回広島市公募公債	300,000,000	305,880,000	
平成22年度第2回千葉市公募公債	100,000,000	101,427,000	
平成24年度第1回相模原市公募公債	200,000,000	205,236,000	
平成22年度第1回三重県公募公債	87,050,000	88,576,857	
平成23年度第1回三重県公募公債	98,410,000	101,067,070	
平成24年度第4回福井県公募公債	100,000,000	101,838,000	
平成27年度第4回福井県公募公債	200,000,000	201,062,000	
平成23年度第1回徳島県公募公債	100,000,000	102,697,000	
平成29年度第2回徳島県公募公債	108,000,000	109,685,880	
平成24年度第1回山梨県公募公債	200,000,000	205,656,000	
平成24年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	102,686,000	
平成26年度第1回岡山市公募公債	100,000,000	101,873,000	
第4回京都市保証京都市土地開発公社債券	200,000,000	200,480,000	
第96回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	100,000,000	121,009,000	
第132回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	102,994,000	
地方債証券 合計	29,105,650,000	30,830,720,825	
特殊債券			
第3回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	103,682,000	
第11回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債	400,000,000	400,644,000	
第19回政府保証日本政策投資銀行	400,000,000	411,512,000	
第22回政府保証日本政策投資銀行	20,000,000	20,709,800	
第39回政府保証日本政策投資銀行	106,000,000	107,696,000	
第47回政府保証日本政策投資銀行	700,000,000	700,714,000	
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,758,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	120,000,000	140,281,200	
第9回道路債券(財投機関債)	100,000,000	134,166,000	

第12回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	100,000,000	118,099,000	
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	200,000,000	234,728,000	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	30,000,000	46,546,800	
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	100,000,000	152,535,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	130,000,000	195,555,100	
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	100,000,000	119,689,000	
第28回道路債券(財投機関債)	400,000,000	545,096,000	
第33回道路債券(財投機関債)	500,000,000	691,085,000	
第42回道路債券(財投機関債)	200,000,000	225,920,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	150,000,000	184,455,000	
第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	50,000,000	60,888,000	
第69回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	100,000,000	123,506,000	
第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	241,920,000	
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	50,000,000	60,528,000	
第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	100,000,000	118,795,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,434,000	
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,555,000	
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	135,920,000	
第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,779,000	
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,221,000	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	544,000,000	553,296,960	
第112回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	354,000,000	359,501,160	
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,594,000	
第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,563,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	406,404,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	571,000,000	583,579,130	
第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,113,000	

第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	411,340,000	
第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	91,000,000	93,285,920	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	660,000,000	677,839,800	
第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	122,000,000	125,124,420	
第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)	200,000,000	240,658,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,731,000	
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	240,834,000	
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	136,000,000	139,839,280	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)	100,000,000	134,813,000	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	212,000,000	217,910,560	
第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	109,000,000	112,090,150	
第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)	100,000,000	114,480,000	
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,158,000	
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	256,320,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	12,000,000	12,370,800	
第173回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	310,222,640	
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,172,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	201,000,000	207,902,340	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,881,000	
第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,297,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	153,000,000	156,739,320	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,005,000	
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	223,000,000	232,392,760	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,875,000	
第211回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,068,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	222,000,000	229,805,520	

第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,519,000	
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,945,000	
第243回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,462,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	130,000,000	133,356,600	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,392,000	
第344回政府保証道路債券	100,000,000	102,157,000	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	600,000,000	609,420,000	
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	50,000,000	60,909,500	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	300,000,000	304,560,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	300,000,000	304,476,000	
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	20,000,000	20,797,200	
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)(財投機関債)	100,000,000	110,376,000	
第5回政府保証公営企業債券(15年)	300,000,000	322,356,000	
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	100,000,000	109,464,000	
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	200,000,000	241,914,000	
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	50,000,000	56,330,000	
第11回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	300,000,000	357,720,000	
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	250,000,000	305,560,000	
第13回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	101,559,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,510,000	
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	80,000,000	99,001,600	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,548,000	
第16回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	101,706,000	
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	80,000,000	95,975,200	
第17回公営企業債券(20年)(財投機関債)	150,000,000	174,771,000	
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	100,000,000	120,315,000	
第19回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	50,000,000	51,090,500	
第20回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	102,297,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	30,000,000	30,796,200	
第22回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	200,000,000	237,352,000	
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	300,000,000	355,860,000	
F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	70,000,000	74,591,300	
第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	50,000,000	60,271,000	

第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	21,000,000	21,567,000	
第30回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	300,000,000	308,016,000	
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	50,000,000	51,567,500	
第39回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,890,000	
第44回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	100,000,000	114,680,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,401,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	17,000,000	17,489,770	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	36,000,000	36,986,040	
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	160,000,000	165,678,400	
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,659,000	
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,492,000	
F63回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	109,710,000	
F77回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	200,000,000	222,744,000	
第77回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	103,103,000	
第89回政府保証地方公共団体金融機構債券	203,000,000	203,923,650	
F89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	300,000,000	339,615,000	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,054,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	400,000,000	407,172,000	
F104回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	107,694,000	
F123回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	115,800,000	
F124回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	222,866,000	
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	116,230,000	
F132回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	106,816,000	
F197回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	300,000,000	326,136,000	
F226回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	109,581,000	
F306回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	104,965,000	
第2回政府保証公営企業債券(15年)	100,000,000	104,433,000	
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)	80,000,000	97,490,400	
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)	80,000,000	95,832,800	
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	103,418,000	
第37回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	103,120,000	
第41回政府保証日本政策金融公庫債券	300,000,000	301,461,000	
第211回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,387,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,131,000	15,836,558	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,356,000	16,144,530	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,367,000	17,262,765	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,814,000	16,761,891	

第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	91,292,000	91,868,052
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	191,730,000	192,698,236
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,944,000	16,838,139
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,687,000	14,127,721
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,082,000	14,747,374
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,481,000	16,205,665
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,406,000	17,275,025
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,145,000	14,805,147
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,521,000	10,590,859
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,864,000	17,724,232
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,298,000	10,358,346
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,818,000	15,553,417
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,478,000	18,621,585
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,208,000	22,429,857
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,323,000	16,120,102
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,989,000	19,033,981
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,715,000	11,930,790
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,644,000	17,037,630
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,166,000	19,727,755
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,352,000	19,954,040
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	58,578,000	60,216,426
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,113,000	13,526,715
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,364,000	13,892,011
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,536,000	56,053,130
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,609,000	13,991,548
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,392,000	31,570,601
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,361,000	17,045,544
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,208,000	34,653,553
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,771,000	36,203,525
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,176,000	36,503,043
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,908,000	16,676,674
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,968,000	39,312,880
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,193,000	15,842,044
第39回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	300,000,000	363,084,000
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,469,000	40,570,176
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,630,000	17,569,595
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,086,000	15,922,216
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,565,000	47,656,028
第43回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	123,159,000
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,874,000	47,232,115
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,086,000	39,752,854

第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,302,000	35,733,379	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	104,181,000	111,794,547	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,209,000	36,546,843	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,758,000	37,032,563	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,887,000	15,662,910	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,564,000	40,083,417	
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,634,000	43,188,659	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,293,000	44,943,925	
第54回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	300,000,000	303,906,000	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,528,000	49,440,652	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	139,854,000	148,717,946	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,930,000	51,007,585	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,732,000	52,739,294	
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,104,000	53,905,521	
第62回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	290,000,000	355,099,200	
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,881,000	53,381,292	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,438,000	56,108,831	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,794,000	51,427,900	
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,957,000	57,232,729	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	80,000,000	97,808,000	
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	328,902,000	346,264,736	
第77回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	30,000,000	33,702,000	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,521,000	51,833,135	
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	107,920,000	113,019,220	
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,567,000	56,108,754	
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,366,000	58,985,891	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	113,968,000	119,054,391	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	116,150,000	121,427,856	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	120,232,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,761,000	64,377,195	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,066,000	196,288,321	
第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	127,984,000	132,705,329	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,229,000	67,288,931	
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	136,856,000	140,129,595	
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	233,388,000	241,934,668	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	233,250,000	243,097,815	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	156,696,000	163,151,875	
第100回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	120,999,000	

第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	300,000,000	333,171,000	
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	405,865,000	422,529,816	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	271,302,000	275,002,559	
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	275,238,000	280,164,760	
第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	130,000,000	175,156,800	
第123回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	100,000,000	120,463,000	
第124回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	200,000,000	223,676,000	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	564,894,000	573,152,750	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,116,000	96,496,133	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,753,000	97,443,040	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,792,000	97,203,016	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,708,000	195,217,058	
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,082,000	195,595,927	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,942,000	196,761,916	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,296,000	197,645,410	
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,460,000	199,556,209	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,417,000	100,198,347	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,902,000	100,921,578	
第174回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	180,000,000	201,592,800	
第177回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	200,000,000	205,770,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券(財投機関債)	50,000,000	56,238,500	
第25回沖縄振興開発金融公庫債券(財投機関債)	300,000,000	304,803,000	
い第781号商工債券	100,000,000	100,244,000	
第310回信金中金債	200,000,000	200,630,000	
第311回信金中金債	200,000,000	200,668,000	
第315回信金中金債	400,000,000	400,460,000	
第322回信金中金債	300,000,000	299,892,000	
第327回信金中金債	200,000,000	200,086,000	
第332回信金中金債	300,000,000	300,348,000	
第336回信金中金債	300,000,000	300,537,000	
第338回信金中金債	200,000,000	200,462,000	
第11号商工債券(10年)	100,000,000	102,553,000	
第211号商工債券(3年)	300,000,000	300,105,000	
第223号商工債券(3年)	300,000,000	300,258,000	
第2回信金中金債(10年)	300,000,000	308,943,000	
第17回韓国輸出入銀行	100,000,000	100,013,000	
第18回韓国輸出入銀行	100,000,000	100,237,000	
第7回国際協力機構債券(財投機関債)	70,000,000	84,956,200	
第11回国際協力機構債券(財投機関債)	30,000,000	30,907,200	

