

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年8月10日提出
【発行者名】	三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 横川 直
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目１２番１号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【電話番号】	03-6250-4740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三菱ＵＦＪ ＤＣ海外株式インデックスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	１兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

三菱ＵＦＪ ＤＣ海外株式インデックスファンド（「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

１兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

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

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

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

なお、便宜上１万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

１円以上１円単位

（７）【申込期間】

2021年 8月11日から2022年 8月10日まで

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

（８）【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、確定拠出年金制度を利用する場合の申込みに限り取り扱うものとします。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

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

（ ９ ）【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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

（ １ ０ ）【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

（ １ １ ）【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

（ １ ２ ）【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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
		債券		
	海外	不動産投信	MRF	
追加型	内外	その他資産 （ ）	ETF	特殊型 （ ）
		資産複合		

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株	年１回 年２回 年４回 年６回	グローバル （日本を除く）	ファミリー ファンド	あり （ ）	日経２２５	ブル・ベア型
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 （ ）	（隔月） 年１２回 （毎月） 日々 その他 （ ）	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
不動産投信 その他資産（投資信託証券（株式一般）） 資産複合 （ ）					その他 （MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース））	ロング・ショート型／絶対収益追求型 その他 （ ）

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

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源

泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

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

商品分類の定義

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

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

属性区分の定義

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

	公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（ＢＢＢ格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（ＢＢ格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年１回	信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年２回	信託約款において、年２回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年４回	信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年６回（隔月）	信託約款において、年６回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回（毎月）	信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。

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

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

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

日本を除く世界の主要国の株式を実質的な主要投資対象とし、日本を除く世界の主要国の株式の指標であるMSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)と連動する投資成果をめざします。

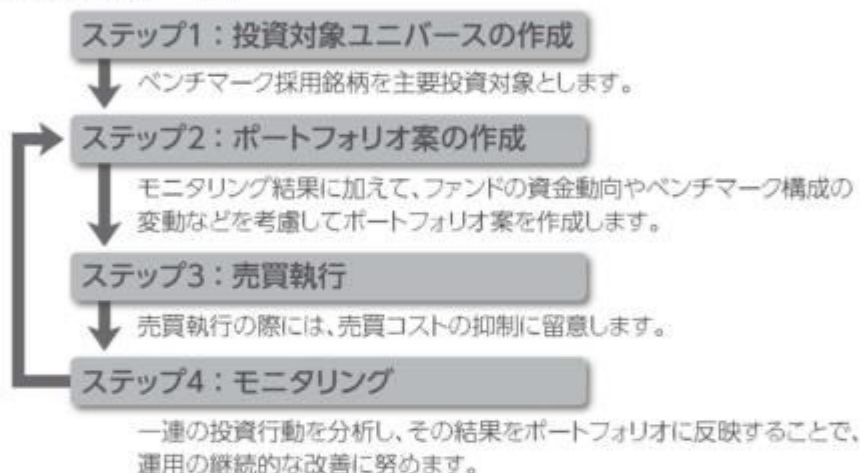
ファンドの特色

特色1

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

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)をベンチマークとします。

＜運用プロセスのイメージ＞



■ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。
☞ 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ (<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>) でご覧いただけます。

特色2

「外国株式インデックスマザーファンド」を通じて、日本を除く世界の主要国の株式への投資を行います。

外国株式インデックスマザーファンドの株式の実質投資比率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。

特色3

原則として、為替ヘッジは行いません。

為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

■ファンドの仕組み

運用は主に外国株式インデックスマザーファンドへの投資を通じて、日本を除く世界の主要国の株式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。
- ・同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。
- ・外貨建資産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(5月12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。

(注)MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。

当ファンドは、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数は、MSCI Inc.が独占的に所有しています。MSCI Inc.およびMSCI指数は、MSCI Inc.およびその関係会社のサービスマークであり、委託会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラッキングしているMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であると問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCI Inc.とその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指数は、当ファンドまたは当ファンドの委託会社あるいは受益者に問わず、MSCI Inc.により決定、作成、および計算されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数の決定、作成、あるいは計算において、当ファンドの委託会社または受益者の要求を考慮にいれる義務は一切ありません。

MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの募集等に関する事項の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定または計算について責任を負うものではなく、参加しておりません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

MSCI Inc.は、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的にも黙示的にも、被許諾者、その顧客または相手方、当ファンドの委託会社、当ファンドの受益者その他の個人・法人が、契約にもとづき許諾される権利またはその他使用のために許諾される権利に関連してMSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行うものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数およびそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。MSCI指数およびそれに含まれるデータに関し、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、特定目的のための市場性または適切性について、何ら保証を行うものではないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、並大損害その他のあらゆる損害(逸失利益を含む。)につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、または受益者あるいはいかなる個人・法人は、MSCI Inc.の許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCI Inc.に問い合わせることなく、当ファンドを保証、推奨、売買、または宣伝するためにいかなるMSCI Inc.のトレードネーム、トレードマーク、またはサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCI Inc.の書面による許諾を得ることなくMSCI Inc.との関係を一切主張することはできません。

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。

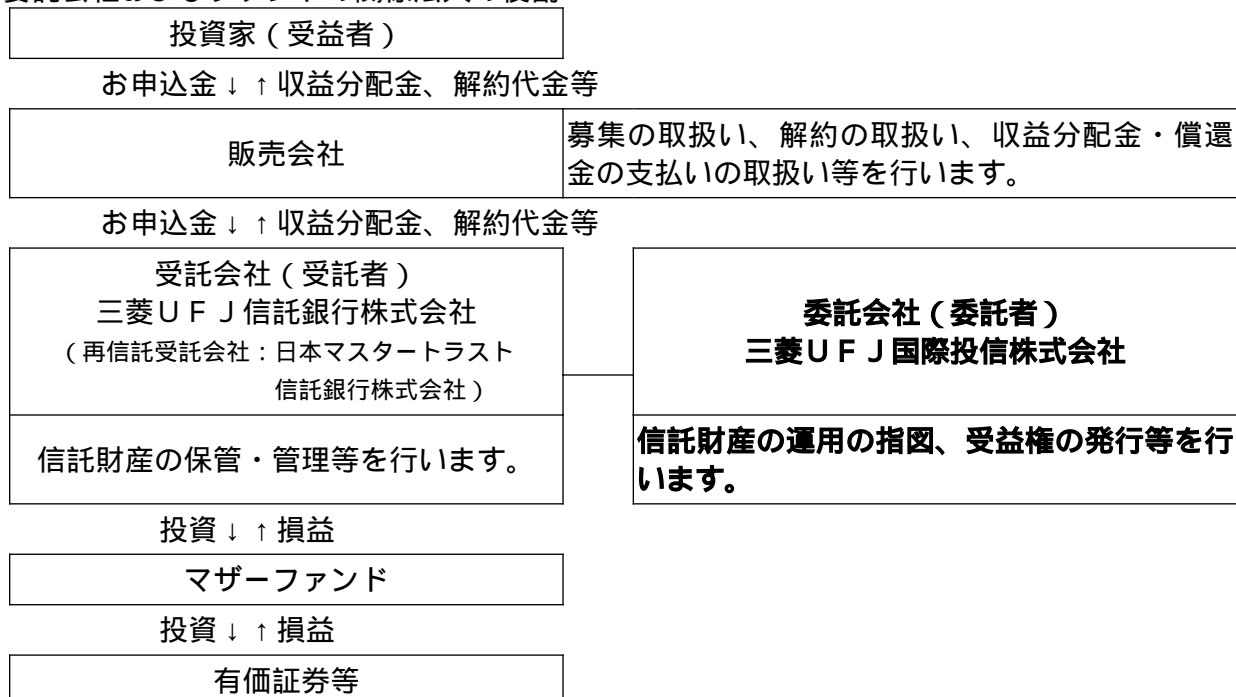
(2) 【ファンドの沿革】

2006年5月15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



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（2021年5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】

外国株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界各国の株式に直接投資することがあります。

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。

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

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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。

（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。

ａ．有価証券先物取引等

ｂ．スワップ取引

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外国株式インデックスマザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

１．株券または新株引受権証書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

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

１１．コマーシャル・ペーパー

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

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

を有するもの

14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16.において同じ。）で16.で定めるものの以外のもの
16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16.において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りまゝす。）
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ゝす。）
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つ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つ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

<外国株式インデックスマザーファンドの概要>

（基本方針）

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

（運用方法）

投資対象

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

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。

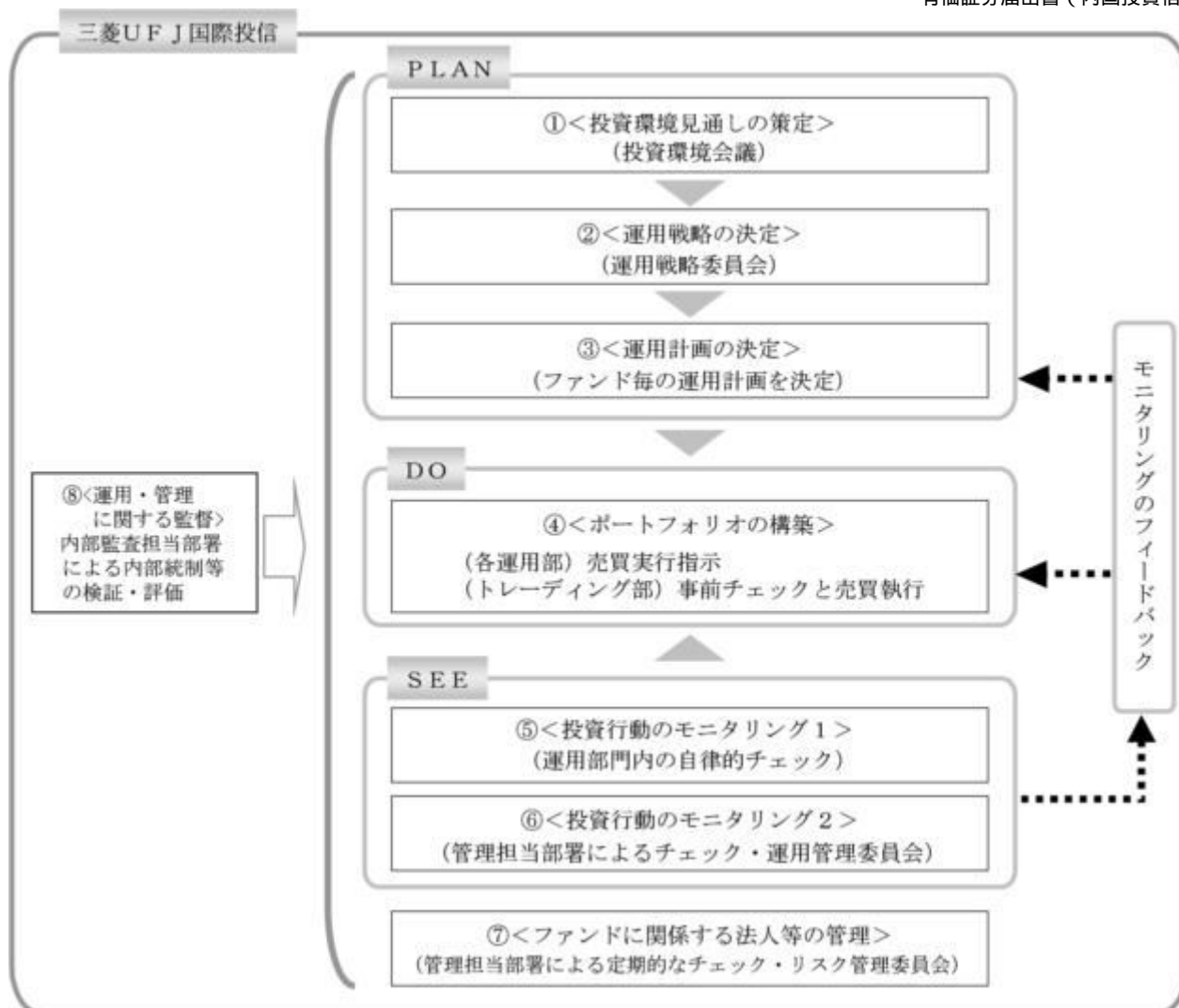
スワップ取引を行うことができます。

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。

（３）【運用体制】



投資環境見通しの策定

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

投資行動のモニタリング1

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

投資行動のモニタリング2

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

ファンドに關係する法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に關係する法人については、その業務に關係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・管理に關係する監督

内部監査担当部署（10名程度）は、運用、管理等に關係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（マザーファンドの受益証券を除きます。以下同じ。）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。

同一銘柄の株式

同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。

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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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、）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

有価証券の借入れを行いません。

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。

有価証券の貸付

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

デリバティブ取引等

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

信用リスクの分散規制

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

< その他法令等に定められた投資制限 >

- ・ 同一の法人の発行する株式への投資制限

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

3【投資リスク】

（１）投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

（主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。）

価格変動リスク

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するため、当ファンドはその影響を受け株式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

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

信用リスク

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

流動性リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない、または取引が不可能となるリスクのことを流動性リスクといい、当ファンドはそのリスクを伴います。例えば、組み入れている株式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。
- ・当ファンドは、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動することをめざして運用を行います。信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、株価指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比の違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因により乖離を生じることがあります。

（２）投資リスクに対する管理体制

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

また、定期的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。

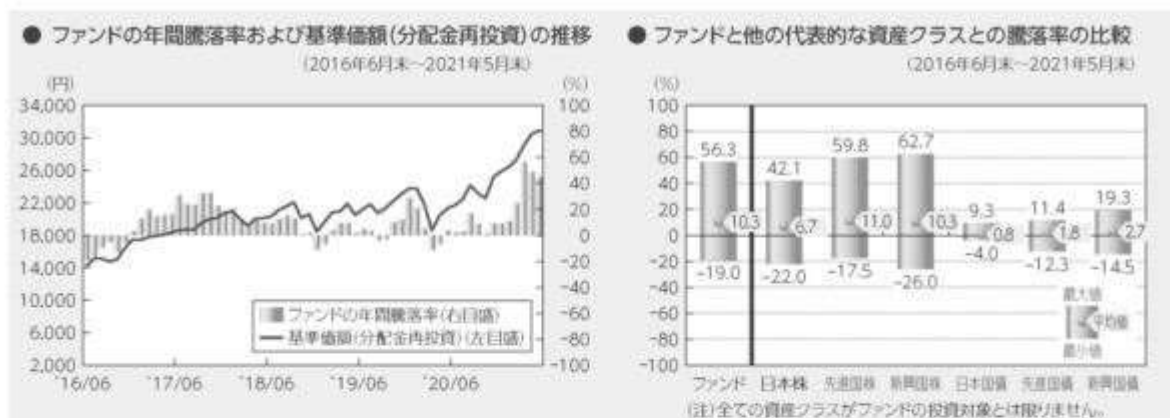
<流動性リスクに対する管理体制>

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	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	東証株価指数(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で、わが国の株式市場全体の動きを表す株価指数です。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。
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(国債)のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
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	JPMorgan GBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPMorgan GBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当該指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

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

（２）【換金（解約）手数料】

かかりません。

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

（３）【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年0.231%（税抜0.21%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

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

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

- ・信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.065%	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	0.09%	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	0.055%	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、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（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、）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。

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

個別元本について

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2021年5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。

【三菱ＵＦＪ ＤＣ海外株式インデックスファンド】

（１）【投資状況】

令和 3年 5月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	85,384,233,676	99.99
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	4,307,932	0.01
純資産総額		85,388,541,608	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

令和 3年 5月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	20,972,228,447	3.9589	83,028,992,222	4.0713	85,384,233,676	99.99

（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

令和 3年 5月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

（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令和3年5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6計算期間末日（平成24年 5月14日）	1,390,131,776	1,390,131,776	7,691	7,691
第7計算期間末日（平成25年 5月13日）	2,536,679,131	2,536,679,131	12,014	12,014
第8計算期間末日（平成26年 5月12日）	3,852,243,552	3,852,243,552	14,024	14,024
第9計算期間末日（平成27年 5月12日）	8,885,698,370	8,885,698,370	17,753	17,753
第10計算期間末日（平成28年 5月12日）	11,542,468,821	11,542,468,821	15,149	15,149
第11計算期間末日（平成29年 5月12日）	18,664,580,996	18,664,580,996	18,621	18,621
第12計算期間末日（平成30年 5月14日）	27,246,040,936	27,246,040,936	20,475	20,475
第13計算期間末日（令和 1年 5月13日）	36,345,311,034	36,345,311,034	21,145	21,145
第14計算期間末日（令和 2年 5月12日）	44,634,586,604	44,634,586,604	20,419	20,419
第15計算期間末日（令和 3年 5月12日）	81,181,542,318	81,181,542,318	30,046	30,046
令和 2年 5月末日	47,764,173,099	—	21,310	—
6月末日	49,547,734,496	—	21,715	—
7月末日	51,816,184,500	—	22,434	—
8月末日	56,206,155,242	—	24,150	—
9月末日	55,300,339,821	—	23,197	—
10月末日	54,522,252,247	—	22,546	—
11月末日	60,269,739,163	—	25,139	—
12月末日	63,447,889,884	—	25,859	—
令和 3年 1月末日	66,702,824,885	—	26,387	—
2月末日	69,448,777,920	—	27,279	—
3月末日	76,608,824,740	—	29,100	—
4月末日	81,841,286,344	—	30,459	—
5月末日	85,388,541,608	—	30,903	—

