

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年9月7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】	MAXIS米国株式（S&P500）上場投信（為替ヘッジあり）
【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】	<p>(1)当初設定額 5億円を上限とします。</p> <p>(2)継続申込額 10兆円を上限とします。</p>
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 (東京都中央区日本橋兜町2番1号)

1 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2021年2月8日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について有価証券報告書の提出に伴う関係情報の更新等を行うため、本訂正届出書を提出します。

2 【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部__は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書の更新後の内容を示します。

なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンド状況 5 運用状況」、「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

当ファンドは、S&P500指数（円ヘッジ・円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

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	M M F	インデックス型
		債券		
	海外	不動産投信	M R F	特殊型
		その他資産 ()		
	内外	ETF		()
		資産複合		

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式	年1回	グローバル	ファミリー	あり	日経225	ブル・ベア型
一般 大型株	年2回	日本	ファンド	(フルヘッジ)	TOPIX	条件付運用型
	年4回	北米				
中小型株	年6回 (隔月)	欧州	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	その他 (S&P500 指数(円ヘッ ジ・円換算ベ ース))	ロング・ ショート 型 / 絶対収益 追求型
債券	年12回	アジア オセアニア				
一般	年12回					
公債 社債	(毎月)	中南米				
その他債券	日々	アフリカ				
クレジット 属性	その他 ()	中近東 (中東)				その他 ()
()		エマージング				
不動産投信						

その他資産 (投資信託証券 (株式一般))					
資産複合 ()					

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

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

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円で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

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 るものをおいいます。
		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・ペア型 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標・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

対象指数(S&P500指数(円ヘッジ・円換算ベース))に連動する投資成果をめざします。

ファンドの特色

投資方針

S&P500指数(円ヘッジ・円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。

- ファンドの1口当たりの純資産額の変動率を、S&P500指数(円ヘッジ・円換算ベース)の変動率に一致させることを目的として、主として対象指数に採用されている銘柄の株式に投資を行います。
- 対象指数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。

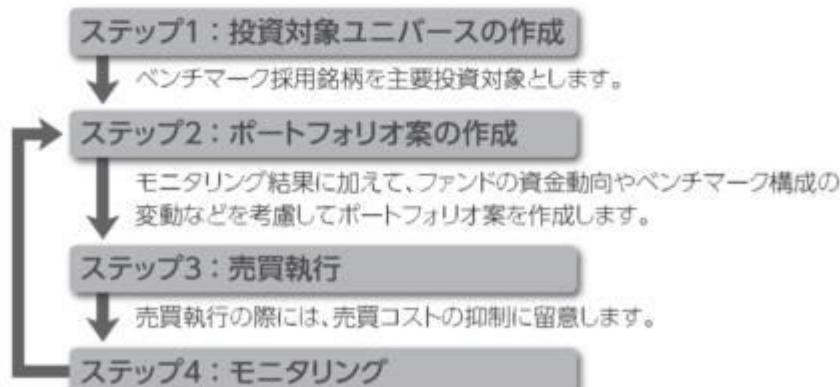
※実際の運用はS&P500インデックスマザーファンドを通じて行います。

<S&P500指数について>

S&P500指数とは、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表している株価指数で、米国の代表的な株価指数の1つです。市場規模、流動性、業種等を勘案して選ばれたニューヨーク証券取引所等に上場および登録されている500銘柄を時価総額で加重平均し指数化したものです。S&P500指数(円ヘッジ・円換算ベース)は、S&P500指数(米ドルベース)を円ヘッジし、委託会社が計算[※]したものです。

※原則として、わが国における計算日の午前10時の対顧客電信売買相場の仲値により円換算

<運用プロセスのイメージ>



一連の投資行動を分析し、その結果をポートフォリオに反映することで、運用の継続的な改善に努めます。

- 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。
- 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(<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)をご覧いただけます。

為替対応方針

原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をはかります。

- 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をはかります。

為替ヘッジの活用

為替予約取引を活用し為替ヘッジを行うことにより、為替ヘッジをしなかった場合と比較して安定した値動きが期待されます。ただし、為替ヘッジにより、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。