	第33回中日本高速道路	50,000,000	51,263,500	
	第27回西日本高速道路	600,000,000	620,406,000	
	第29回西日本高速道路	200,000,000	203,504,000	
	第30回西日本高速道路	300,000,000	302,457,000	
特殊債券 合計		36,010,135,000	38,732,100,119	
社債券	第14回フランス相互信用連合銀行	300,000,000	302,850,000	
	第19回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	208,034,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	300,000,000	298,731,000	
	第1回韓国石油公社債	100,000,000	100,116,000	
	第12回新関西国際空港	300,000,000	329,106,000	
	第38回関西国際空港	50,000,000	51,445,500	
	第10回ゴールドマン・サックス・グループ・インク	200,000,000	211,818,000	
	第11回ナショナル・オーストラリア銀行	100,000,000	100,091,000	
	第17回ナショナル・オーストラリア銀行	100,000,000	100,213,000	
	第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション	300,000,000	300,798,000	
	第7回大和ハウス工業	200,000,000	199,948,000	
	第5回日揮	500,000,000	501,210,000	
	第7回明治ホールディングス	100,000,000	100,624,000	
	第10回アサヒグループホールディングス	100,000,000	100,154,000	
	第11回アサヒグループホールディングス	100,000,000	100,385,000	
	第3回コカ・コーラウエスト	300,000,000	303,978,000	
	第24回味の素	100,000,000	100,443,000	
	第3回 キュービー	100,000,000	100,251,000	
	第6回ヒューリック	300,000,000	300,870,000	
	第6回J．フロント リテイリング	200,000,000	202,532,000	
	第4回トヨタ紡織	300,000,000	302,664,000	
	第22回森ビル	200,000,000	199,560,000	
	第11回セブン&アイ・ホールディングス	300,000,000	304,185,000	
	第31回東レ	100,000,000	100,368,000	
	第4回野村総合研究所	100,000,000	101,159,000	
	第1回電通	300,000,000	300,879,000	
	第2回電通	200,000,000	201,916,000	
	第2回大塚ホールディングス	100,000,000	100,254,000	
	第3回富士フイルムホールディングス	100,000,000	102,926,000	
	第23回ジェイ エフ イー ホールディングス	300,000,000	299,793,000	
	第1回リクルートホールディングス	300,000,000	300,423,000	
	第19回豊田自動織機	100,000,000	102,576,000	
	第48回日本精工	200,000,000	200,502,000	
	第15回パナソニック	300,000,000	300,729,000	
	第17回パナソニック	100,000,000	101,417,000	
	第18回デンソー	200,000,000	201,584,000	

第1回村田製作所	300,000,000	300,237,000	
第29回三菱重工業	300,000,000	307,545,000	
第34回三菱重工業	100,000,000	99,979,000	
第1回明治安田生命2014基金	100,000,000	100,103,000	
第7回JA三井リース	200,000,000	200,334,000	
第9回JA三井リース	100,000,000	100,243,000	
第1回日本生命2015基金	100,000,000	100,081,000	
第1回日本生命2017基金	100,000,000	100,181,000	
第2回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	200,000,000	200,526,000	
第13回アイシン精機	100,000,000	103,314,000	
第1回明治安田生命2018基金	300,000,000	300,054,000	
第15回パン・パシフィック・インターナショナル	300,000,000	299,805,000	
第78回三菱商事	100,000,000	103,194,000	
第33回丸井	200,000,000	199,810,000	
第48回クレディセゾン	200,000,000	207,208,000	
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	300,000,000	300,048,000	
第8回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)	100,000,000	103,744,000	
第9回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)	100,000,000	113,553,000	
第28回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	100,000,000	102,612,000	
第30回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	100,000,000	121,207,000	
第57回三菱東京UFJ銀行	200,000,000	215,150,000	
第6回住友信託銀行(劣後特約付)	100,000,000	116,748,000	
第13回住友信託銀行(劣後特約付)	100,000,000	113,928,000	
第22回三井住友銀行(劣後特約付)	100,000,000	102,003,000	
第23回三井住友銀行(劣後特約付)	100,000,000	102,615,000	
第25回三井住友銀行(劣後特約付)	200,000,000	225,876,000	
第5回みずほ銀行(劣後特約付)	100,000,000	114,217,000	
第9回みずほ銀行(劣後特約付)	100,000,000	116,604,000	
第18回みずほ銀行(劣後特約付)	100,000,000	112,882,000	
第15回芙蓉総合リース	100,000,000	100,535,000	
第47回日産フィナンシャルサービス	200,000,000	199,508,000	
第20回東京センチュリーリース	100,000,000	100,172,000	
第23回東京センチュリーリース	200,000,000	200,354,000	
第26回東京センチュリーリース	100,000,000	99,880,000	
第29回ホンダファイナンス	200,000,000	201,492,000	
第38回ホンダファイナンス	300,000,000	299,754,000	
第42回ホンダファイナンス	100,000,000	99,865,000	
第77回トヨタファイナンス	200,000,000	200,690,000	
第23回リコーリース	200,000,000	199,792,000	
第30回リコーリース	200,000,000	200,270,000	
第47回日立キャピタル	100,000,000	102,885,000	
第52回日立キャピタル	200,000,000	201,946,000	

第70回日立キャピタル	200,000,000	200,474,000	
第194回オリックス	200,000,000	200,128,000	
第21回三井住友ファイナンス&リース	200,000,000	200,408,000	
第65回三菱UFJリース	100,000,000	100,023,000	
第27回野村ホールディングス	100,000,000	111,888,000	
第50回野村ホールディングス	200,000,000	200,458,000	
第58回三井不動産	300,000,000	300,045,000	
第64回三井不動産	100,000,000	100,085,000	
第105回三菱地所	100,000,000	103,335,000	
第116回三菱地所	100,000,000	102,822,000	
第125回三菱地所	300,000,000	300,630,000	
第99回住友不動産	300,000,000	309,102,000	
第12回イオンモール	200,000,000	200,710,000	
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発	100,000,000	102,572,000	
第17回エヌ・ティ・ティ都市開発	100,000,000	102,699,000	
第36回京王電鉄	100,000,000	101,382,000	
第38回京王電鉄	100,000,000	101,075,000	
第19回東日本旅客鉄道	100,000,000	106,789,000	
第26回東日本旅客鉄道	100,000,000	104,315,000	
第39回東日本旅客鉄道	500,000,000	562,170,000	
第83回東日本旅客鉄道	100,000,000	111,993,000	
第100回東日本旅客鉄道	100,000,000	130,020,000	
第9回西日本旅客鉄道	123,000,000	131,274,210	
第9回東海旅客鉄道	100,000,000	105,925,000	
第11回東海旅客鉄道	100,000,000	104,146,000	
第34回東海旅客鉄道	200,000,000	237,894,000	
第53回東海旅客鉄道	100,000,000	117,611,000	
第56回東海旅客鉄道	100,000,000	121,579,000	
第74回東海旅客鉄道	100,000,000	123,133,000	
第8回東京地下鉄	200,000,000	238,376,000	
第11回東京地下鉄	100,000,000	103,059,000	
第50回阪急阪神ホールディングス	200,000,000	202,362,000	
第16回三菱倉庫	200,000,000	200,736,000	
第5回関西高速鉄道	100,000,000	101,665,000	
第8回関西高速鉄道	200,000,000	206,570,000	
第63回日本電信電話	100,000,000	102,586,000	
第21回KDDI	100,000,000	102,825,000	
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	100,000,000	102,972,000	
第563回東京電力	100,000,000	101,413,000	
第567回東京電力	100,000,000	111,470,000	
第568回東京電力	100,000,000	101,358,000	
第499回中部電力	50,000,000	52,191,000	

第500回中部電力	100,000,000	103,476,000	
第518回中部電力	200,000,000	200,384,000	
第528回中部電力	200,000,000	199,630,000	
第496回関西電力	100,000,000	103,512,000	
第499回関西電力	200,000,000	204,616,000	
第508回関西電力	200,000,000	201,492,000	
第510回関西電力	100,000,000	100,985,000	
第512回関西電力	200,000,000	200,220,000	
第381回中国電力	100,000,000	103,711,000	
第385回中国電力	100,000,000	103,012,000	
第402回中国電力	200,000,000	200,220,000	
第304回北陸電力	100,000,000	103,610,000	
第307回北陸電力	100,000,000	105,619,000	
第310回北陸電力	200,000,000	206,256,000	
第322回北陸電力	200,000,000	201,212,000	
第481回東北電力	200,000,000	206,894,000	
第490回東北電力	100,000,000	100,273,000	
第494回東北電力	100,000,000	100,887,000	
第253回四国電力	100,000,000	103,608,000	
第371回九州電力	100,000,000	104,826,000	
第429回九州電力	200,000,000	207,098,000	
第430回九州電力	100,000,000	101,175,000	
第437回九州電力	100,000,000	102,479,000	
第460回九州電力	200,000,000	200,156,000	
第310回北海道電力	50,000,000	51,037,500	
第316回北海道電力	400,000,000	405,548,000	
第333回北海道電力	300,000,000	300,126,000	
第344回北海道電力	200,000,000	199,930,000	
第19回沖縄電力	80,000,000	81,265,600	
第38回電源開発	100,000,000	103,599,000	
第39回電源開発	100,000,000	103,388,000	
第40回電源開発	200,000,000	206,816,000	
第50回電源開発	200,000,000	201,376,000	
第57回電源開発	200,000,000	199,408,000	
第4回東京電力パワーグリッド	400,000,000	402,636,000	
第6回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,597,000	
第7回東京電力パワーグリッド	300,000,000	300,195,000	
第13回東京電力パワーグリッド	200,000,000	199,606,000	
第15回東京電力パワーグリッド	200,000,000	199,288,000	
第23回東京ガス	200,000,000	208,192,000	
第13回広島ガス	200,000,000	202,536,000	
第6回SCSK	100,000,000	99,928,000	

	第3回ファーストリテイリング	100,000,000	101,391,000	
	第4回ファーストリテイリング	100,000,000	103,453,000	
	第7回ファーストリテイリング	200,000,000	202,002,000	
社債券 合計		27,453,000,000	28,185,413,810	
	合計	542,749,785,000	591,941,472,764	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

[平成31年 3月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	236,192,965
コール・ローン	789,242,257
国債証券	228,008,259,101
派生商品評価勘定	2,877,188,750
未収入金	78,748,993
未収利息	1,743,479,026
前払費用	128,906,367
流動資産合計	233,862,017,459
資産合計	233,862,017,459
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	286,500
未払金	10,256,645
未払解約金	252,312,685
未払利息	1,352
流動負債合計	262,857,182
負債合計	262,857,182
純資産の部	
元本等	
元本	180,826,716,827
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	52,772,443,450
元本等合計	233,599,160,277
純資産合計	233,599,160,277
負債純資産合計	233,862,017,459