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第6計算期間	0円
第7計算期間	0円
第8計算期間	0円
第9計算期間	0円
第10計算期間	0円
第11計算期間	0円
第12計算期間	0円

第13計算期間	0円
第14計算期間	0円
第15計算期間	0円

【収益率の推移】

	収益率（％）
第6計算期間	7.03
第7計算期間	56.20
第8計算期間	16.73
第9計算期間	26.59
第10計算期間	14.66
第11計算期間	22.91
第12計算期間	9.95
第13計算期間	3.27
第14計算期間	3.43
第15計算期間	47.14

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第6計算期間	866,157,008	377,223,701	1,807,534,565
第7計算期間	897,291,597	593,393,895	2,111,432,267
第8計算期間	1,302,992,997	667,520,686	2,746,904,578
第9計算期間	3,434,566,005	1,176,278,340	5,005,192,243
第10計算期間	3,938,398,553	1,324,507,024	7,619,083,772
第11計算期間	4,098,128,352	1,693,541,631	10,023,670,493
第12計算期間	5,277,344,743	1,994,334,467	13,306,680,769
第13計算期間	6,466,390,819	2,584,465,681	17,188,605,907
第14計算期間	9,214,536,771	4,543,571,103	21,859,571,575
第15計算期間	10,890,278,052	5,730,319,502	27,019,530,125

（参考）

外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

令和 3年 5月31日現在

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	アメリカ	684,610,932,525	67.40
	イギリス	45,677,062,861	4.50
	カナダ	35,779,311,654	3.52
	フランス	33,731,754,987	3.32
	スイス	30,135,059,696	2.97
	ドイツ	29,622,604,805	2.92
	オーストラリア	21,453,982,961	2.11
	オランダ	17,560,909,589	1.73
	スウェーデン	11,997,165,556	1.18
	香港	9,733,218,138	0.96
	スペイン	8,297,357,270	0.82
	デンマーク	8,025,626,071	0.79
	イタリア	5,992,554,796	0.59
	フィンランド	3,320,714,409	0.33
	シンガポール	2,968,391,086	0.29
	ベルギー	2,804,275,194	0.28
	アイルランド	2,246,888,412	0.22
	ノルウェー	1,979,198,777	0.19
	イスラエル	1,064,703,159	0.10
	ルクセンブルグ	1,025,514,206	0.10
	ニュージーランド	706,923,141	0.07
	オーストリア	649,050,664	0.06
	ポルトガル	510,004,434	0.05
	小計	959,893,204,391	94.51
投資証券	アメリカ	18,205,451,566	1.79
	オーストラリア	1,363,692,105	0.13
	イギリス	571,321,519	0.06
	シンガポール	417,193,087	0.04
	香港	354,874,478	0.03
	フランス	344,132,485	0.03
	オランダ	189,459,418	0.02
	カナダ	134,204,829	0.01
	小計	21,580,329,487	2.12
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	34,196,056,250	3.37
純資産総額		1,015,669,590,128	100.00

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	23,155,022,284	2.28
	買建	カナダ	1,208,078,121	0.12
	買建	ドイツ	4,154,531,457	0.41
	買建	オーストラリア	1,259,237,612	0.12
	買建	イギリス	1,300,499,354	0.13
	買建	スイス	961,131,125	0.09

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

令和 3年 5月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2,822,434	13,812.19	38,984,018,379	13,677.19	38,602,976,241	3.80
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1,204,443	27,008.64	32,530,371,242	27,404.87	33,007,612,028	3.25
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	71,955	353,693.21	25,449,995,616	353,764.16	25,455,100,363	2.51
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	69,341	248,885.82	17,257,992,039	258,687.85	17,937,674,623	1.77
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	404,896	33,635.47	13,618,870,577	36,081.40	14,609,216,478	1.44
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	513,383	17,398.77	8,932,236,008	18,026.98	9,254,746,305	0.91
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	129,117	67,696.98	8,740,830,999	68,624.14	8,860,544,014	0.87
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	31,126	253,409.49	7,887,624,023	264,692.82	8,238,828,890	0.81
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	441,070	18,534.07	8,174,823,843	18,576.88	8,193,704,462	0.81
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	104,283	62,759.46	6,544,745,783	71,319.85	7,437,448,210	0.73
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	230,797	31,344.43	7,234,201,063	31,768.93	7,332,174,753	0.72
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	159,581	45,173.85	7,208,889,083	45,212.33	7,215,030,302	0.71
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	285,036	24,737.12	7,050,970,742	24,948.44	7,111,205,824	0.70

スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	484,823	13,196.02	6,397,735,643	13,546.63	6,567,722,257	0.65
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	181,320	36,261.84	6,574,997,640	35,003.56	6,346,845,789	0.62
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	413,199	15,031.63	6,211,055,311	14,801.13	6,115,814,594	0.60
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,311,182	4,561.80	5,981,357,724	4,652.72	6,100,571,107	0.60
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	304,838	19,931.58	6,075,904,519	19,608.62	5,977,453,723	0.59
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	149,001	40,322.53	6,008,097,471	39,577.26	5,897,051,436	0.58
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	187,540	27,266.01	5,113,467,778	28,539.79	5,352,353,192	0.53
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	70,751	68,805.21	4,868,037,964	73,864.60	5,225,994,456	0.51
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	768,504	6,309.24	4,848,678,956	6,293.63	4,836,686,285	0.48
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	711,968	6,649.03	4,733,898,109	6,406.69	4,561,359,120	0.45
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	117,749	36,426.83	4,289,222,967	38,474.79	4,530,368,754	0.45
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	80,842	53,222.47	4,302,611,633	55,382.70	4,477,248,298	0.44
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	697,290	6,425.04	4,480,120,413	6,200.34	4,323,436,752	0.43
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	683,100	6,037.89	4,124,487,851	6,269.49	4,282,689,439	0.42
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	687,355	5,961.51	4,097,673,879	6,068.63	4,171,303,449	0.41
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	711,121	5,795.72	4,121,458,395	5,806.30	4,128,984,707	0.41
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	74,459	54,316.19	4,044,329,805	55,188.42	4,109,274,982	0.40

（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

令和 3年 5月31日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	エネルギー	3.19
	素材	4.46
	資本財	6.49
	商業・専門サービス	1.18
	運輸	2.10
	自動車・自動車部品	1.90
	耐久消費財・アパレル	1.97

	消費者サービス	1.87
	メディア・娯楽	7.01
	小売	5.27
	食品・生活必需品小売り	1.31
	食品・飲料・タバコ	3.89
	家庭用品・パーソナル用品	1.74
	ヘルスケア機器・サービス	4.99
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.15
	銀行	6.33
	各種金融	4.67
	保険	3.14
	不動産	0.43
	ソフトウェア・サービス	11.18
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.29
	電気通信サービス	1.70
	公益事業	2.89
	半導体・半導体製造装置	4.33
小計		94.51
投資証券	—	2.12
合計		96.63

（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

令和 3年 5月31日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2106	買建	1,004	アメリカドル	208,566,070.76	22,892,211,926	210,960,480	23,155,022,284	2.28
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602106	買建	56	カナダドル	13,009,856.25	1,181,425,045	13,303,360	1,208,078,121	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 2106	買建	764	ユーロ	30,306,203	4,053,151,589	31,064,240	4,154,531,457	0.41
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2106	買建	83	オーストラリアドル	14,636,923.75	1,237,991,010	14,888,125	1,259,237,612	0.12
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2106	買建	119	イギリスポンド	8,298,891.4	1,291,307,502	8,357,965	1,300,499,354	0.13

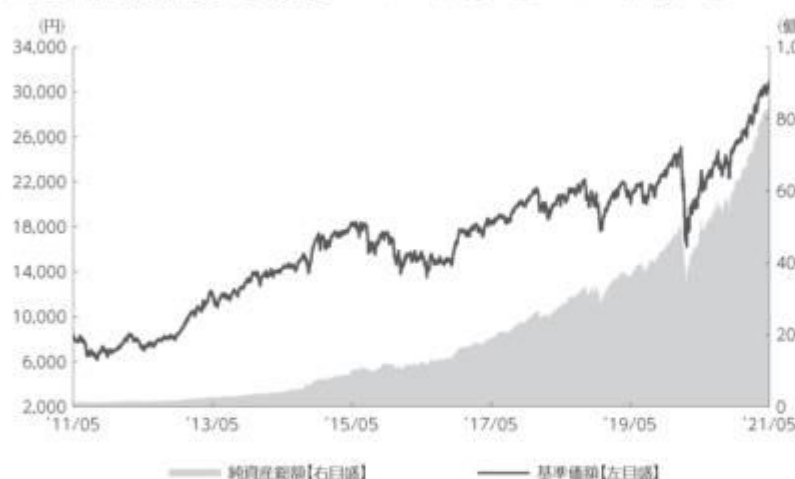
スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS 1X2106	買建	69	スイスフラン	7,664,594	934,390,654	7,883,940	961,131,125	0.09
-----	------------------	--------------	----	----	--------	-----------	-------------	-----------	-------------	------

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

参考情報



■基準価額・純資産の推移 2011年5月31日～2021年5月31日



・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	30,903円
純資産総額	853.8億円

・純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2021年5月	0円
2020年5月	0円
2019年5月	0円
2018年5月	0円
2017年5月	0円
2016年5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

組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
1 アメリカドル	71.5%	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	3.8%
2 ユーロ	10.8%	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	3.2%
3 イギリスポンド	4.7%	3 AMAZON.COM INC	小売	アメリカ	2.5%
4 カナダドル	3.7%	4 ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	アメリカ	1.8%
5 スイスフラン	3.1%	5 FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	アメリカ	1.4%
6 オーストラリアドル	2.3%	6 JPMORGAN CHASE & CO	銀行	アメリカ	0.9%
7 スウェーデンクローネ	1.2%	7 TESLA INC	自動車・自動車部品	アメリカ	0.9%
8 香港ドル	1.0%	8 ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	アメリカ	0.8%
9 デンマーククローネ	0.8%	9 JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	アメリカ	0.8%
10 シンガポールドル	0.3%	10 NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	アメリカ	0.7%

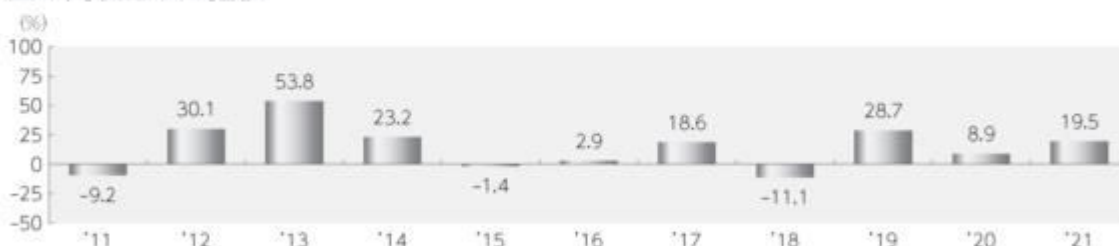
その他資産の状況	比率
株価指数先物取引（買建）	3.2%

・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率（小数点第二位四捨五入）

・外国株式の業種は、GICS（世界産業分類基準）によるもの。Global Industry Classification Standard（“GICS”）は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。

・「国・地域」は原則、発行通貨ベースで分類しています。（ただし、発行通貨がユーロの場合は発行地）

■年間収益率の推移



・収益率は基準価額で計算

・2021年は年初から5月31日までの収益率を表示

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。
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

ロンドン証券取引所の休業日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

申込単位

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

ロンドン証券取引所の休業日

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

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ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

支払開始日

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

解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。

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。

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（2006年5月15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５月13日から翌年５月12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30億口を下回ることとなった場合
- ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃されたときまたはやむを得ない事情が発生したとき

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

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

信託約款の変更

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ができます。委託会社は、信託約款を変更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。

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または信託約款の変更のうち重大な内容の変更を行おうとする場合、あらかじめその旨およびその内容を公告し、かつ、原則としてこれらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。この公告および書面には、原則として、受益者で異議のあるものは一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。

異議申立ておよび反対者の買取請求権

受益者は、委託会社がファンドの任意償還または信託約款について重大な内容の変更を行おうとする場合、原則として、一定の期間（１ヵ月以上）内に委託会社に対して異議を述べるすることができます。異議を述べた受益者は、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。なお、一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の２分の１を超えるときは、ファンドの償還または信託約款の変更を行いません。その場合、償還しない旨または信託約款を変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、原則として、これらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。

関係法人との契約の更改

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

運用報告書

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

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。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。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应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、償還金を持ち分に应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（令和2年5月13日から令和3年5月12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海外株式インデックスファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 [令和 2年 5月12日現在]	第15期 [令和 3年 5月12日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	110,827,371	286,680,483
親投資信託受益証券	44,629,187,079	81,171,569,323
流動資産合計	44,740,014,450	81,458,249,806
資産合計	44,740,014,450	81,458,249,806
負債の部		
流動負債		
未払解約金	55,181,213	196,981,015
未払受託者報酬	13,159,833	20,880,736
未払委託者報酬	37,086,735	58,845,646
未払利息	65	91
流動負債合計	105,427,846	276,707,488
負債合計	105,427,846	276,707,488
純資産の部		
元本等		
元本	21,859,571,575	27,019,530,125
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	22,775,015,029	54,162,012,193
（分配準備積立金）	4,672,193,671	23,162,830,810
元本等合計	44,634,586,604	81,181,542,318
純資産合計	44,634,586,604	81,181,542,318
負債純資産合計	44,740,014,450	81,458,249,806

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期 自 令和 1年 5月14日 至 令和 2年 5月12日	第15期 自 令和 2年 5月13日 至 令和 3年 5月12日
営業収益		
受取利息	932	800
有価証券売買等損益	1,462,688,427	23,662,864,531
営業収益合計	1,462,687,495	23,662,865,331
営業費用		
支払利息	55,664	43,131
受託者報酬	24,867,233	36,949,002
委託者報酬	70,080,242	104,128,876
その他費用	207	-
営業費用合計	95,003,346	141,121,009
営業利益又は営業損失（ ）	1,557,690,841	23,521,744,322
経常利益又は経常損失（ ）	1,557,690,841	23,521,744,322
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,557,690,841	23,521,744,322
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（ ）	29,195,133	2,206,715,726
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	19,156,705,127	22,775,015,029
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,319,689,590	16,350,929,773
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,319,689,590	16,350,929,773
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,114,493,714	6,278,961,205
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,114,493,714	6,278,961,205
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	22,775,015,029	54,162,012,193

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

第15期〔令和 3年 5月12日現在〕

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

（貸借対照表に関する注記）

	第14期 〔令和 2年 5月12日現在〕	第15期 〔令和 3年 5月12日現在〕
１．期首元本額	17,188,605,907円	21,859,571,575円
期中追加設定元本額	9,214,536,771円	10,890,278,052円
期中一部解約元本額	4,543,571,103円	5,730,319,502円
２．受益権の総数	21,859,571,575口	27,019,530,125口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第14期 自 令和 1年 5月14日 至 令和 2年 5月12日			第15期 自 令和 2年 5月13日 至 令和 3年 5月12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	740,031,244円	費用控除後の配当等収益額	A	1,009,745,089円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	—円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	18,471,946,196円
収益調整金額	C	28,458,728,036円	収益調整金額	C	37,289,394,968円
分配準備積立金額	D	3,932,162,427円	分配準備積立金額	D	3,681,139,525円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	33,130,921,707円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	60,452,225,778円
当ファンドの期末残存口数	F	21,859,571,575口	当ファンドの期末残存口数	F	27,019,530,125口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	15,156円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	22,373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14期 自 令和 1年 5月14日 至 令和 2年 5月12日	第15期 自 令和 2年 5月13日 至 令和 3年 5月12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14期 [令和 2年 5月12日現在]	第15期 [令和 3年 5月12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14期 [令和 2年 5月12日現在]	第15期 [令和 3年 5月12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14期 [令和 2年 5月12日現在]	第15期 [令和 3年 5月12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	1,456,964,550	23,341,062,234
合計	1,456,964,550	23,341,062,234

（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14期 [令和 2年 5月12日現在]	第15期 [令和 3年 5月12日現在]
1口当たり純資産額	2.0419円	3.0046円
(1万口当たり純資産額)	(20,419円)	(30,046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	外国株式インデックスマザーファンド	20,508,746,892	81,171,569,323	
合 計		20,508,746,892	81,171,569,323	

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。

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）

[令和 3年 5月12日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	34,263,735,631
コール・ローン	4,185,927,670
株式	910,617,839,305
投資証券	20,522,755,990
派生商品評価勘定	198,207,948
未収入金	55,002,784
未収配当金	924,633,049
差入委託証拠金	6,054,190,780
流動資産合計	976,822,293,157
資産合計	976,822,293,157
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	172,853,503
未払解約金	1,944,982,011

[令和 3年 5月12日現在]

未払利息	1,330
流動負債合計	2,117,836,844
負債合計	2,117,836,844
純資産の部	
元本等	
元本	246,268,186,550
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	728,436,269,763
元本等合計	974,704,456,313
純資産合計	974,704,456,313
負債純資産合計	976,822,293,157

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。 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。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

[令和 3年 5月12日現在]

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

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 3年 5月12日現在]
1. 期首	令和 2年 5月13日
期首元本額	167,638,526,747円
期中追加設定元本額	185,745,725,184円
期中一部解約元本額	107,116,065,381円
元本の内訳	
MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信	3,416,687,960円
MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信	1,285,897,035円
ファンド・マネジャー（海外株式）	20,439,931円