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

<投資リターンのイメージ>



■ 上記はファンドの投資リターンのイメージであり、ファンドの将来の運用状況・成果等を示唆・保証するものではありません。

■ ファンドの仕組み

運用は主にS&P500インデックスマザーファンドへの投資を通じて、米国の株式に投資を行うファミリーファンド方式により行います。



■上場投信の仕組み

ファンドの受益権は、下記の金融商品取引所で上場され、株式と同様に、市場価格で売買することができます。

金融商品取引所における売買単位は1口単位です。

取引方法は、原則として株式と同様です。売買手数料等につきましては、お取引される第一種金融商品取引業者にお問い合わせください。

＜金融商品取引所＞

・東京証券取引所(2021年2月25日に新規上場)

■主な投資制限

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

分配方針

年2回の決算時に分配を行います。

- 年2回の決算時(6・12月の各8日)に分配を行います。
- 分配金額は、経費等控除後の配当等収益の全額を原則とします。
- 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。また、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。

●「MAXIS(マクシス)」の由来

「MAXIS(マクシス)」は三菱UFJ国際投信が運用するETF(上場投資信託)シリーズの統一ブランドです。このブランドには、「最高(MAX)の品質」と「お客様の投資の中心軸(AXIS)」をめざすという三菱UFJ国際投信の思いが込められています。

「S&P500®指数」の著作権等について

S&P500®指数は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(「SPDJI」)の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサプライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切の責任を負いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2)【ファンドの沿革】

<訂正前>

2021年2月24日
2021年2月25日

設定日、信託契約締結、運用開始(予定)
ファンドの受益権を東京証券取引所に上場(予定)

<訂正後>

2021年2月24日 設定日、信託契約締結、運用開始
 2021年2月25日 ファンドの受益権を東京証券取引所に上場

(3) 【ファンドの仕組み】

<訂正前>

委託会社およびファンドの関係法人の役割

投資家（受益者）

お申込金 解約代金等

販売会社

募集の取扱い、解約の取扱い等を行います。

お申込金 解約代金等

受託会社（受託者）

三菱UFJ信託銀行株式会社
(再信託受託会社：日本マスタートラスト
信託銀行株式会社)

信託財産の保管・管理等を行います。

委託会社（委託者）
三菱UFJ国際投信株式会社信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行
います。

投資 損益

マザーファンド

投資 損益

有価証券等

委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「上場投資信託の取扱い等に関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い等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（2020年11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%

<訂正後>

委託会社およびファンドの関係法人の役割

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

委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「上場投資信託の取扱い等に関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い等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6月末現在)

・金融商品取引業者登録番号	
金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第404号
・設立年月日	1985年8月1日
・資本金	2,000百万円
・沿革	1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始 2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更

2005年10月

三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
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%

3【投資リスク】

<更新後>

(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、ファンドはその影響を受け組入株式の価格の下落は基準価額の下落要因となります。

為替変動リスク

組入外貨建資産については、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図りますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨の金利より低いときには、これらの金利差相当分のヘッジコストがかかるご留意ください。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。

信用リスク

組入有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等には、当該組入有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払い・償還金の支払いが滞ることがあります。

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場合または取引が不可能となる場合、市場実勢から期待される価格より不利な価格での取引となる可能性があります。

留意事項

- ・ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリングオフ)の適用はありません。
- ・ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合には、ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・ファンドは、換金時期に制限がありますのでご留意ください。
- ・ファンドは、S&P500指数(円ヘッジ・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が、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に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因によりカイ離を生じことがあります。

- ・ファンドは金融商品取引所に上場され取引が行われますが、金融商品取引所における市場価格はファンドの需給などによって決まり、時間とともに変化します。このため、ファンドの市場価格は基準価額に必ずしも一致せず、またその差異の程度については予測できません。
- ・コンピューター関係の不慮の出来事に起因する取引上のリスクやシステム上のリスクが生じる可能性があります。

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

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

トレーディング担当部署

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

コンプライアンス担当部署

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

リスク管理担当部署

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

内部監査担当部署

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

<流動性リスクに対する管理体制>

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

* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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

● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

ファンドの年間騰落率はありません。
ベンチマークの年間騰落率は、2016年7月～2021年6月です。
基準価額(分配金再投資)は、2021年2月末～2021年6月末です。