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	[平成31年 3月25日現在]
1. 期首	平成30年 3月27日
期首元本額	162,680,144,737円
期中追加設定元本額	34,263,640,655円
期中一部解約元本額	16,117,068,565円
元本の内訳	
eMAXIS 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	86,170,220円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	5,966,561,864円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	6,128,002,374円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	1,559,944,803円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	1,227,192,742円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	3,954,754,000円
eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）	75,770,074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）	120,053,860,200円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	12,027,020,145円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	91,147,652円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	98,140,358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）	7,706,269,407円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	3,134,774,040円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	1,094,442,991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）	9,776,230,084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）	133,519,388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）	138,371,334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）	7,574,545,151円
合計	180,826,716,827円
2. 受益権の総数	180,826,716,827口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成30年 3月27日 至 平成31年 3月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[ 平成31年 3月25日現在 ]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>（1）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>（2）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>（3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>

区分	[平成31年 3月25日現在]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	[平成31年 3月25日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		3,508,323,039
合計		3,508,323,039

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## 通貨関連

[平成31年 3月25日現在]

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引以外の取引	為替予約取引			
	売建			
	アメリカドル	106,756,023,886	105,967,748,100	788,275,786
	カナダドル	4,617,330,314	4,486,440,000	130,890,314
	オーストラリアドル	4,815,258,150	4,730,879,700	84,378,450
	イギリスポンド	15,772,455,859	15,507,510,000	264,945,859
	シンガポールドル	1,191,380,520	1,178,878,800	12,501,720
	スウェーデンクローネ	823,963,224	815,539,200	8,424,024
	ノルウェークローネ	532,495,776	527,158,400	5,337,376
	デンマーククローネ	1,169,143,572	1,149,798,200	19,345,372
	メキシコペソ	1,842,104,220	1,839,215,400	2,888,820
	ポーランドズロチ	1,440,546,000	1,421,812,000	18,734,000
	南アフリカランド	1,345,328,203	1,283,424,500	61,903,703
ユーロ	88,940,390,626	87,461,113,800	1,479,276,826	
合計	229,246,420,350	226,369,518,100	2,876,902,250	

(注)時価の算定方法

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	[平成31年 3月25日現在]
1口当たり純資産額	1,2918円
(1万口当たり純資産額)	(12,918円)

## 附属明細表

第1 有価証券明細表  
(1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
アメリカドル	国債証券	1.125 T-NOTE 200430	3,400,000.00	3,351,921.87	
		1.125 T-NOTE 210228	3,100,000.00	3,029,039.06	
		1.125 T-NOTE 210630	16,000,000.00	15,593,750.00	
		1.125 T-NOTE 210731	2,600,000.00	2,530,125.00	
		1.125 T-NOTE 210831	2,800,000.00	2,722,562.50	
		1.125 T-NOTE 210930	700,000.00	680,421.87	
		1.25 T-NOTE 200229	1,000,000.00	988,945.31	
		1.25 T-NOTE 210331	5,400,000.00	5,288,203.12	
		1.25 T-NOTE 211031	3,100,000.00	3,019,109.37	
		1.375 T-NOTE 200229	1,600,000.00	1,584,187.49	
		1.375 T-NOTE 200331	9,100,000.00	9,001,890.62	

1.375 T-NOTE 200430	4,900,000.00	4,843,152.33
1.375 T-NOTE 200531	1,600,000.00	1,580,000.00
1.375 T-NOTE 200831	1,300,000.00	1,281,515.62
1.375 T-NOTE 200930	15,200,000.00	14,976,750.00
1.375 T-NOTE 201031	4,200,000.00	4,134,046.87
1.375 T-NOTE 210131	1,600,000.00	1,571,625.00
1.375 T-NOTE 210430	7,000,000.00	6,864,375.00
1.375 T-NOTE 210531	2,500,000.00	2,450,000.00
1.375 T-NOTE 230630	4,100,000.00	3,951,695.31
1.375 T-NOTE 230831	3,700,000.00	3,561,250.00
1.375 T-NOTE 230930	7,000,000.00	6,731,484.37
1.5 T-NOTE 200515	4,500,000.00	4,452,714.84
1.5 T-NOTE 200531	4,700,000.00	4,648,777.34
1.5 T-NOTE 200715	2,900,000.00	2,866,355.46
1.5 T-NOTE 220131	800,000.00	782,937.50
1.5 T-NOTE 230228	10,000,000.00	9,714,062.50
1.5 T-NOTE 230331	6,700,000.00	6,504,757.81
1.5 T-NOTE 260815	6,450,000.00	6,068,542.96
1.625 T-NOTE 200315	11,500,000.00	11,409,707.02
1.625 T-NOTE 200630	5,500,000.00	5,445,859.37
1.625 T-NOTE 200731	1,300,000.00	1,286,593.75
1.625 T-NOTE 201130	3,500,000.00	3,456,796.87
1.625 T-NOTE 220815	8,400,000.00	8,226,093.75
1.625 T-NOTE 221115	10,350,000.00	10,120,359.37
1.625 T-NOTE 230430	7,850,000.00	7,656,816.40
1.625 T-NOTE 230531	4,900,000.00	4,775,585.93
1.625 T-NOTE 231031	6,700,000.00	6,512,609.37
1.625 T-NOTE 260215	12,600,000.00	12,012,328.12
1.625 T-NOTE 260515	9,200,000.00	8,753,656.25
1.75 T-NOTE 201031	3,600,000.00	3,564,281.25
1.75 T-NOTE 201231	1,700,000.00	1,681,937.50
1.75 T-NOTE 211130	6,600,000.00	6,509,765.62
1.75 T-NOTE 220228	12,750,000.00	12,564,726.56
1.75 T-NOTE 220331	1,400,000.00	1,379,109.37
1.75 T-NOTE 220430	3,100,000.00	3,052,531.25
1.75 T-NOTE 220515	9,200,000.00	9,059,125.00
1.75 T-NOTE 220531	3,800,000.00	3,740,625.00
1.75 T-NOTE 220930	4,900,000.00	4,815,015.62
1.75 T-NOTE 230515	2,400,000.00	2,350,687.50
1.875 T-NOTE 200630	3,250,000.00	3,229,052.73
1.875 T-NOTE 201215	6,000,000.00	5,951,015.62
1.875 T-NOTE 211130	2,700,000.00	2,671,628.90

1.875 T-NOTE 220131	2,000,000.00	1,978,281.25
1.875 T-NOTE 220228	2,500,000.00	2,472,265.62
1.875 T-NOTE 220430	4,000,000.00	3,953,437.50
1.875 T-NOTE 220531	3,700,000.00	3,656,640.62
1.875 T-NOTE 220831	3,750,000.00	3,701,367.18
1.875 T-NOTE 221031	6,300,000.00	6,215,343.75
2 T-NOTE 200930	7,500,000.00	7,456,054.68
2 T-NOTE 201130	350,000.00	347,867.18
2 T-NOTE 210115	5,200,000.00	5,167,296.87
2 T-NOTE 210228	1,800,000.00	1,788,468.75
2 T-NOTE 210831	1,000,000.00	992,929.68
2 T-NOTE 211031	3,800,000.00	3,772,093.75
2 T-NOTE 211231	10,000,000.00	9,932,031.25
2 T-NOTE 220215	2,900,000.00	2,879,156.25
2 T-NOTE 221130	8,200,000.00	8,124,406.25
2 T-NOTE 230215	23,900,000.00	23,668,468.75
2 T-NOTE 240430	2,500,000.00	2,465,820.31
2 T-NOTE 240531	2,700,000.00	2,662,347.65
2 T-NOTE 250215	15,000,000.00	14,733,984.37
2 T-NOTE 250815	12,300,000.00	12,052,078.12
2 T-NOTE 261115	7,300,000.00	7,104,953.12
2.125 T-NOTE 200831	1,000,000.00	996,250.00
2.125 T-NOTE 210131	700,000.00	697,101.56
2.125 T-NOTE 210815	6,400,000.00	6,373,500.00
2.125 T-NOTE 210930	1,000,000.00	996,015.62
2.125 T-NOTE 211231	3,700,000.00	3,685,546.87
2.125 T-NOTE 220630	6,350,000.00	6,325,195.31
2.125 T-NOTE 231130	7,700,000.00	7,650,070.31
2.125 T-NOTE 240229	2,700,000.00	2,680,382.81
2.125 T-NOTE 240331	4,600,000.00	4,567,656.25
2.125 T-NOTE 241130	3,500,000.00	3,465,273.43
2.125 T-NOTE 250515	10,650,000.00	10,529,355.46
2.25 T-BOND 460815	4,650,000.00	4,093,816.40
2.25 T-NOTE 210215	15,000,000.00	14,971,289.05
2.25 T-NOTE 210331	1,800,000.00	1,797,609.37
2.25 T-NOTE 210430	1,600,000.00	1,597,750.00
2.25 T-NOTE 210731	700,000.00	699,070.31
2.25 T-NOTE 231231	3,800,000.00	3,795,250.00
2.25 T-NOTE 240131	4,150,000.00	4,144,488.28
2.25 T-NOTE 241031	1,600,000.00	1,596,125.00
2.25 T-NOTE 241115	13,100,000.00	13,061,109.37
2.25 T-NOTE 241231	4,100,000.00	4,086,226.56
2.25 T-NOTE 270215	5,000,000.00	4,947,656.25