	[令和 3年 5月12日現在]
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,790,460,894円
eMAXIS バランス（８資産均等型）	1,132,504,858円
eMAXIS バランス（波乗り型）	351,399,486円
コアバランス	269,922円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３０（確定拠出年金）	56,035,368円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４０（確定拠出年金）	90,585,707円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５０（確定拠出年金）	68,574,877円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	50,368,175,243円
海外株式セレクション（ラップ向け）	1,307,902,868円
eMAXIS Slim バランス（８資産均等型）	2,865,009,626円
つみたて先進国株式	8,357,039,506円
つみたて８資産均等バランス	1,329,705,952円
つみたて４資産均等バランス	379,269,258円
eMAXIS マイマネージャー １９７０s	1,345,457円
eMAXIS マイマネージャー １９８０s	1,717,527円
eMAXIS マイマネージャー １９９０s	2,319,496円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３５（確定拠出年金）	45,263,278円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４５（確定拠出年金）	41,372,965円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５５（確定拠出年金）	23,967,745円
eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）	12,612,830,719円
eMAXIS Slim 全世界株式（３地域均等型）	296,054,153円
eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）	34,590,174,483円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）	29,931,647円
先進国株式インデックスファンド（ラップ向け）	20,114,132,393円
つみたて全世界株式	14,552,504円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６５（確定拠出年金）	2,519,586円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	254,355円
三菱ＵＦＪ DC海外株式インデックスファンド	20,508,746,892円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,827,986,334円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	1,271,871,587円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	2,467,113,270円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	556,924,258円
三菱ＵＦＪ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	650,244,282円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	403,312,685円
eMAXIS バランス（４資産均等型）	229,633,770円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	62,445,629円

	[令和 3年 5月12日現在]
e M A X I S 最適化バランス（マイディフェンダー）	73,291,308円
e M A X I S 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	285,904,831円
e M A X I S 最適化バランス（マイフォワード）	210,299,370円
e M A X I S 最適化バランス（マイストライカー）	441,522,115円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,456,290円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,407,533,226円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	91,257,452円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	1,130,784,389円
M U A M 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	16,571,572,936円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	775,512円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	959,924,620円
M U A M 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	7,504,341,837円
アドバンスト・バランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	14,403,742円
アドバンスト・バランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	81,878,730円
M U K A M バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	2,824,609,147円
M U K A M バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	1,061,586,335円
M U K A M 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）	414,178,963円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	51,428,334円
M U K A M 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	2,605,596,959円
M U K A M 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）	99,228,362円
M U K A M 外国株式インデックスファンド２（適格機関投資家限定）	2,256,201,493円
M U K A M スマート・クオリティ・セレクション２（適格機関投資家限定）	322,819,066円
M U K A M 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	11,813,983,023円
M U K A M バランス・イノベーション（リスク抑制型）２（適格機関投資家転売制限付）	94,665,094円
マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）	130,639円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンド	1,976,772,154円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	1,032,438円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	3,835,535円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	2,546,685円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	4,067,253円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンドＶＡ	35,674,585円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	5,226,527円

	[令和 3年 5月12日現在]
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	30,214,632円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	6,575,424円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	32,137,457円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞外国株式インデックスファンド	5,574,861,040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）	129,912,766円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	526,062,487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）	528,304,272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）	498,916,016円
合計	246,268,186,550円
2. 受益権の総数	246,268,186,550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 令和 2年 5月13日 至 令和 3年 5月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、新株予約権証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

区分	自 令和 2年 5月13日 至 令和 3年 5月12日
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	[令和 3年 5月12日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[令和 3年 5月12日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	201,483,241,214
投資証券	3,550,402,028
合計	205,033,643,242

(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

[令和 3年 5月12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	44,115,552,262	—	44,144,519,397	28,967,135
合計		44,115,552,262	—	44,144,519,397	28,967,135

（注）時価の算定方法

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

通貨関連

[令和 3年 5月12日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	2,323,590,396	—	2,320,787,708	2,802,688
	カナダドル	122,679,334	—	122,540,675	138,659
	オーストラリアドル	50,144,640	—	50,032,743	111,897
	イギリスポンド	167,148,879	—	167,027,104	121,775
	スイスフラン	81,481,429	—	81,206,145	275,284
	香港ドル	48,762,433	—	48,711,431	51,002
	スウェーデンクローネ	47,317,678	—	47,365,680	48,002
	デンマーククローネ	22,617,686	—	22,590,720	26,966
	ユーロ	187,527,537	—	187,395,116	132,421
合計		3,051,270,012	—	3,047,657,322	3,612,690

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 3年 5月12日現在]
1口当たり純資産額	3.9579円
(1万口当たり純資産額)	(39,579円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	110,239	24.81	2,735,029.59	
	CABOT OIL & GAS CORP	68,398	17.41	1,190,809.18	
	CHENIERE ENERGY INC	36,410	82.13	2,990,353.30	
	CHEVRON CORP	316,860	106.70	33,808,962.00	
	CONOCOPHILLIPS	222,314	55.72	12,387,336.08	
	DEVON ENERGY CORP	99,707	25.74	2,566,458.18	
	EOG RESOURCES INC	94,808	82.14	7,787,529.12	
	EXXON MOBIL CORP	696,268	60.59	42,186,878.12	
	HALLIBURTON CO	151,300	22.61	3,420,893.00	
	HESS CORP	47,459	81.15	3,851,297.85	
	KINDER MORGAN INC	338,753	17.97	6,087,391.41	
	MARATHON PETROLEUM CORP	105,787	58.64	6,203,349.68	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	158,818	24.53	3,895,805.54	
	ONEOK INC	72,635	53.27	3,869,266.45	
	PHILLIPS 66	73,621	83.63	6,156,924.23	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	34,267	157.70	5,403,905.90	
	SCHLUMBERGER LTD	232,346	31.26	7,263,135.96	
	VALERO ENERGY CORP	68,957	77.69	5,357,269.33	
	WILLIAMS COS INC	196,822	25.65	5,048,484.30	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	36,515	300.74	10,981,521.10	
	ALBEMARLE CORP	18,299	160.50	2,936,989.50	
	AMCOR PLC	257,745	12.40	3,196,038.00	
	AVERY DENNISON CORP	14,367	218.40	3,137,752.80	

AXALTA COATING SYSTEMS LTD	34,588	33.51	1,159,043.88
BALL CORP	53,399	90.60	4,837,949.40
CELANESE CORP	18,880	168.20	3,175,616.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	36,156	54.37	1,965,801.72
CORTEVA INC	121,385	47.09	5,716,019.65
CROWN HOLDINGS INC	22,427	112.39	2,520,570.53
DOW INC	123,436	68.57	8,464,006.52
DUPONT DE NEMOURS INC	89,978	82.83	7,452,877.74
EASTMAN CHEMICAL CO	22,366	128.40	2,871,794.40
ECOLAB INC	42,385	225.30	9,549,340.50
FMC CORP	20,465	117.14	2,397,270.10
FREEMONT-MCMORAN INC	241,013	44.80	10,797,382.40
INTERNATIONAL PAPER CO	61,143	62.68	3,832,443.24
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	37,738	138.68	5,233,505.84
LINDE PLC	86,608	298.61	25,862,014.88
LYONDELLBASELL INDU-CL A	43,161	112.53	4,856,907.33
MARTIN MARIETTA MATERIALS	10,535	377.14	3,973,169.90
MOSAIC CO/THE	63,518	35.22	2,237,103.96
NEWMONT CORP	133,187	68.78	9,160,601.86
NUCOR CORP	50,636	101.98	5,163,859.28
PACKAGING CORP OF AMERICA	16,577	154.85	2,566,948.45
PPG INDUSTRIES INC	38,324	178.99	6,859,612.76
RPM INTERNATIONAL INC	20,577	97.16	1,999,261.32
SEALED AIR CORP	24,383	56.39	1,374,957.37
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	40,445	285.84	11,560,798.80
STEEL DYNAMICS INC	37,342	64.34	2,402,584.28
VULCAN MATERIALS CO	21,530	191.44	4,121,703.20
WESTROCK CO	45,602	60.72	2,768,953.44
3M CO	95,065	203.72	19,366,641.80
ALLEGION PLC	14,695	139.74	2,053,479.30
AMETEK INC	37,486	136.14	5,103,344.04
BOEING CO/THE	88,343	228.88	20,219,945.84
CARRIER GLOBAL CORP	134,429	44.50	5,982,090.50
CATERPILLAR INC	89,594	239.30	21,439,844.20
CUMMINS INC	24,822	264.78	6,572,369.16
DEERE & CO	49,126	383.20	18,825,083.20
DOVER CORP	23,479	150.19	3,526,311.01
EATON CORP PLC	65,888	145.76	9,603,834.88
EMERSON ELECTRIC CO	98,709	95.26	9,403,019.34
FASTENAL CO	97,317	52.89	5,147,096.13
FORTIVE CORP	51,428	70.15	3,607,674.20
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	24,031	108.74	2,613,130.94

GENERAC HOLDINGS INC	10,200	304.62	3,107,124.00
GENERAL DYNAMICS CORP	40,666	191.54	7,789,165.64
GENERAL ELECTRIC CO	1,444,850	13.09	18,913,086.50
HEICO CORP	7,231	138.19	999,251.89
HEICO CORP-CLASS A	11,631	129.35	1,504,469.85
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	115,592	229.16	26,489,062.72
HOWMET AEROSPACE INC	62,452	32.40	2,023,444.80
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	6,440	214.70	1,382,668.00
IDEX CORP	13,155	224.75	2,956,586.25
ILLINOIS TOOL WORKS	52,446	236.37	12,396,661.02
INGERSOLL-RAND INC	61,406	48.16	2,957,312.96
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	34,500	66.36	2,289,420.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	120,735	64.13	7,742,735.55
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	35,003	213.33	7,467,189.99
LENNOX INTERNATIONAL INC	5,609	346.40	1,942,957.60
LOCKHEED MARTIN CORP	41,423	387.82	16,064,667.86
MASCO CORP	42,725	64.69	2,763,880.25
NORDSON CORP	8,714	207.42	1,807,457.88
NORTHROP GRUMMAN CORP	26,180	368.30	9,642,094.00
OTIS WORLDWIDE CORP	66,316	77.62	5,147,447.92
OWENS CORNING	17,756	105.59	1,874,856.04
PACCAR INC	56,074	94.76	5,313,572.24
PARKER HANNIFIN CORP	21,623	312.69	6,761,295.87
PENTAIR PLC	26,974	67.98	1,833,692.52
PLUG POWER INC	75,243	23.60	1,775,734.80
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	250,235	84.33	21,102,317.55
ROCKWELL AUTOMATION INC	18,951	268.31	5,084,742.81
ROPER TECHNOLOGIES INC	17,473	440.40	7,695,109.20
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	25,838	56.87	1,469,407.06
SMITH (A.O.) CORP	22,709	70.87	1,609,386.83
SNAP-ON INC	8,484	251.02	2,129,653.68
STANLEY BLACK & DECKER INC	26,128	217.69	5,687,804.32
SUNRUN INC	18,430	42.94	791,384.20
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,996	423.61	2,539,965.56
TEXTRON INC	36,240	67.13	2,432,791.20
TRANE TECHNOLOGIES PLC	40,321	182.75	7,368,662.75
TRANSDIGM GROUP INC	8,426	600.06	5,056,105.56
UNITED RENTALS INC	11,865	340.33	4,038,015.45
WABTEC CORP	29,134	79.37	2,312,365.58
WW GRAINGER INC	7,442	462.70	3,443,413.40
XYLEM INC	29,609	117.63	3,482,906.67
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	21,669	81.70	1,770,357.30

CINTAS CORP	14,386	354.68	5,102,426.48
COPART INC	34,211	121.04	4,140,899.44
COSTAR GROUP INC	6,652	847.49	5,637,503.48
EQUIFAX INC	20,543	238.60	4,901,559.80
IHS MARKIT LTD	63,574	104.60	6,649,840.40
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	21,153	140.14	2,964,381.42
LEIDOS HOLDINGS INC	21,839	104.68	2,286,106.52
REPUBLIC SERVICES INC	38,015	109.90	4,177,848.50
ROBERT HALF INTL INC	17,817	89.68	1,597,828.56
ROLLINS INC	36,239	36.95	1,339,031.05
TRANSUNION	31,124	104.83	3,262,728.92
VERISK ANALYTICS INC	25,211	175.08	4,413,941.88
WASTE CONNECTIONS INC	43,909	121.00	5,312,989.00
WASTE MANAGEMENT INC	69,683	141.20	9,839,239.60
AMERCO	1,455	619.63	901,561.65
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	21,778	99.09	2,157,982.02
CSX CORP	125,938	101.54	12,787,744.52
DELTA AIR LINES INC	25,351	44.52	1,128,626.52
EXPEDITORS INTL WASH INC	28,054	117.67	3,301,114.18
FEDEX CORP	41,307	305.64	12,625,071.48
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	13,265	176.44	2,340,476.60
KANSAS CITY SOUTHERN	15,296	308.17	4,713,768.32
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	21,711	48.58	1,054,720.38
NORFOLK SOUTHERN CORP	41,867	286.66	12,001,594.22
OLD DOMINION FREIGHT LINE	15,848	264.14	4,186,090.72
SOUTHWEST AIRLINES CO	23,466	59.78	1,402,797.48
UBER TECHNOLOGIES INC	161,342	46.21	7,455,613.82
UNION PACIFIC CORP	111,046	226.61	25,164,134.06
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	117,959	214.33	25,282,152.47
XPO LOGISTICS INC	14,476	148.11	2,144,040.36
APTIV PLC	45,190	140.63	6,355,069.70
AUTOLIV INC	12,960	100.75	1,305,720.00
BORGWARNER INC	39,617	51.65	2,046,218.05
FORD MOTOR CO	646,673	11.58	7,488,473.34
GENERAL MOTORS CO	213,093	55.73	11,875,672.89
LEAR CORP	9,633	186.63	1,797,806.79
TESLA INC	125,062	617.20	77,188,266.40
DR HORTON INC	56,574	99.60	5,634,770.40
GARMIN LTD	23,599	140.59	3,317,783.41
HASBRO INC	20,443	98.21	2,007,707.03
LENNAR CORP-A	45,228	103.45	4,678,836.60
LULULEMON ATHLETICA INC	20,691	322.04	6,663,329.64

MOHAWK INDUSTRIES INC	10,585	219.47	2,323,089.95
NEWELL BRANDS INC	65,665	28.98	1,902,971.70
NIKE INC -CL B	206,823	137.12	28,359,569.76
NVR INC	611	4,988.03	3,047,686.33
PELOTON INTERACTIVE INC-A	39,034	91.01	3,552,484.34
PULTEGROUP INC	46,265	59.54	2,754,618.10
VF CORP	54,318	85.30	4,633,325.40
WHIRLPOOL CORP	9,906	246.21	2,438,956.26
AIRBNB INC-CLASS A	8,409	142.73	1,200,216.57
ARAMARK	41,183	36.92	1,520,476.36
BOOKING HOLDINGS INC	6,754	2,247.68	15,180,830.72
CARNIVAL CORP	125,312	25.88	3,243,074.56
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,462	1,393.25	6,216,681.50
DARDEN RESTAURANTS INC	20,791	137.42	2,857,099.22
DOMINO'S PIZZA INC	6,195	422.34	2,616,396.30
DRAFTKINGS INC - CL A	27,687	44.01	1,218,504.87
EXPEDIA GROUP INC	21,993	172.40	3,791,593.20
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	46,293	121.83	5,639,876.19
LAS VEGAS SANDS CORP	56,001	56.24	3,149,496.24
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	45,905	141.71	6,505,197.55
MCDONALD'S CORP	122,911	233.86	28,743,966.46
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	33,367	18.20	607,279.40
MGM RESORTS INTERNATIONAL	75,301	38.76	2,918,666.76
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	36,868	81.28	2,996,631.04
STARBUCKS CORP	193,632	113.55	21,986,913.60
VAIL RESORTS INC	6,397	317.36	2,030,151.92
WYNN RESORTS LTD	16,566	125.00	2,070,750.00
YUM! BRANDS INC	49,196	119.15	5,861,703.40
ACTIVISION BLIZZARD INC	127,587	95.34	12,164,144.58
ALPHABET INC-CL A	66,841	2,270.06	151,733,080.46
ALPHABET INC-CL C	31,650	2,308.76	73,072,254.00
ALTICE USA INC- A	42,738	37.48	1,601,820.24
CABLE ONE INC	778	1,739.45	1,353,292.10
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	23,046	685.09	15,788,584.14
COMCAST CORP-CLASS A	752,904	57.50	43,291,980.00
DISCOVERY INC - A	25,556	36.78	940,077.46
DISCOVERY INC-C	49,619	31.89	1,582,349.91
DISH NETWORK CORP-A	40,567	46.23	1,875,412.41
ELECTRONIC ARTS INC	48,291	141.36	6,826,415.76
FACEBOOK INC-CLASS A	396,296	306.53	121,476,612.88
FOX CORP - CLASS A	53,639	38.50	2,065,369.69
FOX CORP - CLASS B	27,366	37.39	1,023,214.74