(4)【その他の手数料等】

<訂正前>

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

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

- ・受益権の上場に係る費用（新規上場料（新規上場時の純資産総額に対して0.00825%（税抜0.0075%））、追加上場料（追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額）に対して0.00825%（税抜0.0075%））、年間上場料（毎年末の純資産総額に対して最大0.00825%（税抜0.0075%））、その他新規上場に係る費用（55万円（税抜50万円）））は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。
- ・対象指数についての商標（これに類する商標を含みます。）の使用料（信託財産の純資産総額に年0.05%（上限）を乗じて得た額）は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。

（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。

<訂正後>

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

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

- ・受益権の上場に係る費用（追加上場料（追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額）に対して0.00825%（税抜0.0075%））、年間上場料（毎年末の純資産総額に対して最大0.00825%（税抜0.0075%）））は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。
- ・対象指数についての商標（これに類する商標を含みます。）の使用料（信託財産の純資産総額に年0.05%（上限）を乗じて得た額）は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。

（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。

（5）【課税上の取扱い】

<訂正前>

課税上は、上場証券投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

1. 受益権の売却時

売却価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得として課税されます。

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。

2. 収益分配金の受取り時

収益分配金は配当所得として課税されます。

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。

3. 受益権の解約時および償還時

上記1.と同様の取扱いとなります。

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

上場証券投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託やETFなどから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設する（ETFの配当金の受取方法については、非課税口座を開設する金融機関等経由で受領する「株式数比例配分方式」を選択する必要があります。）など、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

1. 受益権の売却時

通常の株式の売却時と同様に、譲渡益について、他の法人所得と合算して課税されます。

2. 収益分配金の受取り時

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。

3. 受益権の解約時および償還時

源泉徴収はありません。上記1.と同様の取扱いとなります。

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。

上記は2020年11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。

<訂正後>

課税上は、上場証券投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

1. 受益権の売却時

売却価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得として課税されます。

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。

2. 収益分配金の受取り時

収益分配金は配当所得として課税されます。

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。

3. 受益権の解約時および償還時

上記1.と同様の取扱いとなります。

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

上場証券投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託やETFなどから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設する（ETFの配当金の受取方法については、非課税口座を開設する金融機関等経由で受領する「株式数比例配分方式」を選択する必要があります。）など、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

1. 受益権の売却時

通常の株式の売却時と同様に、譲渡益について、他の法人所得と合算して課税されます。

2. 収益分配金の受取り時

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。

3. 受益権の解約時および償還時

源泉徴収はありません。上記1.と同様の取扱いとなります。

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。

上記は2021年6月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

【MAXIS米国株式（S&P500）上場投信（為替ヘッジあり）】

（1）【投資状況】

令和3年6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	3,842,160,470	100.43
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		16,415,167	0.43
純資産総額		3,825,745,303	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 6月30日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	S & P 500 インデックスマザーファンド	1,306,635,086	2.8850	3,769,642,224	2.9405	3,842,160,470	100.43

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 3年 6月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.43
合計	100.43

(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6月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位: 円)

	純資産総額		基準価額 (1口当たりの純資産価額)		東京証券取引所 取引価格
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)	
第1計算期間末日 (令和 3年 6月 8日)	2,075,094,518	2,079,664,118	10,899	10,923	10,920
令和 3年 2月末日	197,396,159		9,870		9,840
3月末日	787,200,751		10,223		10,220
4月末日	1,147,878,735		10,870		10,840
5月末日	2,067,983,574		10,861		10,890

6月末日	3,825,745,303		11,073		11,100
------	---------------	--	--------	--	--------

【分配の推移】

	1口当たりの分配金
第1計算期間	24円00銭

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	9.23

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

(4)【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	190,400		190,400

(参考)

S&P500インデックスマザーファンド

投資状況

令和3年6月30日現在

(単位:円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率(%)
株式	アメリカ	522,956,106,706	96.15
投資証券	アメリカ	13,446,493,810	2.47
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		7,520,421,826	1.38
純資産総額		543,923,022,342	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

令和3年6月30日現在

(単位:円)

資産の種類	建別	国/地域	時価合計	投資比率(%)

株価指数先物取引	買建	アメリカ	8,475,713,724	1.56
----------	----	------	---------------	------