2.25 T-NOTE 270815	5,000,000.00	4,937,500.00	
2.375 T-NOTE 201231	700,000.00	700,136.71	
2.375 T-NOTE 210315	14,000,000.00	14,012,578.11	
2.375 T-NOTE 240815	11,200,000.00	11,242,875.00	
2.375 T-NOTE 270515	9,800,000.00	9,780,093.75	
2.5 T-BOND 450215	5,050,000.00	4,703,601.56	
2.5 T-BOND 460215	3,900,000.00	3,622,734.37	
2.5 T-BOND 460515	5,250,000.00	4,872,656.25	
2.5 T-NOTE 200630	2,600,000.00	2,602,742.18	
2.5 T-NOTE 201231	9,000,000.00	9,022,851.55	
2.5 T-NOTE 230815	10,950,000.00	11,056,933.59	
2.5 T-NOTE 240515	9,100,000.00	9,194,554.68	
2.5 T-NOTE 250131	2,000,000.00	2,020,625.00	
2.625 T-NOTE 200731	3,700,000.00	3,710,839.84	
2.625 T-NOTE 200815	1,400,000.00	1,404,101.56	
2.625 T-NOTE 200831	7,000,000.00	7,023,242.18	
2.625 T-NOTE 201115	5,100,000.00	5,118,925.77	
2.625 T-NOTE 210515	15,500,000.00	15,596,269.52	
2.625 T-NOTE 210615	3,000,000.00	3,020,742.18	
2.625 T-NOTE 230630	5,600,000.00	5,682,250.00	
2.625 T-NOTE 250331	18,200,000.00	18,504,281.25	
2.625 T-NOTE 290215	5,500,000.00	5,582,500.00	
2.75 T-BOND 420815	6,150,000.00	6,058,710.93	
2.75 T-BOND 421115	2,000,000.00	1,967,968.75	
2.75 T-BOND 471115	6,100,000.00	5,937,015.62	
2.75 T-NOTE 210815	18,000,000.00	18,186,328.11	
2.75 T-NOTE 230430	2,000,000.00	2,037,656.25	
2.75 T-NOTE 230531	6,000,000.00	6,115,781.25	
2.75 T-NOTE 231115	8,800,000.00	8,984,937.50	
2.75 T-NOTE 240215	3,000,000.00	3,066,328.12	
2.75 T-NOTE 250630	4,500,000.00	4,611,093.75	
2.75 T-NOTE 280215	5,500,000.00	5,639,218.75	
2.875 T-BOND 430515	7,400,000.00	7,424,859.37	
2.875 T-BOND 450815	3,600,000.00	3,603,093.74	
2.875 T-BOND 461115	6,600,000.00	6,597,421.87	
2.875 T-NOTE 201031	3,000,000.00	3,023,554.68	
2.875 T-NOTE 211015	11,500,000.00	11,665,761.71	
2.875 T-NOTE 211115	8,000,000.00	8,119,062.49	
2.875 T-NOTE 231031	7,000,000.00	7,184,296.87	
2.875 T-NOTE 250430	15,700,000.00	16,186,945.31	
2.875 T-NOTE 280515	7,400,000.00	7,661,890.62	
2.875 T-NOTE 280815	5,400,000.00	5,591,953.12	

3 T-BOND 420515	5,150,000.00	5,301,080.07
3 T-BOND 441115	7,850,000.00	8,042,570.30
3 T-BOND 450515	4,500,000.00	4,611,445.31
3 T-BOND 451115	3,450,000.00	3,537,597.65
3 T-BOND 470215	5,350,000.00	5,482,496.09
3 T-BOND 480215	6,700,000.00	6,847,085.93
3 T-BOND 480815	7,200,000.00	7,358,062.50
3.125 T-BOND 411115	4,900,000.00	5,158,015.62
3.125 T-BOND 420215	5,650,000.00	5,940,666.01
3.125 T-BOND 430215	3,600,000.00	3,772,125.00
3.125 T-BOND 440815	6,600,000.00	6,911,953.12
3.125 T-BOND 480515	3,300,000.00	3,455,460.93
3.125 T-NOTE 210515	1,300,000.00	1,321,632.81
3.125 T-NOTE 281115	6,600,000.00	6,977,437.50
3.375 T-BOND 440515	3,700,000.00	4,041,093.75
3.375 T-BOND 481115	6,200,000.00	6,811,281.25
3.5 T-NOTE 200515	7,300,000.00	7,384,691.39
3.625 T-BOND 430815	2,400,000.00	2,727,750.00
3.625 T-BOND 440215	4,900,000.00	5,570,304.68
3.625 T-NOTE 210215	2,200,000.00	2,251,992.18
3.75 T-BOND 410815	1,000,000.00	1,158,125.00
3.75 T-BOND 431115	4,600,000.00	5,330,609.37
3.875 T-BOND 400815	800,000.00	943,375.00
4.25 T-BOND 401115	800,000.00	992,500.00
4.375 T-BOND 380215	1,540,000.00	1,931,978.12
4.375 T-BOND 391115	1,350,000.00	1,700,156.25
4.375 T-BOND 400515	2,050,000.00	2,583,960.93
4.375 T-BOND 410515	1,100,000.00	1,390,125.00
4.5 T-BOND 360215	1,460,000.00	1,836,292.18
4.5 T-BOND 380515	1,800,000.00	2,295,140.62
4.625 T-BOND 400215	2,600,000.00	3,381,828.12
4.75 T-BOND 410215	3,500,000.00	4,636,953.12
5 T-BOND 370515	1,000,000.00	1,341,640.62
5.25 T-BOND 290215	1,400,000.00	1,740,812.50
5.375 T-BOND 310215	1,580,000.00	2,044,618.75
6 T-BOND 260215	2,000,000.00	2,462,812.50
6.125 T-BOND 271115	17,050,000.00	21,953,207.03
6.25 T-BOND 230815	2,500,000.00	2,912,890.62
6.25 T-BOND 300515	1,300,000.00	1,772,875.00
8 T-BOND 211115	1,300,000.00	1,488,042.96
8.75 T-BOND 200815	6,600,000.00	7,170,023.43
	959,030,000.00	970,531,761.42

アメリカドル合計				(106,671,145,897)
カナダドル	国債証券	0.5 CAN GOVT 220301	1,200,000.00	1,164,492.00
		0.75 CAN GOVT 200901	3,050,000.00	3,015,626.50
		0.75 CAN GOVT 210301	1,900,000.00	1,871,633.00
		0.75 CAN GOVT 210901	150,000.00	147,205.50
		1 CAN GOVT 220901	1,800,000.00	1,768,266.00
		1 CAN GOVT 270601	1,500,000.00	1,432,215.00
		1.5 CAN GOVT 200301	5,300,000.00	5,294,435.00
		1.5 CAN GOVT 230601	3,250,000.00	3,248,082.50
		1.5 CAN GOVT 260601	850,000.00	846,209.00
		1.75 CAN GOVT 200501	1,600,000.00	1,602,672.00
		1.75 CAN GOVT 200801	2,000,000.00	2,005,200.00
		1.75 CAN GOVT 230301	1,000,000.00	1,008,590.00
		2 CAN GOVT 280601	1,500,000.00	1,550,325.00
		2 CAN GOVT 511201	500,000.00	511,375.00
		2.25 CAN GOVT 250601	2,150,000.00	2,241,375.00
		2.5 CAN GOVT 240601	2,100,000.00	2,204,727.00
		2.75 CAN GOVT 220601	3,000,000.00	3,113,040.00
		2.75 CAN GOVT 481201	1,750,000.00	2,083,550.00
		2.75 CANADA GOVER 641201	650,000.00	824,999.50
		3.25 CAN GOVT 210601	3,100,000.00	3,213,460.00
		3.5 CAN GOVT 200601	1,250,000.00	1,277,812.50
		3.5 CAN GOVT 451201	2,050,000.00	2,727,607.00
		4 CAN GOVT 410601	1,650,000.00	2,273,056.50
5 CAN GOVT 370601	1,450,000.00	2,154,366.50		
5.75 CAN GOVT 290601	2,350,000.00	3,250,990.00		
5.75 CAN GOVT 330601	1,500,000.00	2,252,085.00		
8 CAN GOVT 270601	1,550,000.00	2,306,663.50		
カナダドル合計		50,150,000.00	55,390,059.00	(4,530,906,826)
オーストラリアドル	国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	2,600,000.00	2,609,674.34
		2 AUST GOVT 211221	2,950,000.00	2,994,026.09
		2.25 AUST GOVT 280521	3,800,000.00	3,940,334.76
		2.5 AUST GOVT 300521	1,400,000.00	1,490,113.52
		2.75 AUST GOVT 240421	2,400,000.00	2,546,284.80
		2.75 AUST GOVT 271121	2,650,000.00	2,856,781.09
		2.75 AUST GOVT 281121	3,750,000.00	4,053,897.00
		2.75 AUST GOVT 291121	1,850,000.00	2,010,820.50
		2.75 AUST GOVT 350621	1,000,000.00	1,087,978.30
		3 AUST GOVT 470321	1,600,000.00	1,771,187.04
		3.25 AUST GOVT 250421	4,550,000.00	4,986,752.22
		3.25 AUST GOVT 290421	2,300,000.00	2,598,140.72

		3.25 AUST GOVT 390621	1,300,000.00	1,504,109.36
		3.75 AUST GOVT 370421	1,500,000.00	1,850,106.74
		4.25 AUST GOVT 260421	3,250,000.00	3,809,811.20
		4.5 AUST GOVT 200415	2,950,000.00	3,040,938.47
		4.5 AUST GOVT 330421	2,400,000.00	3,139,807.20
		4.75 AUST GOVT 270421	3,500,000.00	4,294,417.05
		5.5 AUST GOVT 230421	2,600,000.00	3,016,577.72
		5.75 AUST GOVT 210515	3,900,000.00	4,247,578.92
		5.75 AUST GOVT 220715	2,900,000.00	3,302,965.15
オーストラリアドル合計			55,150,000.00	61,152,302.19 (4,753,368,449)
イギリス ポンド	国債証券	0.5 GILT 220722	3,380,000.00	3,362,547.91
		1.25 GILT 270722	2,780,000.00	2,855,438.08
		1.5 GILT 210122	4,100,000.00	4,163,669.72
		1.5 GILT 260722	5,300,000.00	5,548,929.87
		1.5 GILT 470722	3,600,000.00	3,614,760.00
		1.625 GILT 711022	1,650,000.00	1,819,405.50
		1.75 GILT 220907	3,350,000.00	3,472,799.61
		1.75 GILT 370907	1,970,000.00	2,075,198.00
		1.75 GILT 570722	2,450,000.00	2,717,393.00
		2 GILT 200722	4,050,000.00	4,122,580.86
		2 GILT 250907	2,800,000.00	3,015,482.40
		2.25 GILT 230907	3,650,000.00	3,895,280.00
		2.5 GILT 650722	1,150,000.00	1,596,108.00
		2.75 GILT 240907	1,700,000.00	1,880,591.00
		3.25 GILT 440122	4,200,000.00	5,723,004.00
		3.5 GILT 450122	1,850,000.00	2,642,103.40
		3.5 GILT 680722	2,250,000.00	3,964,747.50
		3.75 GILT 200907	1,900,000.00	1,984,930.00
		3.75 GILT 210907	1,650,000.00	1,774,575.00
		3.75 GILT 520722	940,000.00	1,519,604.00
		4 GILT 220307	1,250,000.00	1,372,862.50
		4 GILT 600122	1,050,000.00	1,911,081.90
		4.25 GILT 271207	850,000.00	1,088,467.50
		4.25 GILT 320607	2,000,000.00	2,744,320.00
		4.25 GILT 360307	2,350,000.00	3,379,271.80
		4.25 GILT 390907	1,300,000.00	1,949,797.20
		4.25 GILT 401207	890,000.00	1,354,152.80
		4.25 GILT 461207	1,100,000.00	1,787,379.00
		4.25 GILT 491207	800,000.00	1,350,520.00
		4.25 GILT 551207	4,410,000.00	8,022,231.00
4.5 GILT 340907	2,650,000.00	3,837,491.50		