IAC/INTERACTIVECORP	12,953	237.34	3,074,265.02
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	64,665	32.39	2,094,499.35
LIBERTY BROADBAND-A	4,561	160.35	731,356.35
LIBERTY BROADBAND-C	26,742	164.68	4,403,872.56
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	14,828	41.99	622,627.72
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	26,504	42.19	1,118,203.76
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	33,820	43.97	1,487,065.40
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	27,011	81.95	2,213,551.45
MATCH GROUP INC	40,785	146.40	5,970,924.00
NETFLIX INC	72,859	495.08	36,071,033.72
NEWS CORP - CLASS A	61,728	27.64	1,706,161.92
OMNICOM GROUP	34,620	83.74	2,899,078.80
PINTEREST INC- CLASS A	85,172	59.71	5,085,620.12
ROKU INC	18,212	314.12	5,720,753.44
SIRIUS XM HOLDINGS INC	173,853	5.87	1,020,517.11
SNAP INC - A	153,042	53.29	8,155,608.18
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	19,590	167.99	3,290,924.10
TWITTER INC	131,961	52.88	6,978,097.68
VIACOMCBS INC - CLASS B	91,600	39.48	3,616,368.00
WALT DISNEY CO/THE	298,638	181.67	54,253,565.46
ZILLOW GROUP INC - A	9,806	116.09	1,138,378.54
ZILLOW GROUP INC - C	24,175	114.78	2,774,806.50
ADVANCE AUTO PARTS INC	10,935	204.21	2,233,036.35
AMAZON.COM INC	70,321	3,223.91	226,708,575.11
AUTOZONE INC	3,873	1,495.13	5,790,638.49
BEST BUY CO INC	38,022	121.67	4,626,136.74
BURLINGTON STORES INC	10,866	329.21	3,577,195.86
CARMAX INC	26,602	123.42	3,283,218.84
CARVANA CO	10,298	239.19	2,463,178.62
CHEWY INC - CLASS A	12,701	71.42	907,105.42
DOLLAR GENERAL CORP	41,153	213.90	8,802,626.70
DOLLAR TREE INC	38,381	112.81	4,329,760.61
EBAY INC	113,882	60.43	6,881,889.26
ETSY INC	21,447	169.84	3,642,558.48
GENUINE PARTS CO	23,129	131.24	3,035,449.96
HOME DEPOT INC	177,520	330.66	58,698,763.20
LKQ CORP	46,064	49.20	2,266,348.80
LOWE'S COS INC	120,853	205.34	24,815,955.02
MERCADOLIBRE INC	7,407	1,381.42	10,232,177.94
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	12,162	559.83	6,808,652.46
POOL CORP	6,593	438.87	2,893,469.91
ROSS STORES INC	59,331	129.12	7,660,818.72

TARGET CORP	82,597	209.24	17,282,596.28
TJX COMPANIES INC	197,796	72.01	14,243,289.96
TRACTOR SUPPLY COMPANY	18,892	191.26	3,613,283.92
ULTA BEAUTY INC	9,179	312.30	2,866,601.70
WAYFAIR INC- CLASS A	11,124	325.94	3,625,756.56
COSTCO WHOLESALE CORP	72,627	378.18	27,466,078.86
KROGER CO	129,230	38.42	4,965,016.60
SYSCO CORP	81,396	83.98	6,835,636.08
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	123,819	54.24	6,715,942.56
WALMART INC	233,549	139.55	32,591,762.95
ALTRIA GROUP INC	306,590	50.43	15,461,333.70
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	90,557	66.89	6,057,357.73
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	50,169	77.72	3,899,134.68
BUNGE LTD	21,655	90.77	1,965,624.35
CAMPBELL SOUP CO	30,056	50.03	1,503,701.68
COCA-COLA CO/THE	672,655	54.32	36,538,619.60
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	32,884	56.16	1,846,765.44
CONAGRA BRANDS INC	83,052	37.95	3,151,823.40
CONSTELLATION BRANDS INC-A	28,185	234.04	6,596,417.40
GENERAL MILLS INC	98,722	63.11	6,230,345.42
HERSHEY CO/THE	25,030	168.92	4,228,067.60
HORMEL FOODS CORP	47,218	47.22	2,229,633.96
JM SMUCKER CO/THE	18,418	136.82	2,519,950.76
KELLOGG CO	44,204	67.15	2,968,298.60
KEURIG DR PEPPER INC	90,574	35.75	3,238,020.50
KRAFT HEINZ CO/THE	109,902	43.25	4,753,811.01
LAMB WESTON HOLDINGS INC	23,281	78.14	1,819,177.34
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	41,989	89.72	3,767,253.08
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	32,241	57.80	1,863,529.80
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	235,445	61.95	14,585,817.75
MONSTER BEVERAGE CORP	66,521	91.54	6,089,332.34
PEPSICO INC	227,487	145.65	33,133,481.55
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	256,818	97.29	24,985,823.22
TYSON FOODS INC-CL A	47,899	79.44	3,805,096.56
CHURCH & DWIGHT CO INC	42,268	88.09	3,723,388.12
CLOROX COMPANY	20,390	185.94	3,791,316.60
COLGATE-PALMOLIVE CO	133,970	82.44	11,044,486.80
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	37,348	294.81	11,010,563.88
KIMBERLY-CLARK CORP	56,655	134.21	7,603,667.55
PROCTER & GAMBLE CO/THE	408,647	136.99	55,980,552.53
ABBOTT LABORATORIES	292,242	118.39	34,598,530.38
ABIOMED INC	7,450	280.30	2,088,235.00

ALIGN TECHNOLOGY INC	12,449	566.26	7,049,370.74
AMERISOURCEBERGEN CORP	26,246	120.10	3,152,144.60
ANTHEM INC	40,975	394.49	16,164,227.75
BAXTER INTERNATIONAL INC	84,555	83.58	7,067,106.90
BECTON DICKINSON AND CO	47,997	241.20	11,576,876.40
BOSTON SCIENTIFIC CORP	235,691	42.53	10,023,938.23
CARDINAL HEALTH INC	50,074	56.17	2,812,656.58
CENTENE CORP	94,336	68.06	6,420,508.16
CERNER CORP	49,800	76.69	3,819,162.00
CIGNA CORP	59,526	260.86	15,527,952.36
COOPER COS INC/THE	8,639	388.31	3,354,610.09
CVS HEALTH CORP	215,596	84.37	18,189,834.52
DANAHER CORP	105,403	257.91	27,184,487.73
DAVITA INC	12,840	124.61	1,599,992.40
DENTSPLY SIRONA INC	34,327	66.80	2,293,043.60
DEXCOM INC	16,121	348.00	5,610,108.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	102,728	89.51	9,195,183.28
HCA HEALTHCARE INC	44,820	206.76	9,266,983.20
HENRY SCHEIN INC	22,951	80.39	1,845,030.89
HOLOGIC INC	42,191	64.47	2,720,053.77
HUMANA INC	21,849	455.76	9,957,900.24
IDEXX LABORATORIES INC	14,140	528.19	7,468,606.60
INSULET CORP	11,224	229.96	2,581,071.04
INTUITIVE SURGICAL INC	19,358	836.75	16,197,806.50
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	15,770	276.10	4,354,097.00
MASIMO CORP	8,570	215.47	1,846,577.90
MCKESSON CORP	26,972	197.94	5,338,837.68
MEDTRONIC PLC	221,559	125.22	27,743,617.98
MOLINA HEALTHCARE INC	10,275	263.03	2,702,633.25
NOVOCURE LTD	14,253	186.66	2,660,464.98
QUEST DIAGNOSTICS INC	23,155	137.85	3,191,916.75
RESMED INC	24,172	194.75	4,707,497.00
STERIS PLC	13,856	204.65	2,835,630.40
STRYKER CORP	55,721	251.50	14,013,831.50
TELADOC HEALTH INC	18,661	145.79	2,720,587.19
TELEFLEX INC	7,489	400.72	3,000,992.08
UNITEDHEALTH GROUP INC	156,281	411.70	64,340,887.70
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	12,462	155.35	1,935,971.70
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	22,729	252.81	5,746,118.49
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	12,604	335.22	4,225,112.88
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	33,568	167.55	5,624,318.40
10X GENOMICS INC-CLASS A	10,731	137.25	1,472,829.75

ABBVIE INC	291,194	114.89	33,455,278.66
AGILENT TECHNOLOGIES INC	51,703	131.42	6,794,808.26
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	35,512	171.41	6,087,111.92
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	19,138	132.41	2,534,062.58
AMGEN INC	95,946	252.30	24,207,175.80
AVANTOR INC	86,599	30.86	2,672,445.14
BIO-RAD LABORATORIES-A	3,710	596.38	2,212,569.80
BIOGEN INC	25,682	278.39	7,149,611.98
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	28,856	75.69	2,184,110.64
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	372,677	64.26	23,948,224.02
CATALENT INC	26,518	104.00	2,757,872.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	66,902	32.31	2,161,603.62
ELI LILLY & CO	142,050	194.75	27,664,237.50
EXACT SCIENCES CORP	25,830	98.00	2,531,340.00
GILEAD SCIENCES INC	206,780	67.22	13,899,751.60
HORIZON THERAPEUTICS PLC	36,017	87.40	3,147,885.80
ILLUMINA INC	24,105	381.51	9,196,298.55
INCYTE CORP	30,744	80.64	2,479,196.16
IONIS PHARMACEUTICALS INC	20,901	36.69	766,857.69
IQVIA HOLDINGS INC	32,164	232.07	7,464,299.48
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	9,076	173.80	1,577,408.80
JOHNSON & JOHNSON	433,985	168.88	73,291,386.80
MERCK & CO. INC.	417,147	77.46	32,312,206.62
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	3,980	1,239.94	4,934,961.20
MODERNA INC	46,093	158.99	7,328,326.07
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,302	91.45	1,307,917.90
PERKINELMER INC	17,701	139.44	2,468,227.44
PFIZER INC	916,678	39.35	36,071,279.30
PPD INC	21,251	46.10	979,671.10
REGENERON PHARMACEUTICALS	17,330	501.19	8,685,622.70
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	28,088	41.68	1,170,707.84
SAREPTA THERAPEUTICS INC	11,524	71.02	818,434.48
SEAGEN INC	20,447	139.07	2,843,564.29
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	172,225	10.25	1,765,306.25
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	65,370	464.00	30,331,680.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	43,122	213.00	9,184,986.00
VIATRIS INC	201,255	15.14	3,047,000.70
WATERS CORP	9,870	315.89	3,117,834.30
ZOETIS INC	78,429	170.23	13,350,968.67
BANK OF AMERICA CORP	1,282,982	41.57	53,333,561.74
CITIGROUP INC	342,954	74.87	25,676,965.98
CITIZENS FINANCIAL GROUP	67,968	48.99	3,329,752.32

FIFTH THIRD BANCORP	119,214	41.63	4,962,878.82
FIRST REPUBLIC BANK/CA	28,006	186.32	5,218,077.92
HUNTINGTON BANCSHARES INC	167,667	15.66	2,625,665.22
JPMORGAN CHASE & CO	502,283	158.54	79,631,946.82
KEYCORP	165,986	22.75	3,776,181.50
M & T BANK CORP	21,119	162.00	3,421,278.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	69,640	194.04	13,512,945.60
REGIONS FINANCIAL CORP	163,675	22.44	3,672,867.00
SVB FINANCIAL GROUP	8,739	583.90	5,102,702.10
TRUIST FINANCIAL CORP	222,354	60.49	13,450,193.46
US BANCORP	223,395	60.15	13,437,209.25
WELLS FARGO & CO	647,094	45.72	29,585,137.68
AGNC INVESTMENT CORP	97,485	18.08	1,762,528.80
ALLY FINANCIAL INC	61,669	52.45	3,234,539.05
AMERICAN EXPRESS CO	113,016	154.43	17,453,060.88
AMERIPRISE FINANCIAL INC	18,986	258.15	4,901,235.90
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	232,296	9.08	2,109,247.68
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	28,586	57.79	1,651,984.94
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	129,646	51.58	6,687,140.68
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	225,897	285.63	64,522,960.11
BLACKROCK INC	25,115	844.10	21,199,571.50
BLACKSTONE GROUP INC/THE	111,334	87.83	9,778,465.22
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	75,740	154.76	11,721,522.40
CARLYLE GROUP INC/THE	24,405	43.36	1,058,200.80
CBOE GLOBAL MARKETS INC	17,518	109.53	1,918,746.54
CME GROUP INC	59,199	212.09	12,555,515.91
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	51,164	114.39	5,852,649.96
EQUITABLE HOLDINGS INC	64,715	33.38	2,160,186.70
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,952	331.86	1,975,230.72
FRANKLIN RESOURCES INC	46,657	33.79	1,576,540.03
GOLDMAN SACHS GROUP INC	53,853	359.92	19,382,771.76
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	92,597	113.07	10,469,942.79
INVESCO LTD	62,240	27.26	1,696,662.40
KKR & CO INC	84,154	56.27	4,735,345.58
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6,187	448.04	2,772,023.48
MOODY'S CORP	27,964	328.75	9,193,165.00
MORGAN STANLEY	231,841	84.92	19,687,937.72
MSCI INC	13,747	472.67	6,497,794.49
NASDAQ INC	19,614	159.73	3,132,944.22
NORTHERN TRUST CORP	32,272	118.40	3,821,004.80
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	21,161	133.26	2,819,914.86
S&P GLOBAL INC	39,630	379.67	15,046,322.10

SCHWAB (CHARLES) CORP	252,332	70.63	17,822,209.16
SEI INVESTMENTS COMPANY	19,838	61.98	1,229,559.24
STATE STREET CORP	56,992	86.10	4,907,011.20
SYNCHRONY FINANCIAL	85,858	45.21	3,881,640.18
T ROWE PRICE GROUP INC	38,062	184.77	7,032,715.74
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	14,013	82.97	1,162,658.61
VOYA FINANCIAL INC	19,576	67.02	1,311,983.52
AFLAC INC	111,942	55.22	6,181,437.24
ALLEGHANY CORP	2,345	699.36	1,639,999.20
ALLSTATE CORP	50,986	134.13	6,838,752.18
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	12,222	126.58	1,547,060.76
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	144,957	50.38	7,302,933.66
AON PLC-CLASS A	37,679	254.12	9,574,987.48
ARCH CAPITAL GROUP LTD	65,317	39.58	2,585,246.86
ARTHUR J GALLAGHER & CO	31,191	148.46	4,630,615.86
ASSURANT INC	10,630	156.17	1,660,087.10
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	21,360	62.43	1,333,504.80
BROWN & BROWN INC	38,326	51.98	1,992,185.48
CHUBB LTD	74,505	167.76	12,498,958.80
CINCINNATI FINANCIAL CORP	25,032	118.15	2,957,530.80
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	4,123	202.16	833,505.68
EVEREST RE GROUP LTD	6,504	265.57	1,727,267.28
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	44,319	46.07	2,041,776.33
GLOBE LIFE INC	15,493	103.91	1,609,877.63
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	58,709	63.99	3,756,788.91
LINCOLN NATIONAL CORP	31,540	68.11	2,148,189.40
LOEWS CORP	40,057	57.71	2,311,689.47
MARKEL CORP	2,186	1,194.10	2,610,302.60
MARSH & MCLENNAN COS	83,555	134.77	11,260,707.35
METLIFE INC	127,764	64.73	8,270,163.72
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	44,604	64.81	2,890,785.24
PROGRESSIVE CORP	96,746	105.08	10,166,069.68
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	66,795	104.91	7,007,463.45
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	10,372	127.10	1,318,281.20
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	8,293	158.13	1,311,372.09
TRAVELERS COS INC/THE	42,562	156.69	6,669,039.78
WILLIS TOWERS WATSON PLC	21,244	264.25	5,613,727.00
WR BERKLEY CORP	23,267	79.09	1,840,187.03
CBRE GROUP INC - A	54,253	85.73	4,651,109.69
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	200,400	4.91	983,964.00
ACCENTURE PLC-CL A	104,347	287.95	30,046,718.65
ADOBE INC	79,042	485.19	38,350,387.98

AKAMAI TECHNOLOGIES INC	26,662	111.17	2,964,014.54
ANSYS INC	13,915	320.87	4,464,906.05
AUTODESK INC	36,392	277.42	10,095,868.64
AUTOMATIC DATA PROCESSING	70,635	194.47	13,736,388.45
AVALARA INC	14,242	126.69	1,804,318.98
BLACK KNIGHT INC	25,802	73.77	1,903,413.54
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	18,952	163.79	3,104,148.08
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	46,664	125.83	5,871,731.12
CERIDIAN HCM HOLDING INC	21,903	86.81	1,901,399.43
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	18,153	117.93	2,140,783.29
CITRIX SYSTEMS INC	20,174	119.24	2,405,547.76
CLOUDFLARE INC - CLASS A	31,988	71.29	2,280,424.52
COGNIZANT TECHNOLOGIES SOLUTIONS-A	88,291	72.64	6,413,458.24
COUPA SOFTWARE INC	11,072	235.76	2,610,334.72
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	29,437	195.10	5,743,158.70
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	6,282	122.02	766,529.64
DATADOG INC - CLASS A	28,453	78.62	2,236,974.86
DOCUSIGN INC	29,235	195.98	5,729,475.30
DROPBOX INC-CLASS A	53,333	25.55	1,362,658.15
DYNATRACE INC	28,828	45.38	1,308,214.64
EPAM SYSTEMS INC	9,540	454.09	4,332,018.60
FAIR ISAAC CORP	4,672	487.06	2,275,544.32
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	102,283	148.04	15,141,975.32
FISERV INC	94,340	114.83	10,833,062.20
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	14,161	277.91	3,935,483.51
FORTINET INC	22,339	206.51	4,613,226.89
GARTNER INC	14,465	225.31	3,259,109.15
GLOBAL PAYMENTS INC	49,382	195.06	9,632,452.92
GODADDY INC - CLASS A	26,661	81.56	2,174,471.16
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	13,245	96.48	1,277,877.60
HUBSPOT INC	7,437	506.32	3,765,501.84
INTL BUSINESS MACHINES CORP	146,744	144.22	21,163,419.68
INTUIT INC	43,272	394.99	17,092,007.28
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	11,847	156.31	1,851,804.57
MASTERCARD INC - A	146,660	367.61	53,913,682.60
MICROSOFT CORP	1,184,176	246.23	291,579,656.48
MONGODB INC	8,497	260.31	2,211,854.07
NORTONLIFELOCK INC	98,167	23.35	2,292,199.45
OKTA INC	19,446	237.90	4,626,203.40
ORACLE CORP	322,549	77.69	25,058,831.81
PALO ALTO NETWORKS INC	15,912	343.43	5,464,658.16
PAYCHEX INC	52,067	99.03	5,156,195.01