(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 6月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2,097,942	13,967.19	29,302,370,704	15,075.37	31,627,254,826	5.81
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1,007,305	26,477.56	26,670,983,929	30,011.41	30,230,645,365	5.56
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	57,338	353,355.69	20,260,709,016	381,295.32	21,862,711,127	4.02
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	320,562	30,944.93	9,919,769,721	38,911.99	12,473,707,326	2.29
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	40,239	237,094.96	9,540,464,277	270,417.86	10,881,344,309	2.00
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	38,099	238,899.56	9,101,834,615	278,702.51	10,618,287,104	1.95
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	103,139	79,074.04	8,155,617,747	75,278.44	7,764,143,106	1.43
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	253,653	28,367.55	7,195,516,055	30,543.30	7,747,400,131	1.42
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	83,383	65,598.35	5,469,788,048	88,582.32	7,386,259,639	1.36
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	405,163	17,070.72	6,916,427,167	17,044.80	6,905,922,789	1.27
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	352,491	18,042.93	6,359,971,021	18,138.43	6,393,635,938	1.18
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	226,473	24,448.19	5,536,856,766	26,091.35	5,908,986,535	1.09
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	126,336	38,749.91	4,895,509,481	44,021.89	5,561,550,506	1.02
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	157,287	29,292.53	4,607,334,479	32,373.40	5,091,915,092	0.94
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	142,366	30,577.67	4,353,221,107	35,190.97	5,009,998,945	0.92
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	327,812	14,315.77	4,692,883,500	14,861.95	4,871,926,209	0.90
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	117,131	40,610.91	4,756,797,009	40,693.44	4,766,463,321	0.88
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	243,289	21,283.79	5,178,112,703	19,233.17	4,679,220,983	0.86
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,009,793	4,160.08	4,200,827,228	4,521.61	4,565,896,387	0.84

アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	64,020	53,611.68	3,432,219,947	65,325.13	4,182,115,143	0.77
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	567,020	6,356.53	3,604,280,165	6,924.51	3,926,341,104	0.72
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	614,132	5,994.77	3,681,583,170	6,252.19	3,839,671,914	0.71
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	59,404	59,898.01	3,558,181,851	58,994.43	3,504,505,120	0.64
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	554,659	6,317.62	3,504,126,198	6,174.78	3,424,901,294	0.63
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	541,021	6,860.00	3,711,404,488	6,275.41	3,395,131,299	0.62
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	124,070	26,080.17	3,235,767,200	27,181.66	3,372,429,772	0.62
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	564,640	5,265.07	2,972,871,151	5,850.78	3,303,588,823	0.61
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	750,044	3,884.08	2,913,232,840	4,323.67	3,242,948,742	0.60
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	519,994	5,706.59	2,967,396,551	5,955.83	3,097,000,441	0.57
アメリカ	株式	ABBOTT LABORATORIES	ヘルスケア機器・サービス	238,123	13,339.21	3,176,374,180	12,961.08	3,086,331,681	0.57

(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 6月30日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	エネルギー	2.79
	素材	2.56
	資本財	5.67
	商業・専門サービス	0.80
	運輸	1.90
	自動車・自動車部品	1.94
	耐久消費財・アパレル	1.15
	消費者サービス	1.98
	メディア・娯楽	9.58
	小売	7.03
	食品・生活必需品小売	1.27
	食品・飲料・タバコ	2.94
	家庭用品・パーソナル用品	1.52
	ヘルスケア機器・サービス	6.25
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.58
銀行	4.23	

各種金融	5.05
保険	1.84
不動産	0.08
ソフトウェア・サービス	13.92
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.55
電気通信サービス	1.45
公益事業	2.42
半導体・半導体製造装置	5.67
小計	96.15
投資証券	2.47
合計	98.62

（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の

令和 3年 6月30日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2109	賃建	358	アメリカドル	76,257,821.34	8,432,589,884	76,647,800	8,475,713,724	1.56