		4.5 GILT 421207	3,950,000.00	6,346,860.00
		4.75 GILT 301207	1,800,000.00	2,518,313.40
		4.75 GILT 381207	2,000,000.00	3,152,944.00
		5 GILT 250307	2,350,000.00	2,927,418.50
		6 GILT 281207	1,920,000.00	2,810,649.60
		8 GILT 210607	2,000,000.00	2,323,060.00
イギリス債券合計			87,390,000.00	110,625,968.55 (16,038,552,920)
シンガ ポールド ル	国債証券	1.25 SINGAPOGOVT 211001	150,000.00	147,645.00
		1.75 SINGAPOGOVT 220401	650,000.00	647,140.00
		2 SINGAPOGOVT 200701	500,000.00	500,548.50
		2.125 SINGAPOGOV 260601	550,000.00	554,840.00
		2.25 SINGAPOGOVT 210601	1,150,000.00	1,158,625.00
		2.25 SINGAPOGOVT 360801	650,000.00	641,000.75
		2.375 SINGAPOGOV 250601	1,000,000.00	1,024,000.00
		2.75 SINGAPOGOVT 230701	1,400,000.00	1,448,020.00
		2.75 SINGAPOGOVT 420401	1,000,000.00	1,050,000.00
		2.75 SINGAPOGOVT 460301	650,000.00	682,370.00
		2.875 SINGAPOGOV 290701	450,000.00	482,850.00
		2.875SINGAPOGOVT 300901	800,000.00	857,200.00
		3 SINGAPOGOVT 240901	650,000.00	685,425.00
		3.125SINGAPOGOVT 220901	1,200,000.00	1,248,720.00
		3.25 SINGAPOGOVT 200901	500,000.00	509,487.50
3.375 SINGAPOGOV 330901	900,000.00	1,020,334.50		
3.5 SINGAPOGOVT 270301	1,620,000.00	1,795,446.00		
シンガポールドル合計			13,820,000.00	14,453,652.25 (1,174,359,245)
スウェー デンク ローネ	国債証券	0.75 SWD GOVT 280512	5,600,000.00	5,876,477.60
		0.75 SWD GOVT 291112	4,500,000.00	4,689,607.50
		1 SWD GOVT 261112	6,150,000.00	6,577,142.10
		1.5 SWD GOVT 231113	11,800,000.00	12,757,807.18
		2.5 SWD GOVT 250512	7,200,000.00	8,335,857.60
		3.5 SWD GOVT 220601	11,550,000.00	12,969,448.80
		3.5 SWD GOVT 390330	5,100,000.00	7,591,401.00
		5 SWD GOVT 201201	8,650,000.00	9,447,872.54
スウェーデンクローネ合計			60,550,000.00	68,245,614.32 (808,028,073)
ノル ウェー クロー ネ	国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	4,400,000.00	4,421,824.00
		1.75 NORWE GOVT 250313	4,800,000.00	4,903,296.00
		1.75 NORWE GOVT 270217	4,250,000.00	4,334,830.00
		2 NORWE GOVT 230524	7,250,000.00	7,457,089.00
		2 NORWE GOVT 280426	3,050,000.00	3,167,845.90

		3 NORWE GOVT 240314	4,950,000.00	5,348,696.76
		3.75 NORWE GOVT 210525	10,200,000.00	10,742,762.40
ノルウェークローネ合計			38,900,000.00	40,376,344.06 (518,028,494)
デンマーククローネ	国債証券	0.25 DMK GOVT 201115	2,200,000.00	2,232,626.00
		0.5 DMK GOVT 271115	6,700,000.00	7,063,314.20
		1.5 DMK GOVT 231115	8,100,000.00	8,843,280.30
		1.75 DMK GOVT 251115	11,600,000.00	13,204,976.00
		3 DMK GOVT 211115	9,650,000.00	10,575,548.87
		4.5 DMK GOVT 391115	15,200,000.00	27,622,914.40
デンマーククローネ合計			53,450,000.00	69,542,659.77 (1,156,494,431)
メキシコペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	46,750,000.00	51,477,360.00
		10 MEXICAN BONOS 361120	9,000,000.00	10,372,770.00
		5.75 MEXICAN BONO 260305	21,350,000.00	18,932,966.50
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	44,150,000.00	43,035,212.50
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	35,000,000.00	33,750,150.00
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	29,750,000.00	28,997,622.50
		7.75 MEXICAN BONO 310529	19,300,000.00	18,755,161.00
		7.75 MEXICAN BONO 341123	10,800,000.00	10,312,164.00
		7.75 MEXICAN BONO 421113	19,100,000.00	17,786,302.00
		8 MEXICAN BONOS 200611	33,300,000.00	33,390,243.00
		8 MEXICAN BONOS 231207	9,500,000.00	9,584,550.00
		8 MEXICAN BONOS 471107	12,000,000.00	11,424,516.00
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	10,400,000.00	10,776,272.00
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	18,200,000.00	18,370,170.00
メキシコペソ合計			318,600,000.00	316,965,459.50 (1,822,551,392)
ポーランドズロチ	国債証券	1.5 POLAND 200425	2,250,000.00	2,253,375.00
		1.75 POLAND 210725	5,750,000.00	5,769,256.75
		2 POLAND 210425	750,000.00	756,825.00
		2.25 POLAND 220425	5,400,000.00	5,464,800.00
		2.5 POLAND 230125	800,000.00	815,031.20
		2.5 POLAND 240425	1,000,000.00	1,011,000.00
		2.5 POLAND 260725	3,500,000.00	3,478,951.00
		2.5 POLAND 270725	4,500,000.00	4,450,950.00
		2.75 POLAND 280425	3,700,000.00	3,705,735.00
		3.25 POLAND 250725	2,850,000.00	2,992,642.50
		4 POLAND 231025	4,150,000.00	4,499,222.50
		5.25 POLAND 201025	2,000,000.00	2,114,800.00
		5.75 POLAND 211025	5,900,000.00	6,509,175.00
		5.75 POLAND 220923	2,500,000.00	2,824,800.00

		5.75 POLAND 290425	1,400,000.00	1,773,632.00	
ポーランドズロチ合計			46,450,000.00	48,420,195.95 (1,397,406,855)	
南アフリ カランド	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	29,400,000.00	32,175,360.00	
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	4,700,000.00	3,369,926.50	
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	22,900,000.00	16,031,145.00	
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	5,800,000.00	5,763,808.00	
		7 SOUTH AFRICA 310228	18,000,000.00	14,910,300.00	
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	8,200,000.00	8,173,350.00	
		8 SOUTH AFRICA 300131	15,200,000.00	13,874,892.42	
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	7,800,000.00	7,076,940.00	
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	20,250,000.00	18,065,041.80	
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	11,100,000.00	9,911,660.19	
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	23,200,000.00	20,740,800.00	
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	8,600,000.00	8,008,479.01	
		9 SOUTH AFRICA 400131	8,200,000.00	7,549,773.78	
南アフリカランド合計			183,350,000.00	165,651,476.70 (1,253,981,678)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	600,000.00	608,872.80	
		0 BUND 260815	3,350,000.00	3,415,060.35	
		0 FINNISH GOVT 220415	500,000.00	506,883.25	
		0 FINNISH GOVT 230915	650,000.00	659,179.95	
		0 NETH GOVT 220115	900,000.00	912,888.90	
		0 O.A.T 200525	2,950,000.00	2,969,470.00	
		0 O.A.T 210225	7,900,000.00	7,979,533.25	
		0 O.A.T 210525	4,800,000.00	4,854,000.00	
		0 O.A.T 220525	3,400,000.00	3,445,905.10	
		0 O.A.T 230325	4,900,000.00	4,965,758.00	
		0 OBL 200417	200,000.00	201,253.00	
		0 OBL 210409	2,800,000.00	2,833,732.44	
		0 OBL 211008	3,500,000.00	3,550,846.25	
		0 OBL 220408	800,000.00	813,701.28	
		0 OBL 231013	1,500,000.00	1,531,363.50	
		0 SCHATS 200911	2,000,000.00	2,017,350.00	
		0.05 ITALY GOVT 210415	3,500,000.00	3,468,850.00	
		0.2 BEL GOVT 231022	1,300,000.00	1,328,063.10	
		0.25 BUND 270215	3,600,000.00	3,734,586.00	
		0.25 BUND 280815	2,000,000.00	2,061,356.00	
		0.25 NETH GOVT 250715	2,550,000.00	2,625,436.14	
		0.25 O.A.T 201125	4,050,000.00	4,104,099.90	
		0.25 O.A.T 261125	5,200,000.00	5,283,314.40	
0.25 OBL 201016	3,250,000.00	3,293,332.57			