PAYCOM SOFTWARE INC	8,162	321.29	2,622,368.98
PAYPAL HOLDINGS INC	183,540	248.60	45,628,044.00
PTC INC	18,174	130.16	2,365,527.84
RINGCENTRAL INC-CLASS A	12,104	266.47	3,225,352.88
SALESFORCE.COM INC	150,038	215.56	32,342,191.28
SERVICENOW INC	32,186	481.50	15,497,559.00
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	73,876	41.24	3,046,646.24
SNOWFLAKE INC-CLASS A	4,064	201.46	818,733.44
SPLUNK INC	25,859	119.25	3,083,685.75
SQUARE INC - A	63,342	220.65	13,976,412.30
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	39,732	73.11	2,904,806.52
SYNOPSYS INC	25,394	234.82	5,963,019.08
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	6,771	514.35	3,482,663.85
TWILIO INC - A	23,237	306.07	7,112,148.59
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,652	394.02	2,621,021.04
VERISIGN INC	16,557	221.46	3,666,713.22
VISA INC-CLASS A SHARES	278,836	225.48	62,871,941.28
VMWARE INC-CLASS A	13,281	160.97	2,137,842.57
WESTERN UNION CO	67,086	25.50	1,710,693.00
WIX.COM LTD	8,913	289.90	2,583,878.70
WORKDAY INC-CLASS A	29,969	236.90	7,099,656.10
ZENDESK INC	18,809	138.39	2,602,977.51
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	32,152	300.25	9,653,638.00
ZSCALER INC	11,937	170.69	2,037,526.53
AMPHENOL CORP-CL A	99,871	66.31	6,622,446.01
APPLE INC	2,803,348	125.91	352,969,546.68
ARISTA NETWORKS INC	9,071	326.74	2,963,858.54
ARROW ELECTRONICS INC	12,286	115.42	1,418,050.12
CDW CORP/DE	23,998	167.64	4,023,024.72
CISCO SYSTEMS INC	695,821	52.83	36,760,223.43
COGNEX CORP	28,014	74.83	2,096,287.62
CORNING INC	124,298	45.14	5,610,811.72
DELL TECHNOLOGIES -C	39,829	97.82	3,896,072.78
F5 NETWORKS INC	9,639	182.60	1,760,081.40
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	205,429	16.17	3,321,786.93
HP INC	228,754	33.59	7,683,846.86
IPG PHOTONICS CORP	5,735	190.75	1,093,951.25
JUNIPER NETWORKS INC	55,446	26.84	1,488,170.64
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	31,037	138.93	4,311,970.41
MOTOROLA SOLUTIONS INC	27,660	201.71	5,579,298.60
NETAPP INC	36,568	76.74	2,806,228.32
SEAGATE TECHNOLOGY	38,183	86.76	3,312,757.08

TE CONNECTIVITY LTD	54,989	133.79	7,356,978.31
TRIMBLE INC	42,515	76.47	3,251,122.05
WESTERN DIGITAL CORP	51,582	68.15	3,515,313.30
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	8,958	485.67	4,350,631.86
AT&T INC	1,175,006	32.26	37,905,693.56
LIBERTY GLOBAL PLC- C	59,643	28.04	1,672,389.72
LIBERTY GLOBAL PLC-A	23,763	28.02	665,958.07
LUMEN TECHNOLOGIES INC	151,088	14.11	2,131,851.68
T-MOBILE US INC	92,470	138.00	12,760,860.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	682,190	58.54	39,935,402.60
AES CORP	109,785	25.34	2,781,951.90
ALLIANT ENERGY CORP	41,577	56.97	2,368,641.69
AMEREN CORPORATION	41,919	83.39	3,495,625.41
AMERICAN ELECTRIC POWER	82,737	86.41	7,149,304.17
AMERICAN WATER WORKS CO INC	29,255	153.70	4,496,493.50
ATMOS ENERGY CORP	20,494	101.31	2,076,247.14
CENTERPOINT ENERGY INC	88,495	23.96	2,120,340.20
CMS ENERGY CORP	49,247	63.53	3,128,661.91
CONSOLIDATED EDISON INC	54,099	79.34	4,292,214.66
DOMINION ENERGY INC	134,696	78.63	10,591,146.48
DTE ENERGY COMPANY	31,446	142.23	4,472,564.58
DUKE ENERGY CORP	121,897	103.63	12,632,186.11
EDISON INTERNATIONAL	63,880	58.63	3,745,284.40
ENTERGY CORP	34,153	107.03	3,655,395.59
ESSENTIAL UTILITIES INC	37,055	46.73	1,731,580.15
EVERGY INC	39,259	62.45	2,451,724.55
EVERSOURCE ENERGY	55,819	84.02	4,689,912.38
EXELON CORP	162,313	44.44	7,213,189.72
FIRSTENERGY CORP	89,008	37.20	3,311,097.60
NEXTERA ENERGY INC	323,025	74.07	23,926,461.75
NISOURCE INC	60,141	25.81	1,552,239.21
NRG ENERGY INC	39,560	34.69	1,372,336.40
OGE ENERGY CORP	31,768	33.42	1,061,686.56
P G & E CORP	235,607	10.89	2,565,760.23
PINNACLE WEST CAPITAL	18,573	86.83	1,612,693.59
PPL CORP	130,874	29.34	3,839,843.16
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	82,541	62.25	5,138,177.25
SEMPRA ENERGY	46,832	138.54	6,488,105.28
SOUTHERN CO/THE	174,544	65.80	11,484,995.20
UGI CORP	35,036	45.80	1,604,648.80
VISTRA CORP	71,702	16.33	1,170,893.66
WEC ENERGY GROUP INC	51,205	96.44	4,938,210.20

	XCEL ENERGY INC	85,049	71.03	6,041,030.47	
	ADVANCED MICRO DEVICES	198,419	76.83	15,244,531.77	
	ANALOG DEVICES INC	60,958	150.84	9,194,904.72	
	APPLIED MATERIALS INC	150,846	123.55	18,637,023.30	
	BROADCOM INC	66,706	440.07	29,355,309.42	
	ENPHASE ENERGY INC	19,738	121.42	2,396,587.96	
	INTEL CORP	675,766	55.04	37,194,160.64	
	KLA CORP	25,705	300.28	7,718,697.40	
	LAM RESEARCH CORP	23,802	592.43	14,101,018.86	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	131,778	44.22	5,827,223.16	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	43,747	92.95	4,066,283.65	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	43,496	145.51	6,329,102.96	
	MICRON TECHNOLOGY INC	183,697	80.68	14,820,673.96	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	7,357	320.41	2,357,256.37	
	NVIDIA CORP	102,083	572.25	58,416,996.75	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	46,151	192.54	8,885,913.54	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	67,581	37.17	2,511,985.77	
	QORVO INC	18,645	172.01	3,207,126.45	
	QUALCOMM INC	186,533	128.37	23,945,241.21	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	27,027	166.89	4,510,536.03	
	SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	8,271	217.94	1,802,581.74	
	TERADYNE INC	27,018	121.51	3,282,957.18	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	151,341	183.20	27,725,671.20	
	XILINX INC	39,593	121.23	4,799,859.39	
	アメリカドル 小計	51,933,372		5,995,348,529.11 (652,293,919,967)	
カナダドル	CAMECO CORP	66,500	23.75	1,579,375.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	198,200	40.54	8,035,028.00	
	CENOVUS ENERGY INC	203,900	9.34	1,904,426.00	
	ENBRIDGE INC	334,700	48.19	16,129,193.00	
	IMPERIAL OIL LTD	48,000	37.44	1,797,120.00	
	INTER PIPELINE LTD	72,900	17.72	1,291,788.00	
	KEYERA CORP	31,900	29.23	932,437.00	
	PARKLAND CORP	25,700	39.40	1,012,580.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	87,832	38.17	3,352,547.44	
	SUNCOR ENERGY INC	258,100	27.67	7,141,627.00	
	TC ENERGY CORP	157,200	61.41	9,653,652.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	39,900	83.61	3,336,039.00	
	B2GOLD CORP	168,600	6.23	1,050,378.00	
	BARRICK GOLD CORP	298,100	28.98	8,638,938.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	23,800	70.49	1,677,662.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	95,900	33.02	3,166,618.00	

FRANCO-NEVADA CORP	31,900	179.21	5,716,799.00	
KINROSS GOLD CORP	191,900	9.31	1,786,589.00	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	43,300	50.27	2,176,691.00	
LUNDIN MINING CORP	110,500	14.94	1,650,870.00	
NUTRIEN LTD	92,859	74.36	6,904,995.24	
PAN AMERICAN SILVER CORP	35,800	41.97	1,502,526.00	
SSR MINING INC	40,200	20.57	826,914.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	72,500	30.94	2,243,150.00	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	13,200	102.29	1,350,228.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	72,000	53.94	3,883,680.00	
YAMANA GOLD INC	164,600	6.16	1,013,936.00	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	36,200	17.75	642,550.00	
CAE INC	50,900	36.51	1,858,359.00	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	14,300	105.39	1,507,077.00	
WSP GLOBAL INC	20,200	125.45	2,534,090.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	29,100	37.64	1,095,324.00	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	16,800	79.11	1,329,048.00	
THOMSON REUTERS CORP	28,132	116.36	3,273,439.52	
AIR CANADA	34,500	24.91	859,395.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	117,200	136.02	15,941,544.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	22,500	478.60	10,768,500.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	46,100	113.02	5,210,222.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	33,700	42.50	1,432,250.00	
RESTAURANT BRANDS INTERN	47,810	82.32	3,935,719.20	
QUEBECOR INC -CL B	25,900	33.88	877,492.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	77,500	36.09	2,796,975.00	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	8,900	197.42	1,757,038.00	
DOLLARAMA INC	46,400	53.20	2,468,480.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	139,200	41.92	5,835,264.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	30,200	40.46	1,221,892.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	27,700	71.19	1,971,963.00	
METRO INC/CN	40,100	58.18	2,333,018.00	
WESTON (GEORGE) LTD	12,511	113.29	1,417,371.19	
SAPUTO INC	38,700	39.41	1,525,167.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	51,300	33.19	1,702,647.00	
CANOPY GROWTH CORP	36,500	28.92	1,055,580.00	
BANK OF MONTREAL	106,100	117.14	12,428,554.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	200,400	78.51	15,733,404.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	72,000	130.31	9,382,320.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	55,100	90.62	4,993,162.00	
ROYAL BANK OF CANADA	233,800	119.41	27,918,058.00	
TORONTO-DOMINION BANK	297,700	85.55	25,468,235.00	

	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	211,950	55.30	11,720,835.00	
	IGM FINANCIAL INC	18,800	44.67	839,796.00	
	ONEX CORPORATION	11,900	83.42	992,698.00	
	TMX GROUP LTD	9,400	134.64	1,265,616.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4,100	568.00	2,328,800.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	44,500	36.51	1,624,695.00	
	IA FINANCIAL CORP INC	15,900	70.25	1,116,975.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	24,400	165.04	4,026,976.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	314,600	25.62	8,060,052.00	
	POWER CORP OF CANADA	95,800	37.25	3,568,550.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	94,300	65.13	6,141,759.00	
	FIRSTSERVICE CORP	6,100	191.21	1,166,381.00	
	BLACKBERRY LTD	86,600	10.05	870,330.00	
	CGI INC	38,000	107.95	4,102,100.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,400	1,721.43	5,852,862.00	
	OPEN TEXT CORP	44,900	55.71	2,501,379.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	18,200	1,342.89	24,440,598.00	
	BCE INC	24,700	59.01	1,457,547.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	58,900	61.65	3,631,185.00	
	TELUS CORP	50,100	26.36	1,320,636.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	95,200	18.83	1,792,616.00	
	ALTAGAS LTD	41,300	24.10	995,330.00	
	ATCO LTD -CLASS I	17,000	42.25	718,250.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	20,850	46.80	975,780.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	23,200	34.84	808,288.00	
	EMERA INC	39,600	56.00	2,217,600.00	
	FORTIS INC	76,100	54.81	4,171,041.00	
	HYDRO ONE LTD	55,500	30.28	1,680,540.00	
	NORTHLAND POWER INC	32,800	38.57	1,265,096.00	
	カナダドル 小計	6,555,544		372,684,235.59 (33,481,951,725)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	42,710	26.50	1,131,815.00	
	OIL SEARCH LTD	324,022	3.82	1,237,764.04	
	ORIGIN ENERGY LTD	278,609	4.06	1,131,152.54	
	SANTOS LTD	299,069	6.98	2,087,501.62	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,920	29.70	413,424.00	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	159,193	22.75	3,621,640.75	
	BHP GROUP LTD	485,648	51.28	24,904,029.44	
	BLUESCOPE STEEL LTD	80,098	23.09	1,849,462.82	
	EVOLUTION MINING LTD	271,023	5.05	1,368,666.15	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	272,941	24.09	6,575,148.69	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	77,792	43.03	3,347,389.76	

NEWCREST MINING LTD	133,680	27.87	3,725,661.60
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	170,773	10.95	1,869,964.35
ORICA LTD	81,415	13.75	1,119,456.25
RIO TINTO LTD	61,781	130.61	8,069,216.41
SOUTH32 LTD	760,022	3.08	2,340,867.76
CIMIC GROUP LTD	12,366	19.06	235,695.96
BRAMBLES LTD	262,576	10.59	2,780,679.84
AURIZON HOLDINGS LTD	316,214	3.65	1,154,181.10
QANTAS AIRWAYS LTD	157,727	4.66	735,007.82
SYDNEY AIRPORT	212,579	6.05	1,286,102.95
TRANSURBAN GROUP	458,247	14.30	6,552,932.10
ARISTOCRAT LEISURE LTD	92,905	37.85	3,516,454.25
CROWN RESORTS LTD	68,133	12.93	880,959.69
TABCORP HOLDINGS LTD	359,038	5.07	1,820,322.66
REA GROUP LTD	8,604	154.30	1,327,597.20
SEEK LTD	52,612	29.61	1,557,841.32
WESFARMERS LTD	187,913	54.83	10,303,269.79
COLES GROUP LTD	219,084	16.30	3,571,069.20
WOOLWORTHS GROUP LTD	212,045	40.94	8,681,122.30
TREASURY WINE ESTATES LTD	124,673	10.14	1,264,184.22
COCHLEAR LTD	10,461	216.27	2,262,400.47
RAMSAY HEALTH CARE LTD	33,124	63.00	2,086,812.00
SONIC HEALTHCARE LTD	71,565	34.81	2,491,177.65
CSL LTD	75,099	274.34	20,602,659.66
AUST AND NZ BANKING GROUP	467,718	27.07	12,661,126.26
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	292,252	94.58	27,641,194.16
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	542,789	26.81	14,552,173.09
WESTPAC BANKING CORP	598,864	26.08	15,618,373.12
AMP LTD	614,794	1.09	670,125.46
ASX LTD	32,675	71.78	2,345,411.50
MACQUARIE GROUP LTD	57,804	155.94	9,013,955.76
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	20,923	45.78	957,854.94
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	375,820	5.08	1,909,165.60
MEDIBANK PRIVATE LTD	444,691	3.04	1,351,860.64
QBE INSURANCE GROUP LTD	239,120	10.58	2,529,889.60
SUNCORP GROUP LTD	215,008	10.98	2,360,787.84
LENDLEASE GROUP	118,940	12.03	1,430,848.20
AFTERPAY LTD	34,542	89.00	3,074,238.00
COMPUTERSHARE LTD	104,199	14.07	1,466,079.93
WISETECH GLOBAL LTD	21,412	26.92	576,411.04
XERO LTD	19,246	131.91	2,538,739.86
TELSTRA CORP LTD	676,003	3.45	2,332,210.35