（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。

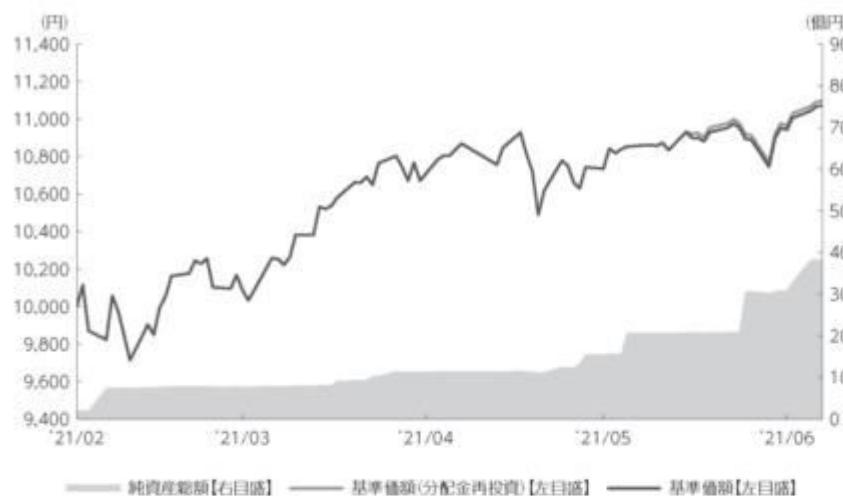
参考情報



運用実績

2021年6月30日現在

■基準価額・純資産の推移 2021年2月24日(設定日)～2021年6月30日



- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,000(当初元本1口当たり)を起点として表示
- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	11,073円
純資産総額	38.2億円

*純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2021年 6月	24円
設定来累計	24円

*分配金は1口当たり、税引前

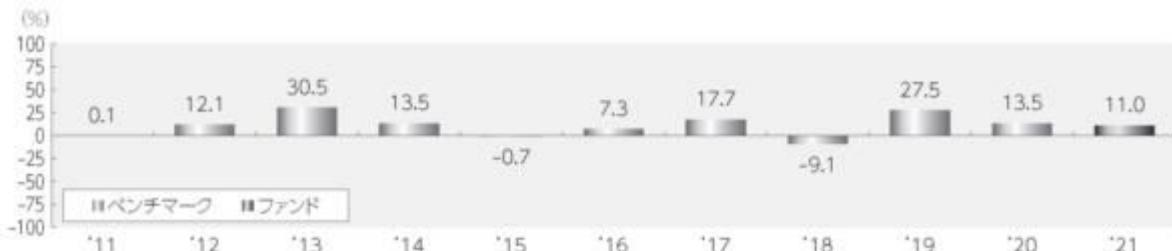
■主要な資産の状況

組入上位終柄	業種	国・地域	比率
1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	5.8%
2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	5.6%
3 AMAZON.COM INC	小売	アメリカ	4.0%
4 FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	アメリカ	2.3%
5 ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	アメリカ	2.0%
6 ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	アメリカ	2.0%
7 TESLA INC	自動車・自動車部品	アメリカ	1.4%
8 BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	アメリカ	1.4%
9 NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	アメリカ	1.4%
10 JPMORGAN CHASE & CO	銀行	アメリカ	1.3%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (清算)	1.6%

- ・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)

■年間收益率の推移



- ・收益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2021年は設定日から6月30日までの收益率を表示
- ・2020年以前は対象指数(ベンチマーク)の年間收益率を表示

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

第2【管理及び運営】

2【換金（解約）手続等】

<訂正前>

解約の受付

受益者は、2021年4月26日以降において、自己に帰属する受益権につき解約の請求ができます。原則、解約請求受付日の午後3時までに受け付けた解約請求（当該解約請求の受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を当該解約請求受付日の請求とします。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

ただし、以下に定める日には解約請求ができません。

1. ニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行のいずれかの休業日
 2. 計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の6営業日前から起算して6営業日以内）
 3. この信託が終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
 4. 1.から3.のほか、委託会社が、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めたとき
- なお、委託会社は、2.から4.に定める日の解約請求であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される期日および期間における解約請求については受け付けることができます。
- 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

100口の整数倍で販売会社が定める単位

解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

信託財産留保額

ありません。

解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

解約手数料

販売会社が定める額

解約手数料は販売会社にご確認ください。

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5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、決済機能の停止、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れがあると判断した場合その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことができます。

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。

買取り

販売会社は、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になった場合で、信託終了日の2営業日前までに受益者の請求があるときは、その受益権を買取ります。

受益権の買取価額は、買取請求の受付日の翌営業日の基準価額とします。

販売会社は、受益権の買取りを行うときは、販売会社が定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を徴することができます。

販売会社は、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、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて受益権の買取りを停止することおよびすでに受け付けた受益権の買取りを取り消すことができます。

受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取り停止以前に行った当日の買取り請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取り請求を撤回しない場合には、買取り停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取り請求を受け付けたものとします。