0.35 ITALY GOVT 211101	400,000.00	396,539.45	
0.375 FINNISH GOV 200915	1,300,000.00	1,317,396.60	
0.4 SPAIN GOVT 220430	3,150,000.00	3,205,550.25	
0.45 ITALY GOVT 210601	1,950,000.00	1,948,397.10	
0.45 SPAIN GOVT 221031	1,500,000.00	1,529,689.50	
0.5 AUSTRIA GOVT 270420	1,400,000.00	1,449,754.04	
0.5 AUSTRIA GOVT 290220	150,000.00	153,532.89	
0.5 BUND 250215	3,050,000.00	3,208,264.50	
0.5 BUND 260215	2,950,000.00	3,114,138.29	
0.5 BUND 280215	3,250,000.00	3,433,547.00	
0.5 FINNISH GOVT 260415	700,000.00	727,542.90	
0.5 FINNISH GOVT 270915	500,000.00	517,412.15	
0.5 FINNISH GOVT 280915	200,000.00	205,739.46	
0.5 NETH GOVT 260715	900,000.00	941,786.10	
0.5 O.A.T 250525	4,100,000.00	4,260,237.02	
0.5 O.A.T 260525	2,300,000.00	2,384,060.63	
0.65 ITALY GOVT 201101	5,000,000.00	5,031,980.00	
0.65 ITALY GOVT 231015	300,000.00	290,446.20	
0.7 ITALY GOVT 200501	1,100,000.00	1,107,472.30	
0.75 AUSTRIA GOVT 261020	950,000.00	1,004,246.90	
0.75 AUSTRIA GOVT 280220	1,450,000.00	1,527,310.52	
0.75 FINNISH GOVT 310415	600,000.00	624,569.57	
0.75 NETH GOVT 270715	2,600,000.00	2,766,341.50	
0.75 NETH GOVT 280715	1,650,000.00	1,754,796.45	
0.75 O.A.T 280525	3,350,000.00	3,511,255.60	
0.75 O.A.T 281125	2,900,000.00	3,029,142.80	
0.75 SPAIN GOVT 210730	4,400,000.00	4,504,188.04	
0.8 BEL GOVT 250622	2,600,000.00	2,737,875.40	
0.8 BEL GOVT 270622	1,350,000.00	1,416,708.90	
0.8 BEL GOVT 280622	1,800,000.00	1,880,071.20	
0.8 IRISH GOVT 220315	1,200,000.00	1,239,484.80	
0.875 FINNISH GOV 250915	1,700,000.00	1,811,276.90	
0.9 IRISH GOVT 280515	700,000.00	729,592.50	
0.95 ITALY GOVT 230315	2,700,000.00	2,667,870.00	
1 BEL GOVT 260622	1,750,000.00	1,866,672.50	
1 BEL GOVT 310622	1,200,000.00	1,255,354.32	
1 BUND 240815	1,600,000.00	1,722,354.56	
1 BUND 250815	2,700,000.00	2,933,625.60	
1 IRISH GOVT 260515	1,450,000.00	1,533,364.85	
1 O.A.T 251125	2,000,000.00	2,143,954.00	
1 O.A.T 270525	3,700,000.00	3,972,371.80	
1.125 FINNISH GOV 340415	600,000.00	649,413.60	

1.15 SPAIN GOVT 200730	2,100,000.00	2,143,076.04
1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1,200,000.00	1,306,149.60
1.25 BEL GOVT 330422	550,000.00	586,932.50
1.25 BUND 480815	2,300,000.00	2,709,179.20
1.25 ITALY GOVT 261201	1,300,000.00	1,229,627.84
1.25 O.A.T 360525	5,150,000.00	5,465,695.00
1.3 IRISH GOVT 330515	950,000.00	993,388.87
1.3 SPAIN GOVT 261031	2,200,000.00	2,303,375.80
1.35 ITALY GOVT 220415	4,850,000.00	4,907,550.10
1.375 FINNISH GOV 470415	200,000.00	225,498.60
1.4 SPAIN GOVT 280730	1,400,000.00	1,455,207.60
1.45 BEL GOVT 370622	250,000.00	267,512.15
1.45 ITALY GOVT 220915	4,250,000.00	4,304,191.75
1.45 ITALY GOVT 241115	1,800,000.00	1,770,573.60
1.45 SPAIN GOVT 271031	4,450,000.00	4,679,059.30
1.45 SPAIN GOVT 290430	300,000.00	311,002.50
1.5 AUSTRIA GOVT 470220	650,000.00	725,211.50
1.5 AUSTRIA GOVT 861102	250,000.00	265,813.00
1.5 BUND 220904	2,800,000.00	2,999,096.80
1.5 BUND 230215	6,800,000.00	7,338,138.40
1.5 BUND 230515	3,700,000.00	4,009,150.54
1.5 BUND 240515	2,900,000.00	3,189,422.90
1.5 FINNISH GOVT 230415	550,000.00	592,186.10
1.5 ITALY GOVT 250601	1,580,000.00	1,545,497.54
1.5 O.A.T 310525	3,850,000.00	4,299,722.35
1.5 O.A.T 500525	400,000.00	415,538.80
1.5 SPAIN GOVT 270430	3,450,000.00	3,647,757.45
1.6 BEL GOVT 470622	1,300,000.00	1,376,492.00
1.6 ITALY GOVT 260601	2,100,000.00	2,043,501.60
1.6 SPAIN GOVT 250430	2,300,000.00	2,469,501.26
1.625 FINNISH GOV 220915	550,000.00	589,525.75
1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1,100,000.00	1,216,298.60
1.65 ITALY GOVT 320301	1,650,000.00	1,459,540.50
1.7 IRISH GOVT 370515	650,000.00	708,628.70
1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1,700,000.00	1,864,063.60
1.75 BUND 220704	2,750,000.00	2,959,684.75
1.75 BUND 240215	1,950,000.00	2,161,417.44
1.75 NETH GOVT 230715	2,350,000.00	2,568,787.82
1.75 O.A.T 230525	4,400,000.00	4,786,676.40
1.75 O.A.T 241125	2,400,000.00	2,665,860.00
1.75 O.A.T 390625	1,370,000.00	1,560,045.85
1.75 O.A.T 660525	1,600,000.00	1,715,065.60
1.85 ITALY GOVT 240515	2,100,000.00	2,122,079.40

1.9 BEL GOVT 380622	1,400,000.00	1,598,632.00	
1.95 SPAIN GOVT 260430	4,800,000.00	5,251,195.20	
1.95 SPAIN GOVT 300730	2,150,000.00	2,319,880.10	
2 BUND 220104	3,400,000.00	3,645,303.20	
2 BUND 230815	900,000.00	999,016.20	
2 FINNISH GOVT 240415	550,000.00	613,399.60	
2 IRISH GOVT 450218	1,000,000.00	1,140,651.00	
2 ITALY GOVT 251201	2,700,000.00	2,708,132.40	
2 ITALY GOVT 280201	5,450,000.00	5,338,809.10	
2 NETH GOVT 240715	2,200,000.00	2,471,640.60	
2 O.A.T 480525	3,350,000.00	3,934,722.40	
2.05 ITALY GOVT 270801	1,850,000.00	1,824,899.20	
2.1 AUSTRIA GOVT 170920	360,000.00	480,276.85	
2.15 BEL GOVT 660622	630,000.00	723,559.15	
2.15 ITALY GOVT 211215	2,600,000.00	2,693,707.90	
2.15 SPAIN GOVT 251031	3,900,000.00	4,318,961.40	
2.2 ITALY GOVT 270601	1,800,000.00	1,799,809.20	
2.25 BEL GOVT 230622	1,500,000.00	1,666,800.00	
2.25 BEL GOVT 570622	600,000.00	709,916.70	
2.25 BUND 200904	700,000.00	728,903.70	
2.25 BUND 210904	250,000.00	267,387.65	
2.25 ITALY GOVT 360901	1,200,000.00	1,078,182.00	
2.25 NETH GOVT 220715	2,550,000.00	2,783,370.90	
2.25 O.A.T 221025	4,600,000.00	5,039,431.10	
2.25 O.A.T 240525	11,350,000.00	12,821,336.82	
2.35 SPAIN GOVT 330730	3,000,000.00	3,318,999.00	
2.4 AUSTRIA GOVT 340523	900,000.00	1,131,199.20	
2.4 IRISH GOVT 300515	1,190,000.00	1,413,510.56	
2.45 ITALY GOVT 330901	2,350,000.00	2,234,236.65	
2.5 BUND 210104	4,300,000.00	4,542,332.09	
2.5 BUND 440704	3,150,000.00	4,626,536.98	
2.5 BUND 460815	1,780,000.00	2,659,807.72	
2.5 ITALY GOVT 241201	3,000,000.00	3,119,394.00	
2.5 ITALY GOVT 251115	1,100,000.00	1,133,214.50	
2.5 NETH GOVT 330115	1,800,000.00	2,330,080.38	
2.5 O.A.T 201025	3,900,000.00	4,089,852.00	
2.5 O.A.T 300525	4,850,000.00	5,957,124.05	
2.6 BEL GOVT 240622	2,900,000.00	3,324,924.82	
2.625 FINNISH GOV 420704	550,000.00	771,677.50	
2.7 ITALY GOVT 470301	2,250,000.00	1,992,695.62	
2.7 SPAIN GOVT 481031	1,150,000.00	1,267,553.57	
2.75 FINNISH GOVT 280704	540,000.00	669,937.28	

2.75 NETH GOVT 470115	2,000,000.00	3,076,586.00
2.75 O.A.T 271025	5,600,000.00	6,867,873.60
2.75 SPAIN GOVT 241031	2,900,000.00	3,294,987.83
2.8 ITALY GOVT 281201	600,000.00	618,503.40
2.8 ITALY GOVT 670301	1,400,000.00	1,171,430.40
2.9 SPAIN GOVT 461031	2,070,000.00	2,390,539.50
2.95 ITALY GOVT 380901	4,100,000.00	3,937,558.00
3 BEL GOVT 340622	800,000.00	1,050,921.60
3 BUND 200704	3,850,000.00	4,027,216.27
3 O.A.T 220425	3,000,000.00	3,320,166.00
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	850,000.00	1,275,845.75
3.25 BUND 210704	1,800,000.00	1,957,770.00
3.25 BUND 420704	3,200,000.00	5,175,007.04
3.25 ITALY GOVT 460901	2,100,000.00	2,052,170.40
3.25 NETH GOVT 210715	2,250,000.00	2,450,025.00
3.25 O.A.T 211025	4,050,000.00	4,445,178.75
3.25 O.A.T 450525	3,000,000.00	4,399,116.00
3.375 FINNISH GOV 200415	600,000.00	625,081.20
3.4 AUSTRIA GOVT 221122	2,750,000.00	3,138,624.50
3.4 IRISH GOVT 240318	1,950,000.00	2,288,433.61
3.45 ITALY GOVT 480301	1,650,000.00	1,649,925.75
3.45 SPAIN GOVT 660730	1,000,000.00	1,250,050.00
3.5 AUSTRIA GOVT 210915	1,600,000.00	1,761,304.00
3.5 FINNISH GOVT 210415	200,000.00	216,614.40
3.5 ITALY GOVT 300301	2,500,000.00	2,699,787.50
3.5 NETH GOVT 200715	1,400,000.00	1,474,993.80
3.5 O.A.T 200425	2,100,000.00	2,192,837.01
3.5 O.A.T 260425	4,500,000.00	5,641,294.50
3.65 AUSTRIA GOVT 220420	750,000.00	845,105.25
3.75 BEL GOVT 200928	2,050,000.00	2,184,115.10
3.75 BEL GOVT 450622	1,250,000.00	1,942,357.25
3.75 ITALY GOVT 210501	7,450,000.00	7,952,628.40
3.75 ITALY GOVT 210801	2,300,000.00	2,465,811.60
3.75 ITALY GOVT 240901	2,100,000.00	2,315,527.20
3.75 NETH GOVT 230115	1,350,000.00	1,569,667.27
3.75 NETH GOVT 420115	1,500,000.00	2,529,247.65
3.75 O.A.T 210425	1,200,000.00	1,307,274.00
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	650,000.00	1,225,996.20
3.8 SPAIN GOVT 240430	1,850,000.00	2,186,811.00
3.9 AUSTRIA GOVT 200715	1,370,000.00	1,449,858.67
3.9 IRISH GOVT 230320	800,000.00	932,025.28
4 BEL GOVT 220328	1,500,000.00	1,703,022.00
4 BEL GOVT 320328	1,500,000.00	2,130,753.15