	TPG TELECOM LTD	47,954	5.09	244,085.86	
	AGL ENERGY LTD	100,342	8.80	883,009.60	
	APA GROUP	193,858	9.77	1,893,992.66	
	AUSNET SERVICES	360,836	1.88	678,371.68	
	オーストラリアドル 小計	12,027,451		244,633,536.51 (20,815,867,621)	
イギリスポンド	BP PLC	3,258,237	3.04	9,924,589.90	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	664,240	13.67	9,084,146.24	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	594,627	13.13	7,812,209.52	
	ANGLO AMERICAN PLC	198,112	33.94	6,724,911.84	
	ANTOFAGASTA PLC	62,142	18.70	1,162,055.40	
	BHP GROUP PLC	339,931	23.29	7,918,692.64	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	22,191	65.42	1,451,735.22	
	EVRAZ PLC	82,637	6.82	564,080.16	
	FRESNILLO PLC	28,190	9.03	254,555.70	
	GLENCORE PLC	1,614,286	3.27	5,293,243.79	
	JOHNSON MATTHEY PLC	31,751	32.25	1,023,969.75	
	MONDI PLC	75,814	18.86	1,429,852.04	
	RIO TINTO PLC	181,030	65.41	11,841,172.30	
	ASHTED GROUP PLC	72,578	47.31	3,433,665.18	
	BAE SYSTEMS PLC	518,288	5.03	2,610,098.36	
	BUNZL PLC	53,020	22.70	1,203,554.00	
	DCC PLC	15,173	59.60	904,310.80	
	FERGUSON PLC	36,189	91.52	3,312,017.28	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	764,715	1.56	1,192,955.40	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,323,931	1.04	1,381,389.60	
	SMITHS GROUP PLC	60,852	15.35	934,078.20	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	11,470	115.55	1,325,358.50	
	EXPERIAN PLC	148,134	26.38	3,907,774.92	
	INTERTEK GROUP PLC	26,657	58.62	1,562,633.34	
	RELX PLC	311,928	18.13	5,655,254.64	
	RENTOKIL INITIAL PLC	307,195	4.71	1,446,888.45	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	157,832	7.53	1,189,737.61	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	20,863	47.10	982,647.30	
	BURBERRY GROUP PLC	66,384	20.90	1,387,425.60	
	PERSIMMON PLC	53,131	31.03	1,648,654.93	
	TAYLOR WIMPEY PLC	561,129	1.77	993,198.33	
	COMPASS GROUP PLC	287,249	15.28	4,390,600.96	
	ENTAIN PLC	96,181	15.64	1,504,751.74	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	27,229	48.29	1,314,888.41	
	WHITBREAD PLC	33,847	30.51	1,032,671.97	
	AUTO TRADER GROUP PLC	159,456	5.44	868,078.46	

INFORMA PLC	234,087	5.51	1,289,819.37
PEARSON PLC	124,328	8.36	1,039,879.39
WPP PLC	200,466	9.57	1,920,063.34
JD SPORTS FASHION PLC	76,698	8.80	675,095.79
KINGFISHER PLC	323,779	3.63	1,176,936.66
NEXT PLC	22,084	79.32	1,751,702.88
OCADO GROUP PLC	79,448	19.28	1,531,757.44
SAINSBURY (J) PLC	264,520	2.53	671,616.28
TESCO PLC	1,239,798	2.23	2,773,428.12
WM MORRISON SUPERMARKETS	356,141	1.82	649,423.11
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	56,609	22.90	1,296,346.10
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	369,747	27.66	10,229,050.75
COCA-COLA HBC AG-DI	34,277	24.83	851,097.91
DIAGEO PLC	376,557	31.90	12,012,168.30
IMPERIAL BRANDS PLC	153,495	15.71	2,411,406.45
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	114,582	62.50	7,161,375.00
UNILEVER PLC	423,148	42.20	17,858,961.34
SMITH & NEPHEW PLC	143,311	15.26	2,187,642.41
ASTRAZENECA PLC	211,417	76.32	16,135,345.44
GLAXOSMITHKLINE PLC	807,882	13.30	10,746,446.36
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	25,548	23.01	587,859.48
BARCLAYS PLC	2,798,731	1.80	5,037,715.80
HSBC HOLDINGS PLC	3,280,422	4.40	14,433,856.80
LLOYDS BANKING GROUP PLC	11,427,549	0.46	5,333,808.49
NATWEST GROUP PLC	763,476	1.91	1,458,239.16
STANDARD CHARTERED PLC	437,535	5.08	2,222,677.80
3I GROUP PLC	153,110	11.95	1,829,664.50
HARGREAVES LANSDOWN PLC	53,234	17.36	924,142.24
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	50,954	70.80	3,607,543.20
M&G PLC	437,392	2.15	943,891.93
SCHRODERS PLC	21,568	35.09	756,821.12
ST JAMES'S PLACE PLC	82,879	13.33	1,105,191.46
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	350,806	2.66	933,845.57
ADMIRAL GROUP PLC	30,353	29.13	884,182.89
AVIVA PLC	635,770	4.00	2,546,258.85
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	200,927	2.89	582,085.51
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	961,810	2.80	2,695,953.43
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	94,487	7.14	675,015.12
PRUDENTIAL PLC	420,136	15.19	6,383,966.52
RSA INSURANCE GROUP PLC	154,294	6.83	1,055,062.37
AVEVA GROUP PLC	19,699	31.65	623,473.35
SAGE GROUP PLC/THE	185,557	6.22	1,154,906.76

	HALMA PLC	63,105	24.79	1,564,372.95	
	BT GROUP PLC	1,394,770	1.68	2,349,490.06	
	VODAFONE GROUP PLC	4,320,767	1.38	6,001,545.36	
	NATIONAL GRID PLC	567,668	9.14	5,190,188.52	
	SEVERN TRENT PLC	37,963	24.52	930,852.76	
	SSE PLC	168,142	14.34	2,411,996.99	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	103,846	9.64	1,001,698.51	
	イギリスポンド 小計	47,121,491		278,263,718.42 (42,758,002,972)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	29,779	19.25	573,245.75	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,371	833.50	1,142,728.50	
	GIVAUDAN-REG	1,548	3,823.00	5,918,004.00	
	HOLCIM LTD	87,054	53.98	4,699,174.92	
	SIKA AG-REG	22,983	272.50	6,262,867.50	
	ABB LTD-REG	303,856	29.99	9,112,641.44	
	GEBERIT AG-REG	6,042	610.20	3,686,828.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	4,261	249.20	1,061,841.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,476	257.60	1,668,217.60	
	ADECCO GROUP AG-REG	27,447	59.68	1,638,036.96	
	SGS SA-REG	996	2,724.00	2,713,104.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	9,320	277.00	2,581,640.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	86,220	93.88	8,094,333.60	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	5,006	291.00	1,456,746.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	7,069	56.80	401,519.20	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	479	2,014.00	964,706.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	169	8,265.00	1,396,785.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	17	88,300.00	1,501,100.00	
	NESTLE SA-REG	474,323	108.24	51,340,721.52	
	ALCON INC	79,678	61.70	4,916,132.60	
	SONOVA HOLDING AG-REG	8,944	258.10	2,308,446.40	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,641	1,326.00	2,175,966.00	
	LONZA GROUP AG-REG	12,406	555.20	6,887,811.20	
	NOVARTIS AG-REG	365,733	78.92	28,863,648.36	
	ROCHE HOLDING AG-BR	5,964	316.80	1,889,395.20	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	115,149	298.75	34,400,763.75	
	VIFOR PHARMA AG	7,203	122.05	879,126.15	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	4,570	87.20	398,504.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	395,072	9.06	3,580,142.46	
	JULIUS BAER GROUP LTD	38,835	56.20	2,182,527.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,048	1,311.00	3,995,928.00	
	UBS GROUP AG-REG	603,510	13.62	8,222,823.75	
	BALOISE HOLDING AG - REG	8,488	148.90	1,263,863.20	

	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	5,034	451.00	2,270,334.00	
	SWISS RE AG	46,136	86.50	3,990,764.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	24,723	380.40	9,404,629.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	11,915	88.95	1,059,839.25	
	TEMENOS AG - REG	10,848	128.70	1,396,137.60	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	26,525	95.26	2,526,771.50	
	SWISSCOM AG-REG	4,298	495.80	2,130,948.40	
	スイスフラン 小計	2,854,136		230,958,743.61 (27,784,336,856)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	438,868	64.10	28,131,438.80	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	223,000	146.40	32,647,200.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	304,000	28.00	8,512,000.00	
	MTR CORP	253,500	44.05	11,166,675.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	355,000	65.35	23,199,250.00	
	SANDS CHINA LTD	433,200	34.20	14,815,440.00	
	SJM HOLDINGS LTD	365,000	9.01	3,288,650.00	
	WYNN MACAU LTD	286,400	13.40	3,837,760.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	285,500	26.20	7,480,100.00	
	WH GROUP LTD	1,590,000	6.76	10,748,400.00	
	BANK OF EAST ASIA LTD	208,820	15.78	3,295,179.60	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	583,000	29.25	17,052,750.00	
	HANG SENG BANK LTD	126,500	158.60	20,062,900.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	198,800	444.20	88,306,960.00	
	AIA GROUP LTD	1,997,000	98.70	197,103,900.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	417,868	49.75	20,788,933.00	
	ESR CAYMAN LTD	295,000	24.00	7,080,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	340,000	19.48	6,623,200.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	234,641	35.30	8,282,827.30	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	279,250	41.25	11,519,062.50	
	SINO LAND CO	491,400	11.80	5,798,520.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	222,000	117.90	26,173,800.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	85,000	61.85	5,257,250.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	174,000	22.70	3,949,800.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	257,000	45.80	11,770,600.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	634,000	10.76	6,821,840.00	
	PCCW LTD	549,000	4.38	2,404,620.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	101,000	48.85	4,933,850.00	
	CLP HOLDINGS LTD	257,500	78.75	20,278,125.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	501,500	7.91	3,966,865.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,830,808	13.22	24,203,281.76	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	234,500	49.65	11,642,925.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	44,100	109.20	4,815,720.00	

	香港ドル 小計	14,597,155		655,959,822.96 (9,189,997,119)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	238,900	5.31	1,268,559.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	268,500	3.70	993,450.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	201,740	4.80	968,352.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	1,234,500	0.81	999,945.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	306,900	4.86	1,491,534.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	291,900	29.44	8,593,536.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	546,400	12.31	6,726,184.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	192,400	26.18	5,037,032.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	133,600	10.04	1,341,344.00	
	CAPITALAND LTD	415,600	3.58	1,487,848.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	101,200	7.58	767,096.00	
	UOL GROUP LTD	104,000	7.38	767,520.00	
	VENTURE CORP LTD	46,100	18.50	852,850.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,295,960	2.42	3,136,223.20	
	シンガポールドル 小計	5,377,700		34,431,473.20 (2,822,692,172)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	200,225	7.68	1,537,728.00	
	A2 MILK CO LTD	115,334	6.19	713,917.46	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	92,498	33.80	3,126,432.40	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	65,340	14.45	944,163.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	297,267	4.54	1,351,078.51	
	MERCURY NZ LTD	123,073	6.72	827,050.56	
	MERIDIAN ENERGY LTD	207,221	5.44	1,127,282.24	
	ニュージーランドドル 小計	1,100,958		9,627,652.17 (759,718,032)	
スウェーデンクローネ	LUNDIN ENERGY AB	31,637	271.20	8,579,954.40	
	BOLIDEN AB	42,325	354.55	15,006,328.75	
	BOLIDEN AB-RED	42,325	5.99	253,569.07	
	SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	96,640	146.95	14,201,248.00	
	ALFA LAVAL AB	56,330	295.10	16,622,983.00	
	ASSA ABLOY AB-B	163,169	248.40	40,531,179.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	108,494	509.00	55,223,446.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	66,920	437.20	29,257,424.00	
	EPIROC AB-A	113,811	196.85	22,403,695.35	
	EPIROC AB-B	65,627	177.40	11,642,229.80	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	26,287	251.40	6,608,551.80	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	49,914	311.60	15,553,202.40	
	SANDVIK AB	188,439	228.90	43,133,687.10	
	SKANSKA AB-B SHS	55,468	235.20	13,046,073.60	
	SKF AB-B SHARES	61,034	223.90	13,665,512.60	

	VOLVO AB-B SHS	231,071	215.30	49,749,586.30	
	SECURITAS AB-B SHS	46,121	141.00	6,503,061.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	38,512	229.90	8,853,908.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	71,384	118.10	8,430,450.40	
	EVOLUTION GAMING GROUP	26,092	1,366.60	35,657,327.20	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	137,679	206.55	28,437,597.45	
	ICA GRUPPEN AB	17,227	395.90	6,820,169.30	
	SWEDISH MATCH AB	255,630	73.67	18,832,262.10	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	99,662	284.10	28,313,974.20	
	NORDEA BANK ABP	538,695	85.36	45,983,005.20	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	266,923	107.40	28,667,530.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	266,896	97.56	26,038,373.76	
	SWEDBANK AB - A SHARES	155,743	147.18	22,922,254.74	
	EQT AB	38,884	265.30	10,315,925.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	17,548	323.20	5,671,513.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	25,773	303.80	7,829,837.40	
	INVESTOR AB-B SHS	73,467	709.70	52,139,529.90	
	KINNEVIK AB - B	38,085	398.70	15,184,489.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	15,339	472.10	7,241,541.90	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	15,289	486.40	7,436,569.60	
	ERICSSON LM-B SHS	490,017	110.50	54,146,878.50	
	HEXAGON AB-B SHS	45,680	780.20	35,639,536.00	
	TELE2 AB-B SHS	79,613	110.45	8,793,255.85	
	TELIA CO AB	409,275	35.86	14,676,601.50	
	スウェーデンクローネ 小計	4,569,025		840,014,265.07 (10,978,986,444)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	156,102	177.26	27,670,640.52	
	NORSK HYDRO ASA	220,397	55.62	12,258,481.14	
	YARA INTERNATIONAL ASA	28,144	437.80	12,321,443.20	
	ADEVINTA ASA	41,557	136.00	5,651,752.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	21,408	339.40	7,265,875.20	
	SCHIBSTED ASA-CL A	11,227	386.40	4,338,112.80	
	MOWI ASA	71,206	216.70	15,430,340.20	
	ORKLA ASA	121,260	84.20	10,210,092.00	
	DNB ASA	149,372	179.55	26,819,742.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	35,073	188.25	6,602,492.25	
	TELENOR ASA	113,645	146.90	16,694,450.50	
	ノルウェークローネ 小計	969,391		145,263,422.41 (1,908,761,370)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	18,858	541.80	10,217,264.40	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	34,335	438.20	15,045,597.00	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	1,135	2,860.00	3,246,100.00	

	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	166,120	228.70	37,991,644.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	477	14,960.00	7,135,920.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,017	15,800.00	16,068,600.00	
	DSV PANALPINA A/S	33,631	1,389.00	46,713,459.00	
	PANDORA A/S	16,039	746.00	11,965,094.00	
	CARLSBERG AS-B	17,767	1,097.00	19,490,399.00	
	AMBU A/S-B	25,886	301.10	7,794,274.60	
	COLOPLAST-B	19,220	955.00	18,355,100.00	
	DEMANT A/S	21,128	303.00	6,401,784.00	
	GN STORE NORD A/S	20,791	486.90	10,123,137.90	
	GENMAB A/S	10,632	2,229.00	23,698,728.00	
	H LUNDBECK A/S	12,999	202.00	2,625,798.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	283,976	465.25	132,119,834.00	
	DANSKE BANK A/S	112,289	116.35	13,064,825.15	
	TRYG A/S	54,196	142.05	7,698,541.80	
	ORSTED A/S	31,581	839.60	26,515,407.60	
	デンマーククローネ 小計	882,077		416,271,508.45 (7,392,981,990)	
イスラエルシェケル	ICL GROUP LTD	130,066	22.30	2,900,471.80	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,465	426.80	1,478,862.00	
	BANK HAPOLIM BM	175,741	26.71	4,694,042.11	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	220,982	24.05	5,314,617.10	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	204,489	15.12	3,091,873.68	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	18,225	92.43	1,684,536.75	
	AZRIELI GROUP LTD	9,146	231.30	2,115,469.80	
	NICE LTD	9,783	736.50	7,205,179.50	
	イスラエルシェケル 小計	771,897		28,485,052.74 (941,721,540)	
ユーロ	ENI SPA	408,620	10.24	4,186,720.52	
	GALP ENERGIA SGPS SA	84,034	10.04	843,701.36	
	NESTE OYJ	68,193	49.06	3,345,548.58	
	OMV AG	24,140	44.25	1,068,195.00	
	REPSOL SA	243,914	10.71	2,613,782.42	
	TENARIS SA	78,513	9.56	750,584.28	
	TOTAL SE	414,473	38.42	15,924,052.66	
	VOPAK	12,317	38.30	471,741.10	
	AIR LIQUIDE SA	78,164	141.12	11,030,503.68	
	AKZO NOBEL N.V.	31,253	101.35	3,167,491.55	
	ARCELORMITTAL	119,226	27.05	3,225,659.43	
	ARKEMA	11,538	109.10	1,258,795.80	
	BASF SE	151,469	69.25	10,489,228.25	
	COVESTRO AG	29,777	57.56	1,713,964.12	