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。

<訂正後>

解約の受付

受益者は、自己に帰属する受益権につき解約の請求ができます。原則、解約請求受付日の午後3時までに受け付けた解約請求（当該解約請求の受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を当該解約請求受付日の請求とします。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

ただし、以下に定める日には解約請求ができません。

1. ニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行のいずれかの休業日
2. 計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の6営業日前から起算して6営業日以内）
3. この信託が終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
4. 1.から3.のほか、委託会社が、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めたとき

なお、委託会社は、2.から4.に定める日の解約請求であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される期日および期間における解約請求については受け付けることができます。

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

100口の整数倍で販売会社が定める単位

解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

信託財産留保額

ありません。

解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

解約手数料

販売会社が定める額

解約手数料は販売会社にご確認ください。

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5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、決済機能の停止、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れがあると判断した場合その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことができます。

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。

買取り

販売会社は、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になった場合で、信託終了日の2営業日前までに受益者の請求があるときは、その受益権を買取ります。

受益権の買取価額は、買取請求の受付日の翌営業日の基準価額とします。

販売会社は、受益権の買取りを行うときは、販売会社が定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を徴することができます。

販売会社は、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、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて受益権の買取りを停止することおよびすでに受け付けた受益権の買取りを取り消すことができます。

受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取り停止以前に行った当日の買取り請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取り請求を撤回しない場合には、買取り停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取り請求を受け付けたものとします。

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。

第3【ファンドの経理状況】

- 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。
- 当ファンドの第1計算期間は、約款の規定に従い、令和3年2月24日から令和3年6月8日までとしております。
- 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3年2月24日から令和3年6月8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】

【MAXIS米国株式(S&P500)上場投信(為替ヘッジあり)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

第1期 [令和3年6月8日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	459,310
親投資信託受益証券	2,073,949,845
派生商品評価勘定	5,935,286
未収入金	32,155
流動資産合計	2,080,376,596
資産合計	2,080,376,596
負債の部	
流動負債	
未払収益分配金	4,569,600
未払受託者報酬	67,377
未払委託者報酬	195,352
その他未払費用	449,749
流動負債合計	5,282,078
負債合計	5,282,078
純資産の部	
元本等	
元本	1,904,000,000
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	171,094,518
(分配準備積立金)	15,593
元本等合計	2,075,094,518
純資産合計	2,075,094,518
負債純資産合計	2,080,376,596

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

第1期	
自	令和3年2月24日
至	令和3年6月8日
営業収益	
有価証券売買等損益	129,829,845
為替差損益	28,393,600
営業収益合計	101,436,245
営業費用	
支払利息	49
受託者報酬	67,377
委託者報酬	195,352
その他費用	457,449
営業費用合計	720,227
営業利益又は営業損失()	100,716,018
経常利益又は経常損失()	100,716,018
当期純利益又は当期純損失()	100,716,018
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()	-
期首剩余金又は期首次損金()	-
剩余金増加額又は欠損金減少額	74,948,100
当期追加信託に伴う剩余金増加額又は欠損金減少額	74,948,100
分配金	4,569,600
期末剩余金又は期末欠損金()	171,094,518

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

第1期 [令和3年6月8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1期 [令和3年6月8日現在]
1. 期首元本額	円
期中追加設定元本額	1,904,000,000円
期中一部解約元本額	円

	第1期 [令和3年6月8日現在]
2. 受益権の総数	190,400口

(損益及び剩余金計算書に関する注記)

第1期 自 令和3年2月24日 至 令和3年6月8日																																	
1. その他費用 上場費用および商標使用料等を含んでおります。																																	
2. 分配金の計算過程																																	
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>49円</td> </tr> <tr> <td>親ファンドの配当等収益額</td> <td>B</td> <td>5,305,420円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>C</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>D=A+B+C</td> <td>5,305,371円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>E</td> <td>720,178円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>F=D-E</td> <td>4,585,193円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金額</td> <td>G</td> <td>4,569,600円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>H=F-G</td> <td>15,593円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>I</td> <td>190,400口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>J=G/I</td> <td>24円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	49円	親ファンドの配当等収益額	B	5,305,420円	分配準備積立金額	C	円	配当等収益合計額	D=A+B+C	5,305,371円	経費	E	720,178円	当ファンドの分配対象収益額	F=D-E	4,585,193円	収益分配金額	G	4,569,600円	次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	15,593円	当ファンドの期末残存口数	I	190,400口	1口当たり分配金額	J=G/I	24円
項目																																	
当期配当等収益額	A	49円																															
親ファンドの配当等収益額	B	5,305,420円																															
分配準備積立金額	C	円																															
配当等収益合計額	D=A+B+C	5,305,371円																															
経費	E	720,178円																															
当ファンドの分配対象収益額	F=D-E	4,585,193円																															
収益分配金額	G	4,569,600円																															
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	15,593円																															
当ファンドの期末残存口数	I	190,400口																															
1口当たり分配金額	J=G/I	24円																															