4 BUND 370104	3,000,000.00	4,913,994.00	
4 FINNISH GOVT 250704	400,000.00	505,457.20	
4 ITALY GOVT 200901	3,350,000.00	3,532,658.75	
4 ITALY GOVT 370201	2,250,000.00	2,514,669.75	
4 NETH GOVT 370115	1,850,000.00	2,980,248.25	
4 O.A.T 381025	2,680,000.00	4,166,576.70	
4 O.A.T 550425	1,620,000.00	2,813,876.82	
4 O.A.T 600425	1,700,000.00	3,037,900.00	
4 SPAIN GOVT 200430	2,530,000.00	2,651,237.60	
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	1,550,000.00	2,452,084.96	
4.2 SPAIN GOVT 370131	2,430,000.00	3,367,323.41	
4.25 BEL GOVT 210928	2,100,000.00	2,352,428.40	
4.25 BEL GOVT 220928	1,800,000.00	2,097,919.80	
4.25 BEL GOVT 410328	1,850,000.00	2,958,113.18	
4.25 BUND 390704	1,350,000.00	2,366,462.25	
4.25 ITALY GOVT 200301	1,130,000.00	1,174,770.26	
4.25 O.A.T 231025	3,700,000.00	4,482,335.40	
4.4 SPAIN GOVT 231031	3,550,000.00	4,250,501.97	
4.5 BEL GOVT 260328	980,000.00	1,287,720.00	
4.5 IRISH GOVT 200418	590,000.00	621,668.84	
4.5 ITALY GOVT 230501	2,600,000.00	2,925,601.64	
4.5 ITALY GOVT 240301	1,700,000.00	1,930,707.00	
4.5 ITALY GOVT 260301	5,750,000.00	6,657,775.50	
4.5 O.A.T 410425	4,300,000.00	7,266,965.60	
4.65 SPAIN GOVT 250730	1,640,000.00	2,072,797.64	
4.7 SPAIN GOVT 410730	2,650,000.00	3,969,583.40	
4.75 BUND 280704	2,100,000.00	3,056,578.77	
4.75 BUND 340704	2,050,000.00	3,452,765.80	
4.75 BUND 400704	1,710,000.00	3,226,803.17	
4.75 ITALY GOVT 210901	1,600,000.00	1,755,755.20	
4.75 ITALY GOVT 230801	3,430,000.00	3,914,480.64	
4.75 ITALY GOVT 280901	600,000.00	721,118.40	
4.75 ITALY GOVT 440901	2,470,000.00	2,999,511.19	
4.75 O.A.T 350425	3,100,000.00	4,999,221.20	
4.8 SPAIN GOVT 240131	2,400,000.00	2,938,877.04	
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	1,400,000.00	1,885,325.82	
4.85 SPAIN GOVT 201031	2,000,000.00	2,167,432.80	
4.9 SPAIN GOVT 400730	2,050,000.00	3,130,101.95	
5 BEL GOVT 350328	2,390,000.00	3,864,217.96	
5 IRISH GOVT 201018	750,000.00	814,911.30	
5 ITALY GOVT 220301	3,650,000.00	4,078,875.00	
5 ITALY GOVT 250301	5,900,000.00	6,938,824.80	

	5 ITALY GOVT 340801	2,900,000.00	3,604,172.20
	5 ITALY GOVT 390801	1,940,000.00	2,417,822.00
	5 ITALY GOVT 400901	2,600,000.00	3,228,922.58
	5.15 SPAIN GOVT 281031	2,800,000.00	3,871,884.80
	5.15 SPAIN GOVT 441031	1,700,000.00	2,737,092.65
	5.25 ITALY GOVT 291101	4,900,000.00	6,102,435.50
	5.4 IRISH GOVT 250313	1,300,000.00	1,713,109.19
	5.4 SPAIN GOVT 230131	3,250,000.00	3,933,925.12
	5.5 BEL GOVT 280328	2,700,000.00	3,956,879.42
	5.5 BUND 310104	2,050,000.00	3,376,054.80
	5.5 ITALY GOVT 221101	5,300,000.00	6,107,115.80
	5.5 NETH GOVT 280115	1,500,000.00	2,232,225.00
	5.5 O.A.T 290425	5,800,000.00	8,813,100.00
	5.5 SPAIN GOVT 210430	3,600,000.00	4,035,608.64
	5.625 BUND 280104	1,700,000.00	2,573,461.70
	5.75 ITALY GOVT 330201	2,450,000.00	3,235,568.00
	5.75 O.A.T 321025	4,100,000.00	6,886,384.60
	5.75 SPAIN GOVT 320730	2,550,000.00	3,919,018.50
	5.85 SPAIN GOVT 220131	2,750,000.00	3,224,739.10
	5.9 SPAIN GOVT 260730	1,200,000.00	1,653,484.80
	6 ITALY GOVT 310501	3,820,000.00	5,094,222.12
	6 O.A.T 251025	4,470,000.00	6,271,097.10
	6 SPAIN GOVT 290131	3,100,000.00	4,564,190.76
	6.25 AUSTRIA GOVT 270715	950,000.00	1,440,472.65
	6.25 BUND 240104	1,000,000.00	1,322,874.00
	6.25 BUND 300104	950,000.00	1,598,034.90
	6.5 BUND 270704	2,450,000.00	3,823,494.50
	6.5 ITALY GOVT 271101	3,050,000.00	4,045,330.90
	7.25 ITALY GOVT 261101	550,000.00	746,584.85
	7.5 NETH GOVT 230115	400,000.00	522,623.60
	8.5 O.A.T 230425	1,650,000.00	2,252,248.35
	9 ITALY GOVT 231101	3,950,000.00	5,269,055.10
ユーロ合計		607,820,000.00	708,223,344.68 (87,883,434,841)
合計			228,008,259,101 (228,008,259,101)

(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 179銘柄	100.00%	46.78%
カナダドル	国債証券 27銘柄	100.00%	1.99%
オーストラリアドル	国債証券 21銘柄	100.00%	2.08%
イギリスポンド	国債証券 37銘柄	100.00%	7.03%
シンガポールドル	国債証券 17銘柄	100.00%	0.52%
スウェーデンクローネ	国債証券 8銘柄	100.00%	0.35%
ノルウェークローネ	国債証券 7銘柄	100.00%	0.23%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.00%	0.51%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.00%	0.80%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.00%	0.61%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.00%	0.55%
ユーロ	国債証券 268銘柄	100.00%	38.54%

## 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】

## 【三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）】

## 【純資産額計算書】

平成31年 3月29日現在

（単位：円）

資産総額	6,389,226,089
負債総額	31,355,539
純資産総額（ - ）	6,357,870,550
発行済口数	5,621,321,208口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.1310
（10,000口当たり）	（11,310）

（参考）

## 外国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成31年 3月29日現在

（単位：円）

資産総額	370,001,792,954
負債総額	175,463,262
純資産総額（ - ）	369,826,329,692
発行済口数	134,624,137,888口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.7471
（10,000口当たり）	（27,471）

## 日本債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成31年 3月29日現在

（単位：円）

資産総額	613,093,022,789
負債総額	8,682,358,098
純資産総額（ - ）	604,410,664,691
発行済口数	446,448,367,524口

1口当たり純資産価額（ / ）	1.3538
（10,000口当たり）	（13,538）

## 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

平成31年 3月29日現在

（単位：円）

資産総額	244,310,127,380
負債総額	4,218,281,518
純資産総額（ - ）	240,091,845,862
発行済口数	185,385,791,979口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.2951
（10,000口当たり）	（12,951）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## （1）名義書換等

該当事項はありません。

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

## （2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## （3）譲渡制限の内容

該当事項はありません。

## （4）受益権の譲渡

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### （1）資本金の額等

2019年3月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

##### （2）委託会社の機構

###### ・会社の意思決定機構

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

###### ・投資運用の意思決定機構

###### 投資環境見通しの策定

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

###### 運用戦略の決定

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

###### 運用計画の決定

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

###### ポートフォリオの構築

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

###### 投資行動のモニタリング1

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

###### 投資行動のモニタリング2

運用部から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

###### ファンドに係る法人等の管理

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

###### 運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

2019年3月29日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	890	12,798,559
追加型公社債投資信託	16	1,149,049
単位型株式投資信託	59	294,349
単位型公社債投資信託	1	6,086
合計	966	14,248,043

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

### 3【委託会社等の経理状況】

#### (1) 財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

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

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

#### (2) 監査証明について

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

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

#### (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

未払消費税等	351,670	99,010
未払法人税等	756,668	736,829
賞与引当金	843,729	906,167
役員賞与引当金	100,680	125,343
その他	711,633	842,194
流動負債合計	13,228,909	16,324,272
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	590,154	720,536
役員退職慰労引当金	166,458	187,562
時効後支払損引当金	253,070	254,851
固定負債合計	1,009,684	1,162,951
負債合計	14,238,594	17,487,223
<b>(純資産の部)</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金	3,572,096	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712	44,732,712
利益剰余金		
利益準備金	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金	43,034,713	27,790,911
利益剰余金合計	50,375,303	35,131,500
株主資本合計	97,108,147	81,864,344