CRH PLC	127,755	41.20	5,263,506.00
EVONIK INDUSTRIES AG	33,254	29.51	981,325.54
FUCHS PETROLUB SE-PREF	9,927	41.94	416,338.38
HEIDELBERGCEMENT AG	24,488	74.04	1,813,091.52
KONINKLIJKE DSM NV	28,074	147.80	4,149,337.20
LANXESS AG	13,421	63.42	851,159.82
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	40,487	43.41	1,757,540.67
SOLVAY SA	13,316	114.25	1,521,353.00
STORA ENSO OYJ-R SHS	92,258	15.70	1,448,450.60
SYMRISE AG	21,324	106.10	2,262,476.40
UMICORE	31,574	50.44	1,592,592.56
UPM-KYMMENE OYJ	86,702	32.59	2,825,618.18
VOESTALPINE AG	16,995	37.48	636,972.60
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	37,815	27.53	1,041,046.95
AIRBUS SE	97,353	95.90	9,336,152.70
ALSTOM	42,585	45.23	1,926,119.55
BOUYGUES SA	38,278	34.80	1,332,074.40
BRENTAG SE	25,275	73.88	1,867,317.00
CNH INDUSTRIAL NV	175,993	13.47	2,370,625.71
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	84,968	54.88	4,663,043.84
DASSAULT AVIATION SA	465	969.00	450,585.00
EIFFAGE	13,381	94.12	1,259,419.72
FERROVIAL SA	78,699	24.66	1,940,717.34
GEA GROUP AG	25,583	36.33	929,430.39
HOCHTIEF AG	3,195	70.86	226,397.70
KINGSPAN GROUP PLC	24,271	75.36	1,829,062.56
KION GROUP AG	12,586	83.20	1,047,155.20
KNORR-BREMSE AG	11,550	103.55	1,196,002.50
KONE OYJ-B	55,428	66.70	3,697,047.60
LEGRAND SA	43,362	84.02	3,643,275.24
MTU AERO ENGINES AG	9,251	207.20	1,916,807.20
PRYSMIAN SPA	39,563	26.34	1,042,089.42
RATIONAL AG	905	775.00	701,375.00
SAFRAN SA	53,550	122.50	6,559,875.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	88,597	129.02	11,430,784.94
SIEMENS AG-REG	126,014	139.74	17,609,196.36
SIEMENS ENERGY AG	64,097	25.02	1,603,706.94
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	36,513	25.97	948,242.61
THALES SA	17,267	85.40	1,474,601.80
VINCI SA	85,921	92.74	7,968,313.54
WARTSILA OYJ ABP	65,918	10.49	691,809.41
BUREAU VERITAS SA	45,344	24.74	1,121,810.56

RANDSTAD NV	18,516	61.24	1,133,919.84
TELEPERFORMANCE	9,439	312.90	2,953,463.10
WOLTERS KLUWER	45,128	77.02	3,475,758.56
ADP	5,184	113.70	589,420.80
AENA SME SA	10,979	144.05	1,581,524.95
ATLANTIA SPA	82,100	16.13	1,324,273.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	49,916	10.75	536,696.83
DEUTSCHE POST AG-REG	163,552	50.33	8,231,572.16
GETLINK SE	68,170	13.48	919,272.45
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	53,710	84.22	4,523,456.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	11,483	70.00	803,810.00
CONTINENTAL AG	17,470	113.44	1,981,796.80
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	141,490	72.36	10,238,216.40
FAURECIA	19,981	44.20	883,160.20
FERRARI NV	20,410	162.50	3,316,625.00
MICHELIN (CGDE)	28,725	122.90	3,530,302.50
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	24,658	84.46	2,082,614.68
RENAULT SA	29,484	33.07	975,035.88
STELLANTIS NV	336,354	14.66	4,931,622.34
VALEO SA	37,841	26.83	1,015,274.03
VOLKSWAGEN AG	5,961	258.00	1,537,938.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	29,778	208.80	6,217,646.40
ADIDAS AG	31,385	284.25	8,921,186.25
ESSILORLUXOTTICA	47,298	137.90	6,522,394.20
HERMES INTERNATIONAL	5,155	1,049.00	5,407,595.00
KERING	12,506	693.60	8,674,161.60
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	45,764	612.30	28,021,297.20
MONCLER SPA	30,779	50.54	1,555,570.66
PUMA SE	15,930	88.50	1,409,805.00
SEB SA	3,606	154.20	556,045.20
ACCOR SA	30,762	32.11	987,767.82
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	27,475	155.50	4,272,362.50
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	12,720	43.08	547,977.60
SODEXO SA	14,297	83.60	1,195,229.20
BOLLORE	137,374	4.27	586,586.98
PUBLICIS GROUPE	38,571	55.12	2,126,033.52
SCOUT24 AG	17,842	68.54	1,222,890.68
SES	68,465	6.44	441,462.32
UBISOFT ENTERTAINMENT	14,966	61.64	922,504.24
VIVENDI	133,765	29.40	3,932,691.00
DELIVERY HERO SE	21,377	113.95	2,435,909.15
HELLOFRESH SE	23,413	64.48	1,509,670.24

INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	177,144	30.83	5,461,349.52	
JUST EAT TAKEAWAY	20,480	79.39	1,625,907.20	
PROSUS NV	80,524	84.75	6,824,409.00	
ZALANDO SE	26,732	83.46	2,231,052.72	
CARREFOUR SA	99,831	16.56	1,653,201.36	
COLRUYT SA	9,744	49.58	483,107.52	
JERONIMO MARTINS	42,529	15.39	654,733.95	
KESKO OYJ-B SHS	49,347	26.09	1,287,463.23	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	178,581	22.84	4,079,682.94	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	126,249	60.87	7,684,776.63	
DANONE	103,185	55.98	5,776,296.30	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	92,086	10.06	926,845.59	
HEINEKEN HOLDING NV	21,030	83.35	1,752,850.50	
HEINEKEN NV	43,361	97.68	4,235,502.48	
JDE PEET'S NV	11,100	32.45	360,195.00	
KERRY GROUP PLC-A	26,860	108.70	2,919,682.00	
PERNOD RICARD SA	35,078	170.90	5,994,830.20	
REMY COINTREAU	3,357	164.50	552,226.50	
BEIERSDORF AG	16,868	96.66	1,630,460.88	
HENKEL AG & CO KGAA	18,684	81.60	1,524,614.40	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	29,518	94.52	2,790,041.36	
L'OREAL	41,465	346.40	14,363,476.00	
AMPLIFON SPA	21,192	33.79	716,077.68	
BIOMERIEUX	6,814	94.72	645,422.08	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	6,830	138.40	945,272.00	
DIASORIN SPA	4,411	138.25	609,820.75	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	36,625	64.72	2,370,370.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	68,394	42.37	2,898,195.75	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	149,837	45.52	6,821,329.42	
ORPEA	8,232	104.30	858,597.60	
SARTORIUS AG-VORZUG	5,689	415.00	2,360,935.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	46,681	46.08	2,151,060.48	
ARGENX SE	7,993	212.00	1,694,516.00	
BAYER AG-REG	162,079	53.43	8,659,880.97	
EUROFINS SCIENTIFIC	23,374	81.66	1,908,720.84	
GALAPAGOS NV	7,338	60.37	442,995.06	
GRIFOLS SA	49,300	23.81	1,173,833.00	
IPSEN	6,733	79.90	537,966.70	
MERCK KGAA	21,059	138.90	2,925,095.10	
ORION OYJ-CLASS B	18,091	35.70	645,848.70	
QIAGEN N.V.	35,849	38.46	1,378,752.54	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	17,261	43.78	755,686.58	

SANOFI	186,932	85.15	15,917,259.80
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,900	354.90	1,739,010.00
UCB SA	20,162	75.88	1,529,892.56
ABN AMRO BANK NV-CVA	75,399	10.99	828,635.01
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,125,424	4.90	5,524,706.41
BANCO SANTANDER SA	2,850,462	3.25	9,264,001.50
BNP PARIBAS	185,085	55.80	10,327,743.00
CAIXABANK SA	715,283	2.75	1,967,743.53
COMMERZBANK AG	161,446	5.76	931,381.97
CREDIT AGRICOLE SA	184,965	13.20	2,442,647.79
ERSTE GROUP BANK AG	50,031	31.76	1,588,984.56
FINECOBANK SPA	98,210	13.90	1,365,610.05
ING GROEP NV	648,849	10.75	6,979,019.84
INTESA SANPAOLO	2,755,435	2.38	6,559,313.01
KBC GROUP NV	41,035	66.36	2,723,082.60
MEDIOBANCA SPA	104,907	9.67	1,014,870.31
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	26,632	19.13	509,470.16
SOCIETE GENERALE SA	137,482	25.25	3,471,420.50
UNICREDIT SPA	361,677	9.91	3,584,219.07
AMUNDI SA	10,517	74.60	784,568.20
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	333,263	11.32	3,775,203.26
DEUTSCHE BOERSE AG	30,626	138.50	4,241,701.00
EURAZEO SE	7,132	70.00	499,240.00
EXOR NV	16,728	67.26	1,125,125.28
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	17,656	89.88	1,586,921.28
NATIXIS	139,223	4.14	576,383.22
SOFINA	2,674	312.00	834,288.00
WENDEL	4,862	113.00	549,406.00
AEGON NV	283,341	3.90	1,107,013.28
AGEAS	28,346	51.04	1,446,779.84
ALLIANZ SE-REG	67,846	210.90	14,308,721.40
ASSICURAZIONI GENERALI	180,355	17.41	3,139,980.55
AXA SA	320,227	22.57	7,227,523.39
CNP ASSURANCES	31,208	15.26	476,234.08
HANNOVER RUECK SE	9,774	148.85	1,454,859.90
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	23,439	240.45	5,635,907.55
NN GROUP NV	47,538	42.56	2,023,217.28
POSTE ITALIANE SPA	87,776	11.17	980,896.80
SAMPO OYJ-A SHS	76,153	39.81	3,031,650.93
SCOR SE	27,160	27.53	747,714.80
AROUNDTOWN SA	170,559	6.50	1,108,974.61
DEUTSCHE WOHNEN SE	56,738	42.33	2,401,719.54

LEG IMMOBILIEN SE	12,018	114.90	1,380,868.20
VONOVIA SE	90,297	50.54	4,563,610.38
ADYEN NV	3,028	1,779.00	5,386,812.00
AMADEUS IT GROUP SA	75,065	58.90	4,421,328.50
ATOS SE	16,434	55.98	919,975.32
BECHTLE AG	4,126	150.35	620,344.10
CAPGEMINI SE	26,012	151.25	3,934,315.00
DASSAULT SYSTEMES SE	21,436	184.60	3,957,085.60
EDENRED	39,271	45.56	1,789,186.76
NEMETSCHEK SE	8,419	55.88	470,453.72
NEXI SPA	74,508	15.34	1,143,325.26
SAP SE	171,947	113.26	19,474,717.22
TEAMVIEWER AG	25,425	31.85	809,786.25
WORLDLINE SA	37,901	75.47	2,860,388.47
NOKIA OYJ	963,529	4.06	3,912,409.50
CELLNEX TELECOM SA	73,262	46.00	3,370,052.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	549,141	16.35	8,978,455.35
ELISA OYJ	23,784	48.04	1,142,583.36
ILIAD SA	2,776	149.45	414,873.20
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	47,802	9.46	452,206.92
KONINKLIJKE KPN NV	561,774	2.78	1,563,978.81
ORANGE	323,647	10.35	3,351,041.03
PROXIMUS	26,824	17.04	457,080.96
TELECOM ITALIA SPA	1,422,555	0.42	608,426.77
TELECOM ITALIA-RSP	847,742	0.46	394,454.35
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	168,220	2.50	420,886.44
TELEFONICA SA	852,575	3.94	3,366,818.67
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	18,896	34.51	652,100.96
E.ON SE	374,096	10.60	3,966,165.79
EDF	99,950	11.46	1,145,427.00
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	476,013	4.38	2,085,412.95
ELIA GROUP SA/NV	5,662	87.65	496,274.30
ENAGAS SA	42,336	18.86	798,668.64
ENDESA SA	52,405	21.95	1,150,289.75
ENEL SPA	1,338,630	8.06	10,794,712.32
ENGIE	306,059	12.18	3,729,022.85
FORTUM OYJ	70,476	22.59	1,592,052.84
IBERDROLA SA	1,006,207	11.19	11,259,456.33
NATURGY ENERGY GROUP SA	47,043	21.52	1,012,365.36
RED ELECTRICA CORPORACION SA	71,520	15.97	1,142,174.40
RWE AG	107,669	30.80	3,316,205.20
SNAM SPA	334,118	4.78	1,598,754.63

SUEZ	55,054	19.92	1,096,675.68	
TERNA SPA	231,929	6.12	1,421,260.91	
UNIPER SE	31,628	30.11	952,319.08	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	86,891	25.14	2,184,439.74	
VERBUND AG	11,251	70.40	792,070.40	
ASM INTERNATIONAL NV	7,619	242.40	1,846,845.60	
ASML HOLDING NV	70,200	514.70	36,131,940.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	215,543	31.49	6,788,526.78	
STMICROELECTRONICS NV	107,274	29.18	3,130,255.32	
ユーロ 小計	30,945,691		753,361,362.24 (99,488,901,497)	
合 計	179,705,888		910,617,839,305 (910,617,839,305)	

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
アメリカ ドル	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,698	3,841,630.90	
		AMERICAN TOWER CORP	73,339	18,138,201.48	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	22,847	4,482,124.46	
		BOSTON PROPERTIES INC	23,547	2,533,421.73	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	15,886	1,947,305.88	
		CROWN CASTLE INTL CORP	71,266	12,986,090.52	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	46,862	6,966,036.30	
		DUKE REALTY CORP	59,699	2,706,752.66	
		EQUINIX INC	14,771	10,606,168.84	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,812	1,939,887.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	60,749	4,506,968.31	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,322	2,998,850.66	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	20,858	3,026,495.80	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	92,453	3,035,231.99	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	113,592	1,929,928.08	
		INVITATION HOMES INC	92,032	3,228,482.56	
		IRON MOUNTAIN INC	48,019	2,013,436.67	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	94,870	2,023,577.10	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	18,548	2,924,834.12	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	37,887	1,366,962.96	
		PROLOGIS INC	122,174	14,032,905.64	
		PUBLIC STORAGE	26,370	7,233,818.40	

		REALTY INCOME CORP	56,744	3,755,885.36	
		REGENCY CENTERS CORP	30,389	1,960,698.28	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	18,540	5,403,483.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	54,798	6,720,426.72	
		SUN COMMUNITIES INC	17,306	2,835,068.92	
		UDR INC	51,580	2,378,869.60	
		VENTAS INC	60,629	3,250,320.69	
		VEREIT INC	36,245	1,653,859.35	
		VICI PROPERTIES INC	92,751	2,843,745.66	
		VORNADO REALTY TRUST	26,516	1,220,001.16	
		WELLTOWER INC	67,418	4,927,581.62	
		WEYERHAEUSER CO	124,671	4,941,958.44	
		WP CAREY INC	28,536	2,101,391.04	
		アメリカドル合計			1,781,724
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,900	839,019.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	30,800	640,640.00	
カナダドル合計			45,700	1,479,659.00 (132,932,564)	
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS	172,849	1,802,815.07	
		GOODMAN GROUP	281,173	5,381,651.22	
		GPT GROUP	311,121	1,437,379.02	
		MIRVAC GROUP	610,283	1,720,998.06	
		SCENTRE GROUP	825,910	2,238,216.10	
		STOCKLAND	364,901	1,678,544.60	
		VICINITY CENTRES	685,696	1,049,114.88	
オーストラリアドル合計			3,251,933	15,308,718.95 (1,302,618,895)	
イギリスポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	132,156	699,898.17	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	120,755	876,198.28	
		SEGRO PLC	187,002	1,850,197.78	
イギリスポンド合計			439,913	3,426,294.23 (526,484,371)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	335,300	24,996,615.00	
香港ドル合計			335,300	24,996,615.00 (350,202,576)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	593,200	1,744,008.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	763,500	1,603,350.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	383,600	790,216.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	478,000	941,660.00	
		SUNTEC REIT	254,700	382,050.00	
			2,473,000	5,461,284.00	

シンガポールドル合計				(447,716,062)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	9,200	702,512.00	
		GECINA SA	7,182	935,455.50	
		KLEPIERRE	28,639	675,307.62	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	22,777	1,640,171.77	
ユーロ合計			67,798	3,953,446.89	
				(522,092,196)	
合計				20,522,755,990	
				(20,522,755,990)	

(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 593銘柄	97.42%	—	70.05%
	投資証券 35銘柄	—	2.58%	1.85%
カナダドル	株式 87銘柄	99.60%	—	3.60%
	投資証券 2銘柄	—	0.40%	0.01%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	94.11%	—	2.24%
	投資証券 7銘柄	—	5.89%	0.14%
イギリスポンド	株式 85銘柄	98.78%	—	4.59%
	投資証券 3銘柄	—	1.22%	0.06%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.00%	—	2.98%
香港ドル	株式 33銘柄	96.33%	—	0.99%
	投資証券 1銘柄	—	3.67%	0.04%
シンガポールドル	株式 14銘柄	86.31%	—	0.30%
	投資証券 5銘柄	—	13.69%	0.05%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.00%	—	0.08%
スウェーデンクローネ	株式 39銘柄	100.00%	—	1.18%
ノルウェークローネ	株式 11銘柄	100.00%	—	0.20%
デンマーククローネ	株式 19銘柄	100.00%	—	0.79%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.00%	—	0.10%
ユーロ	株式 233銘柄	99.48%	—	10.68%
	投資証券 4銘柄	—	0.52%	0.06%

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海外株式インデックスファンド】

【純資産額計算書】

令和 3年 5月31日現在

（単位：円）

資産総額	85,568,446,562
負債総額	179,904,954
純資産総額（ - ）	85,388,541,608
発行済口数	27,631,504,103口
1口当たり純資産価額（ / ）	3.0903
（10,000口当たり）	（30,903）

（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

令和 3年 5月31日現在

（単位：円）

資産総額	1,025,624,978,372
負債総額	9,955,388,244
純資産総額（ - ）	1,015,669,590,128
発行済口数	249,467,586,851口
1口当たり純資産価額（ / ）	4.0713
（10,000口当たり）	（40,713）

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め、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、