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第1期 自 令和3年2月24日 至 令和3年6月8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」に基づいております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に 係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用してあります。 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。 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	第1期 自 令和 3年 2月24日 至 令和 3年 6月 8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	第1期 [令和 3年 6月 8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	第1期 [令和 3年 6月 8日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	126,856,827
合計	126,856,827

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

第1期 [令和 3年 6月 8日現在]

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカドル	2,063,550,521	2,057,615,235	5,935,286
	合計	2,063,550,521	2,057,615,235	5,935,286

(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)

	第1期 [令和3年6月8日現在]
1口当たり純資産額	10,899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	S&P500インデックスマザーファンド	724,068,654	2,073,949,845	
	合計	724,068,654	2,073,949,845	

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。

（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。

S & P 500 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6月8日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	6,489,850,420
コール・ローン	1,147,199,889
株式	480,376,094,737
投資証券	12,599,693,230
派生商品評価勘定	77,712,236
未収配当金	545,027,311
差入委託証拠金	3,790,882,843
流動資産合計	505,026,460,666
資産合計	505,026,460,666
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,044,066
未払解約金	56,541,492
未払利息	833
流動負債合計	58,586,391
負債合計	58,586,391
純資産の部	
元本等	
元本	176,294,836,003
剰余金	
剰余金又は欠損金（）	328,673,038,272
元本等合計	504,967,874,275
純資産合計	504,967,874,275
負債純資産合計	505,026,460,666

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

[令和3年6月8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6月8日現在]
1. 期首	令和3年2月24日
期首元本額	125,384,694,965円
期中追加設定元本額	55,316,474,019円
期中一部解約元本額	4,406,332,981円
元本の内訳	
MAXIS米国株式(S&P500)上場投信	4,708,455,232円
MAXIS米国株式(S&P500)上場投信(為替ヘッジあり)	724,068,654円
eMAXIS Slim 米国株式(S&P500)	159,778,662,003円
つみたて米国株式(S&P500)	146,076,378円
eMAXIS S&P500インデックス	230,622,632円
S&P500インデックスファンド(為替ヘッジあり)(ラップ向け)	503,108,950円
MUFG ウエルス・インサイト・ファンド(保守型)	17,426,102円
MUFG ウエルス・インサイト・ファンド(標準型)	58,562,115円
MUFG ウエルス・インサイト・ファンド(積極型)	92,059,286円
MUAM S&P500インデックスファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	8,539,264,760円
MUKAM S&P500インデックスファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家限定)	997,008,268円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	96,235,456円
MUKAM バランスファンド2020-04(適格機関投資家限定)	106,351,581円
MUKAM バランスファンド2020-07(適格機関投資家限定)	100,365,455円

	[令和3年6月8日現在]
MUKAM バランスファンド2020-10(適格機関投資家限定)	99,853,415円
MUKAM バランスファンド2021-03(適格機関投資家限定)	96,715,716円
合計	176,294,836,003円
2. 受益権の総数	176,294,836,003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3年2月24日 至 令和3年6月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に 係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和3年6月8日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券

区分	[令和3年6月8日現在]
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[令和3年6月8日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	27,857,484,577
投資証券	1,616,616,462
合計	29,474,101,039

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[令和3年6月8日現在]

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引	株価指数先物取引 買建	13,473,847,723	13,550,692,567	76,844,844
合計		13,473,847,723	13,550,692,567	76,844,844

(注)時価の算定方法

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

通貨関連

[令和3年6月8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	2,746,018,905		2,744,842,231	1,176,674
合計		2,746,018,905		2,744,842,231	1,176,674