(単位：千円)

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

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
営業外収益				

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

(単位：千円)

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

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

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

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

(単位：千円)

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

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

## [注記事項]

## （重要な会計方針）

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

## (2) その他有価証券

## 時価のあるもの

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

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	5年～50年
器具備品	2年～20年

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

## 3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

## 4. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

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

## (2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (4) 退職給付引当金

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

## 退職給付見込額の期間帰属方法

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

## 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

## (5) 役員退職慰労引当金

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

## (6) 時効後支払損引当金

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

## 5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

### (1) 消費税等の会計処理

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

### (2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

### (未適用の会計基準等)

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

### (1) 概要

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

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

### (2) 適用予定日

平成34年3月期の期首から適用します。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

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

## (貸借対照表関係)

### 1. 有形固定資産の減価償却累計額

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

### 2. 関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

未払費用

456,748千円

430,491千円

## (損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

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

## 2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

## 3. 減損損失

当社は、以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

当事業年度において、将来の使用見込みがなくなった自社利用ソフトウェアについて、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、回収可能価額として使用価値を用いておりますが、将来の使用見込みがないため、使用価値は零としております。

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

該当事項はありません。

## (株主資本等変動計算書関係)

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

配当金の総額	26,807,312千円
1株当たり配当額	126,700円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月29日

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの  
平成29年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

第33期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

#### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

#### 2. 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

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

配当金の総額	26,595,731千円
1株当たり配当額	125,700円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月29日

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの  
平成30年6月27日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	11,363,380千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	53,707円
基準日	平成30年3月31日
効力発生日	平成30年6月28日

#### (リース取引関係)

##### 借主側

##### オペレーティング・リース取引

##### オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
1年内	678,116千円	678,116千円
1年超	2,030,029千円	1,351,912千円
合計	2,708,145千円	2,030,029千円

#### (金融商品関係)

#### 1. 金融商品の状況に関する事項

##### (1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、譲渡性預金または投資信託に限定しており、金融機関からの資金調達は行っておりません。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

## 第32期(平成29年3月31日現在)

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

## 第33期(平成30年3月31日現在)

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

## (1) 現金及び預金、(3) 未収委託者報酬

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

## (2) 有価証券、(4) 投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

負 債

## (1) 未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第32期(平成29年3月31日現在)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	69,212,680	-	-	-
未収委託者報酬	10,076,022	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	36,210	10,703,761	8,324,138	45,606
合計	79,324,912	10,703,761	8,324,138	45,606

第33期(平成30年3月31日現在)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	54,140,307	-	-	-
未収委託者報酬	9,770,529	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	19,967	13,110,758	8,593,680	68,714
合計	63,930,804	13,110,758	8,593,680	68,714

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第32期(平成29年3月31日現在)

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

## 第33期(平成30年3月31日現在)

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

## 3.売却したその他有価証券

第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

種類	売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
株式	122,688	82,146	21,570
債券	-	-	-
その他	3,439,009	176,991	20,678
合計	3,561,698	259,137	42,248

第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

種類	売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	8,169,769	516,394	105,903
合計	8,169,769	516,394	105,903

## 4.減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について157,482千円（その他有価証券のその他157,482千円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について102,096千円（その他有価証券のその他102,096千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

(退職給付関係)

## 1.採用している退職給付制度の概要

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

## 2.確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,997,931 千円	3,649,089 千円

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

## (2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

## (4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(注)「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額等です。

## (5)年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6)数理計算上の計算基礎に関する事項

## 主要な数理計算上の計算基礎

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
割引率	0.061～0.90%	0.069～0.67%
長期期待運用収益率	1.5～1.8%	1.5～1.8%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度146,421千円、当事業年度142,105千円であります。

## ( 税効果会計関係 )

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳 第32期(平成29年3月31日現在)及び第33期(平成30年3月31日現在)

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

(セグメント情報等)

### [セグメント情報]

第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)及び第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

### [関連情報]

第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)及び第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

#### 1. 製品及びサービスごとの情報

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

#### 2. 地域ごとの情報

##### (1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

##### (2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

#### 3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

### [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

### [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

### [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## (関連当事者情報)

### 1. 関連当事者との取引

#### (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

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

親会社	(株)三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税 役員 の兼任	連結納税に 伴う支払	4,204,969 千円	その他未払金	2,071,256 千円
親会社	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 51.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払	5,983,874 千円	未払手数料	716,117 千円
						投資の助言 役員 の兼任	投資助言料	662,992 千円	未払費用	352,297 千円
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払	7,878,591 千円	未払手数料	1,276,937 千円

## 第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

種類	会社等の 名称	所在地	資本金	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	(株)三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税	連結納税に 伴う支払	3,851,587 千円	その他未払金	3,850,734 千円
親会社	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 51.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払	5,528,131 千円	未払手数料	665,262 千円
						投資の助言 役員 の兼任	投資助言料	664,152 千円	未払費用	348,142 千円

主要株主	㈱三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	5,852,112 千円	未払手数料	921,796 千円
------	------------	---------	------------------	-----	--------------------	-------------------------------	-------------------	-----------------	-------	---------------

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

連結納税については、連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。

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

## (2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

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

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

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

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

## 2. 親会社に関する注記

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

三菱UFJ信託銀行株式会社(非上場)

## (1株当たり情報)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	466,028.30円	393,935.45円
1株当たり当期純利益金額	60,318.47円	53,652.87円

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
当期純利益金額 (千円)	12,762,244	11,351,928
普通株主に帰属しない金額 (千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額 (千円)	12,762,244	11,351,928
普通株式の期中平均株式数 (株)	211,581	211,581

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第34期中間会計期間  
(平成30年9月30日現在)

## (資産の部)

## 流動資産

現金及び預金	46,097,117
有価証券	3,465,878

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

(単位：千円)

第34期中間会計期間  
(平成30年9月30日現在)

## (負債の部)

## 流動負債

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

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

(単位：千円)

第34期中間会計期間  
(平成30年9月30日現在)

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

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

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

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

(単位：千円)

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

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

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

(単位：千円)

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,484,913	1,484,913	83,349,257
当中間期変動額			
剰余金の配当			11,363,380
中間純利益			5,253,606
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	17,659	17,659	17,659
当中間期変動額合計	17,659	17,659	6,127,434
当中間期末残高	1,467,253	1,467,253	77,221,823

**[重要な会計方針]**

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

## (2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産及び投資不動産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5年～50年

器具備品 2年～20年

投資不動産 3年～47年

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

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

## (2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (4) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

## (5) 役員退職慰労引当金

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

## (6) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に

備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

#### 4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

#### 5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

##### (2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

### [表示方法の変更]

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示する方法に変更しております。

### [注記事項]

（中間貸借対照表関係）

#### 1 減価償却累計額

	第34期中間会計期間 (平成30年9月30日現在)
建物	524,318千円
器具備品	1,274,989千円
投資不動産	133,640千円

#### 2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

（中間損益計算書関係）

#### 1 減価償却実施額

	第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)
有形固定資産	111,368千円
無形固定資産	483,858千円
投資不動産	724千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第34期中間会計期間（自平成30年4月1日至平成30年9月30日）

#### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 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

平成30年6月27日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	11,363,380千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	53,707円
基準日	平成30年3月31日
効力発生日	平成30年6月28日

## (リース取引関係)

第34期中間会計期間(平成30年9月30日現在)

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

1年内	677,036千円
1年超	1,013,934千円
合計	1,690,971千円

## (金融商品関係)

第34期中間会計期間(平成30年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成30年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。

	中間貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	46,097,117	46,097,117	-
(2) 有価証券	3,465,878	3,465,878	-
(3) 未収委託者報酬	10,467,520	10,467,520	-
(4) 投資有価証券	21,061,547	21,061,547	-
資産計	81,092,063	81,092,063	-
(1) 未払手数料	4,195,495	4,195,495	-
負債計	4,195,495	4,195,495	-

## (注1)金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

## 資 産

## (1)現金及び預金、(3)未収委託者報酬

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

## (2)有価証券、(4)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

## 負 債

## (1)未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式(中間貸借対照表計上額137,160千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## (注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

## (有価証券関係)

第34期中間会計期間(平成30年9月30日現在)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	17,134,450	14,614,710	2,519,740
	小計	17,134,450	14,614,710	2,519,740
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	7,392,975	7,797,908	404,933
	小計	7,392,975	7,797,908	404,933
合計		24,527,425	22,412,618	2,114,807

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額137,160千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難であると認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## (セグメント情報等)

## [セグメント情報]

第34期中間会計期間(自平成30年4月1日至平成30年9月30日)

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## [関連情報]

第34期中間会計期間(自平成30年4月1日至平成30年9月30日)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

### 3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第34期中間会計期間 (平成30年9月30日現在)
1株当たり純資産額	364,975.22円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	77,221,823
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	77,221,823
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	211,581

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)
1株当たり中間純利益金額	24,830.23円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	5,253,606
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	5,253,606
普通株式の期中平均株式数(株)	211,581

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

### 4【利害関係人との取引制限】

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

自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業

者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

## 5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円(2018年9月末現在)

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

名称	資本金の額 (2018年9月末現在)	事業の内容
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社北國銀行	26,673 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社滋賀銀行	33,076 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社南都銀行	37,924 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社紀陽銀行	80,096 百万円	銀行業務を営んでいます。
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社みずほ銀行	1,404,065 百万円	銀行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】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。(2019年3月末現在)

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%(211,581株)を所有しています。

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

### 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2018年 6月25日	有価証券届出書
2018年 6月25日	有価証券報告書
2018年12月25日	有価証券届出書の訂正届出書
2018年12月25日	半期報告書

# 独立監査人の監査報告書

平成30年6月27日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	弥永 めぐみ	印
--------------------	-------	--------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	青木 裕晃	印
--------------------	-------	-------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の平成30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

(注) 上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成31年4月24日

三菱UFJ国際投信株式会社  
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）の平成30年3月27日から平成31年3月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**監査意見**

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）の平成31年3月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**利害関係**

三菱UFJ国際投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成30年12月3日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

## 有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員  
公認会計士 青木 裕 晃 印

業務執行社員

指定有限責任社員  
公認会計士 伊藤 鉄 也 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の平成30年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

---

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは中間監査の対象に含まれていません。