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

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

（５）受益権の譲渡の対抗要件

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額等

2021年5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。

2021年 5月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本 数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	891	17,318,734
追加型公社債投資信託	16	1,444,650
単位型株式投資信託	79	353,998
単位型公社債投資信託	44	186,216
合 計	1,030	19,303,599

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

3【委託会社等の経理状況】

（１）財務諸表の作成方法について

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

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

（２）監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36期事業年度（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

(単位：千円)

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金	2 56,398,457	2 56,803,388
有価証券	1,960,318	2,001
前払費用	575,904	598,135
未収入金	14,559	31,359
未収委託者報酬	10,296,453	13,216,357
未収収益	2 638,994	2 662,230
金銭の信託	100,000	2,300,000

その他		254,330		269,506
流動資産合計		70,239,017		73,882,978
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	584,048	1	548,902
器具備品	1	871,893	1	1,435,369
土地		628,433		628,433
有形固定資産合計		2,084,375		2,612,705
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		3,369,611		3,569,171
ソフトウェア仮勘定		1,374,932		1,895,190
無形固定資産合計		4,760,365		5,480,184
投資その他の資産				
投資有価証券		16,704,756		18,616,670
関係会社株式		320,136		320,136
投資不動産	1	819,255	1	814,684
長期差入保証金		565,358		538,497
前払年金費用		375,031		258,835
繰延税金資産		1,912,824		916,962
その他		45,230		45,230
貸倒引当金		23,600		23,600
投資その他の資産合計		20,718,993		21,487,417
固定資産合計		27,563,734		29,580,307
資産合計		97,802,752		103,463,286

(単位：千円)

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	687,565	533,622
未払金		
未払収益分配金	131,478	158,856
未払償還金	395,400	133,877
未払手数料	2 4,026,078	2 5,200,810
その他未払金	2 3,818,195	2 4,412,521
未払費用	2 4,402,578	2 4,755,909
未払消費税等	629,469	752,617
未払法人税等	617,341	873,027
賞与引当金	933,517	933,381
役員賞与引当金	124,590	160,710
その他	701,285	691,143
流動負債合計	16,467,499	18,606,476
固定負債		
長期未払金	32,400	21,600
退職給付引当金	1,010,401	1,145,514
役員退職慰労引当金	130,784	117,938

時効後支払損引当金	238,811	245,426
固定負債合計	1,412,398	1,530,479
負債合計	17,879,897	20,136,956
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金	3,572,096	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712	44,732,712
利益剰余金		
利益準備金	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金	25,847,605	26,951,289
利益剰余金合計	33,188,194	34,291,879
株主資本合計	79,921,039	81,024,723

(単位：千円)

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,815	2,301,606
評価・換算差額等合計	1,815	2,301,606
純資産合計	79,922,854	83,326,329
負債純資産合計	97,802,752	103,463,286

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	67,967,489	67,963,712
投資顧問料	2,385,084	2,443,980
その他営業収益	16,085	21,613
営業収益合計	70,368,658	70,429,306
営業費用		
支払手数料	2 27,106,451	2 26,689,896
広告宣伝費	696,418	668,150
公告費	1,000	250
調査費		
調査費	1,857,271	2,077,942
委託調査費	11,579,175	12,035,954
事務委託費	847,769	798,528
営業雑経費		
通信費	153,731	296,490

印刷費	427,118	378,180
協会費	52,053	51,841
諸会費	15,990	16,613
事務機器関連費	1,953,926	1,977,769
その他営業雑経費	-	8,391
営業費用合計	44,690,907	45,000,009
一般管理費		
給料		
役員報酬	331,987	352,879
給料・手当	6,611,427	6,461,546
賞与引当金繰入	933,517	933,381
役員賞与引当金繰入	124,590	160,710
福利厚生費	1,276,950	1,272,568
交際費	11,871	2,721
旅費交通費	165,891	22,768
租税公課	360,165	402,939
不動産賃借料	647,402	666,331
退職給付費用	422,919	481,135
役員退職慰労引当金繰入	48,183	11,763
固定資産減価償却費	1,307,555	1,358,911
諸経費	427,212	413,538
一般管理費合計	12,669,674	12,541,193
営業利益	13,008,076	12,888,103

(単位：千円)

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	90,965	170,807
受取利息	2 4,169	2 2,726
投資有価証券償還益	585,179	81,557
収益分配金等時効完成分	101,734	275,835
受取賃貸料	2 65,808	2 65,808
その他	19,987	12,504
営業外収益合計	867,845	609,239
営業外費用		
投資有価証券償還損	96,379	95,946
時効後支払損引当金繰入	-	16,395
事務過誤費	3,483	-
賃貸関連費用	20,339	13,472
その他	1,920	2,932
営業外費用合計	122,122	128,747
経常利益	13,753,799	13,368,595
特別利益		
投資有価証券売却益	174,842	2,007,655
特別利益合計	174,842	2,007,655
特別損失		
投資有価証券売却損	75,963	51,737
投資有価証券評価損	163,865	26,317
固定資産除却損	1 8,832	1 536

固定資産売却損		435		-
特別損失合計		249,096		78,591
税引前当期純利益		13,679,545		15,297,659
法人税、住民税及び事業税	2	4,146,534	2	4,755,427
法人税等調整額		79,824		19,122
法人税等合計		4,226,359		4,736,304
当期純利益		9,453,186		10,561,354

（３）【株主資本等変動計算書】

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,069,594	33,410,184	80,143,028
当期変動額									
剰余金の配当							9,675,175	9,675,175	9,675,175
当期純利益							9,453,186	9,453,186	9,453,186
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	221,989	221,989	221,989
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	25,847,605	33,188,194	79,921,039

	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	1,126,733	1,126,733	81,269,762
当期変動額			
剰余金の配当			9,675,175
当期純利益			9,453,186
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,124,917	1,124,917	1,124,917
当期変動額合計	1,124,917	1,124,917	1,346,907
当期末残高	1,815	1,815	79,922,854

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		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	25,847,605	33,188,194	79,921,039
当期変動額									
剰余金の配当							9,457,670	9,457,670	9,457,670
当期純利益							10,561,354	10,561,354	10,561,354
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	1,103,684	1,103,684	1,103,684
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,951,289	34,291,879	81,024,723

	評価・換算差額等	
--	----------	--

	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
当期首残高	1,815	1,815	79,922,854
当期変動額			
剰余金の配当			9,457,670
当期純利益			10,561,354
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	2,299,791	2,299,791	2,299,791
当期変動額合計	2,299,791	2,299,791	3,403,475
当期末残高	2,301,606	2,301,606	83,326,329

[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. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、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。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

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

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

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。

6. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(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。

(3) 「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」の適用

令和2年度税制改正において従来の連結納税制度が見直され、グループ通算制度に移行する税制改正法（「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号））が令和2年3月31日に公布されておりますが、繰延税金資産の額について、実務対応報告第39号「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」により企業会計基準適用指針第28号「税効果会計に係る会計基準の適用指針」第44項の定めを適用せず、改正前の税法の規定に基づいて算定しております。

（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 令和2年3月31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 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31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せ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

令和4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」等の適用により、翌事業年度の期首の純資産に累積的影響額が反映され、繰越利益剰余金の期首残高が475,687千円増加すると見込まれます。

- ・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）

- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31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）が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス（国際財務報告基準（IFRS）においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」）を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定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、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされております。

(2)適用予定日

令和4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

「時価の算定に関する会計基準」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.有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
建物	599,542千円	643,920千円
器具備品	1,408,613千円	1,545,179千円
投資不動産	145,391千円	151,833千円

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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
預金	314,247千円	40,328,414千円
未収収益	15,773千円	14,138千円
未払手数料	712,210千円	772,495千円
その他未払金	3,029,426千円	3,425,136千円
未払費用	432,019千円	349,222千円

（損益計算書関係）

1.固定資産除却損の内訳

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
器具備品	8,832千円	536千円
計	8,832千円	536千円

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35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
--	--------------------------------------	-------------------------------------

支払手数料	5,234,629千円	5,128,270千円
受取利息	2千円	143千円
受取賃貸料	65,808千円	65,808千円
法人税、住民税及び事業税	3,030,180千円	3,492,898千円

（株主資本等変動計算書関係）

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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

令和元年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	9,675,175千円
1株当たり配当額	45,728円
基準日	平成31年3月31日
効力発生日	令和元年6月27日

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

令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	9,457,670千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	44,700円
基準日	令和2年3月31日
効力発生日	令和2年6月29日

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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

令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	9,457,670千円
1株当たり配当額	44,700円
基準日	令和2年3月31日
効力発生日	令和2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

令和3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	10,576,511千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	49,988円
基準日	令和3年3月31日
効力発生日	令和3年6月29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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
1年内	675,956千円	709,808千円
1年超	—	709,808千円
合計	675,956千円	1,419,616千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

(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35期(令和2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	56,398,457	56,398,457	-
(2) 有価証券	1,960,318	1,960,318	-
(3) 金銭の信託	100,000	100,000	-
(4) 未収委託者報酬	10,296,453	10,296,453	-
(5) 投資有価証券	16,673,396	16,673,396	-
資産計	85,428,625	85,428,625	-
(1) 未払手数料	4,026,078	4,026,078	-
負債計	4,026,078	4,026,078	-

第36期(令和3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	56,803,388	56,803,388	-
(2) 有価証券	2,001	2,001	-
(3) 金銭の信託	2,300,000	2,300,000	-
(4) 未収委託者報酬	13,216,357	13,216,357	-
(5) 投資有価証券	18,585,310	18,585,310	-
資産計	90,907,057	90,907,057	-
(1) 未払手数料	5,200,810	5,200,810	-
負債計	5,200,810	5,200,810	-

(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、(4) 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、(5)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。

(3)金銭の信託

時価は取引金融機関から提示された価格によっております。

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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
非上場株式	31,360	31,360
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、「(5)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35期(令和2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	56,398,457	-	-	-
金銭の信託	100,000	-	-	-
未収委託者報酬	10,296,453	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	1,960,318	5,652,257	4,813,929	27,375
合計	68,755,228	5,652,257	4,813,929	27,375

第36期(令和3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	56,803,388	-	-	-
金銭の信託	2,300,000	-	-	-
未収委託者報酬	13,216,357	-	-	-
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	2,001	8,412,286	3,123,026	11,398
合計	72,321,747	8,412,286	3,123,026	11,398

(有価証券関係)

1.子会社株式及び関連会社株式

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

2.その他有価証券

第35期(令和2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の	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	9,859,345	8,694,010	1,165,334
	小計	9,859,345	8,694,010	1,165,334
貸借対照表計上額が取得原価を超えないものの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	8,874,369	10,037,087	1,162,718
	小計	8,874,369	10,037,087	1,162,718
合計		18,733,714	18,731,098	2,616

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」（貸借対照表計上額は100,000千円）を含めておりません。

非上場株式（貸借対照表計上額は31,360千円）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、含めておりません。

第36期(令和3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の	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	14,810,957	11,362,471	3,448,485
	小計	14,810,957	11,362,471	3,448,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないものの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,076,354	6,207,447	131,093
	小計	6,076,354	6,207,447	131,093
合計		20,887,311	17,569,919	3,317,392

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」（貸借対照表計上額は2,300,000千円）を含めております。

非上場株式（貸借対照表計上額は31,360千円）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、含めておりません。

3.売却したその他有価証券

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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	8,940	-	15,060
債券	-	-	-
その他	2,035,469	174,842	60,903
合計	2,044,409	174,842	75,963

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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	5,747,529	2,007,655	51,737
合計	5,747,529	2,007,655	51,737

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163,865千円（その他有価証券のその他163,865千円）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26,317千円（その他有価証券のその他26,317千円）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35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,712,289 千円	3,718,736 千円
勤務費用	204,225	203,106
利息費用	17,557	19,110
数理計算上の差異の発生額	52,430	18,826
退職給付の支払額	162,904	192,890
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	3,718,736	3,729,235

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
年金資産の期首残高	2,666,937 千円	2,460,824 千円
期待運用収益	47,757	44,130
数理計算上の差異の発生額	164,633	304,281
事業主からの拠出額	51,282	-
退職給付の支払額	140,518	159,390
年金資産の期末残高	2,460,824	2,649,846

(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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	2,969,807 千円	2,810,893 千円
年金資産	2,460,824	2,649,846
	508,982	161,046
非積立型制度の退職給付債務	748,929	918,342
未積立退職給付債務	1,257,911	1,079,388
未認識数理計算上の差異	203,136	161,333
未認識過去勤務費用	419,405	354,043
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635,370	886,678
退職給付引当金	1,010,401	1,145,514
前払年金費用	375,031	258,835

貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635,370	886,678
---------------------	---------	---------

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
勤務費用	204,225 千円	203,106 千円
利息費用	17,557	19,110
期待運用収益	47,757	44,130
数理計算上の差異の費用処理額	24,035	41,361
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	6,427	44,446
確定給付制度に係る退職給付費用	269,848	329,255

(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、再就職支援金及び退職金です。

(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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
債券	64.7 %	62.7 %
株式	32.3	35.4
その他	3.0	1.9
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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
割引率	0.095～0.52%	0.051～0.59%
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153,070千円、当事業年度151,880千円であります。

(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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	427,046千円	418,394千円
投資有価証券評価損	226,322	188,859
未払事業税	117,461	180,263
賞与引当金	285,842	285,801
役員賞与引当金	19,703	25,472
役員退職慰労引当金	40,046	36,112
退職給付引当金	309,384	350,756

減価償却超過額	96,767	68,024
委託者報酬	213,044	209,938
長期差入保証金	40,180	48,639
時効後支払損引当金	73,124	75,149
連結納税適用による時価評価	57,656	38,873
その他	123,248	87,023
繰延税金資産 小計	2,029,829	2,013,308
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	2,029,829	2,013,308
繰延税金負債		
前払年金費用	114,834	79,225
連結納税適用による時価評価	1,260	1,203
その他有価証券評価差額金	801	1,015,785
その他	109	101
繰延税金負債 合計	117,005	1,096,346
繰延税金資産の純額	1,912,824	916,962

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35期（令和2年3月31日現在）及び第36期（令和3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35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）及び第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）及び第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (注4)	科目	期末残高 (注4)
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 (注1)	3,030,180 千円	その他未払金	3,029,426 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 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,234,629 千円	未払手数料	712,210 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	583,270 千円	未払費用	302,681 千円

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (注4)	科目	期末残高 (注4)
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 (注1)	3,492,898 千円	その他未払金	3,425,136 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 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,128,270 千円	未払手数料	772,495 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	523,327 千円	未払費用	290,120 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 1. 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

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

3. 投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。

4. 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35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (注3)	科目	期末残高 (注3)
----	--------	-----	-----	-------	------------------------	---------------	-------	--------------	----	--------------

同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1）	4,073,855 千円	未払手数料	697,109 千円
						取引銀行	コーラブル預金の払戻（注2）	20,000,000 千円		
							コーラブル預金の預入（注2）	20,000,000 千円	現金及び預金	20,000,000 千円
							コーラブル預金に係る受取利息（注2）	4,126 千円	未収収益	997 千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1）	5,714,501 千円	未払手数料	944,351 千円

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注3）	科目	期末残高（注3）
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1）	3,729,785 千円	未払手数料	764,501 千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1）	5,655,482 千円	未払手数料	1,193,245 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2.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35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）	第36期 （自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）
１株当たり純資産額	377,741.17円	393,827.09円
１株当たり当期純利益金額	44,678.80円	49,916.36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35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）	第36期 （自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）
当期純利益金額（千円）	9,453,186	10,561,354
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）	9,453,186	10,561,354
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581	211,581

４【利害関係人との取引制限】

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

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

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

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。）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（2020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 (2020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。
株式会社南都銀行	37,924 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社中国銀行	15,149 百万円	銀行業務を営んでいます。
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
株式会社京葉銀行	49,759 百万円	銀行業務を営んでいます。
損保ジャパンＤＣ証券株式会社	3,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

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。（2021年5月末現在）

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

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

第３【その他】

（１）目論見書の表紙にロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、また使用開始日、ファンドの形態、申込みに係る事項、ファンド専用サイトのアドレスなどを記載することがあります。

（２）投資信託説明書（交付目論見書）に、以下の趣旨の文言の全部または一部および有価証券届出書の主要内容を記載することがあります。

- ・ファンドに関する投資信託説明書（請求目論見書）を含む詳細な情報は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
- ・本書には、約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されています。
- ・ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- ・ファンドの商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認します。
- ・ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
- ・請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。（請

求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようお願いいたします。）

- ・有価証券届出書の効力の発生の有無については、委託会社のホームページにて確認いただけます。効力が発生するまでに、本書の記載内容が訂正される場合があります。

- （３）投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。
- （４）目論見書は電磁的方法により提供されるほか、インターネット、電子媒体等に掲載されることがあります。
- （５）投信評価機関、投信評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
- （６）目論見書は「投資信託説明書」を別称として使用します。
- （７）目論見書に委託会社のホームページアドレス等を掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨のご案内を記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

令和3年6月28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
東京事務所指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

青木 裕晃 印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊藤 鉄也 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱ＵＦＪ国際投信株式会社の令和2年4月1日から令和3年3月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以 上

（注）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

令和３年６月16日

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
取締役会 御中

P w C あらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 和田 渉 印
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱ＵＦＪ ＤＣ海外株式インデックスファンドの令和２年５月13日から令和３年５月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱ＵＦＪ ＤＣ海外株式インデックスファンドの令和３年５月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

三菱ＵＦＪ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。