(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6月8日現在]
1口当たり純資産額	2.8643円
(1万口当たり純資産額)	(28,643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	APA CORP	44,332	23.42	1,038,255.44	
	BAKER HUGHES CO	91,798	25.94	2,381,240.12	
	CABOT OIL & GAS CORP	54,883	16.86	925,327.38	
	CHEVRON CORP	243,180	107.75	26,202,645.00	

CONOCOPHILLIPS	170,777	59.81	10,214,172.37
DEVON ENERGY CORP	74,874	30.92	2,315,104.08
DIAMONDBACK ENERGY INC	22,992	87.19	2,004,672.48
EOG RESOURCES INC	73,552	87.03	6,401,230.56
EXXON MOBIL CORP	533,055	61.05	32,543,007.75
HALLIBURTON CO	112,099	24.30	2,724,005.70
HESS CORP	34,033	89.05	3,030,638.65
KINDER MORGAN INC	245,008	18.77	4,598,800.16
MARATHON OIL CORP	93,073	13.68	1,273,238.64
MARATHON PETROLEUM CORP	82,083	63.34	5,199,137.22
NOV INC	54,303	17.39	944,329.17
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	104,341	29.16	3,042,583.56
ONEOK INC	54,962	55.17	3,032,253.54
PHILLIPS 66	54,967	92.41	5,079,500.47
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	26,095	170.71	4,454,677.45
SCHLUMBERGER LTD	175,097	35.83	6,273,725.51
VALERO ENERGY CORP	51,825	82.69	4,285,409.25
WILLIAMS COS INC	154,093	28.23	4,350,045.39
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	27,810	301.81	8,393,336.10
ALBEMARLE CORP	14,659	170.78	2,503,464.02
AMCOR PLC	196,075	12.10	2,372,507.50
AVERY DENNISON CORP	10,500	216.42	2,272,410.00
BALL CORP	42,123	81.36	3,427,127.28
CELANESE CORP	14,361	165.30	2,373,873.30
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	27,908	55.55	1,550,289.40
CORTEVA INC	93,745	45.93	4,305,707.85
DOW INC	93,659	69.24	6,484,949.16
DUPONT DE NEMOURS INC	67,710	84.97	5,753,318.70
EASTMAN CHEMICAL CO	17,024	127.84	2,176,348.16
ECOLAB INC	31,233	212.96	6,651,379.68
FMC CORP	16,630	118.49	1,970,488.70
FREEPORT-MCMORAN INC	183,260	41.26	7,561,307.60
INTERNATIONAL PAPER CO	48,421	63.73	3,085,870.33
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	31,315	143.18	4,483,681.70
LINDE PLC	65,790	291.58	19,183,048.20
LYONDELLBASELL INDU-CL A	32,975	112.66	3,714,963.50
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7,713	353.77	2,728,628.01
MOSAIC CO/THE	43,953	35.92	1,578,791.76
NEWMONT CORP	100,750	71.51	7,204,632.50
NUCOR CORP	37,986	107.37	4,078,556.82
PACKAGING CORP OF AMERICA	12,091	144.32	1,744,973.12
PPG INDUSTRIES INC	29,776	179.98	5,359,084.48
SEALED AIR CORP	20,691	57.51	1,189,939.41

SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	30,452	280.81	8,551,226.12
VULCAN MATERIALS CO	16,317	177.96	2,903,773.32
WESTROCK CO	33,321	57.90	1,929,285.90
3M CO	72,876	203.73	14,847,027.48
ALLEGION PLC	11,849	138.00	1,635,162.00
AMETEK INC	29,380	136.68	4,015,658.40
BOEING CO/THE	69,084	252.66	17,454,763.44
CARRIER GLOBAL CORP	102,712	46.06	4,730,914.72
CATERPILLAR INC	68,628	239.76	16,454,249.28
CUMMINS INC	18,521	259.22	4,801,013.62
DEERE & CO	39,454	355.43	14,023,135.22
DOVER CORP	17,932	151.63	2,719,029.16
EATON CORP PLC	49,974	146.85	7,338,681.90
EMERSON ELECTRIC CO	75,390	97.87	7,378,419.30
FASTENAL CO	73,204	52.78	3,863,707.12
FORTIVE CORP	41,834	72.74	3,043,005.16
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	17,655	102.15	1,803,458.25
GENERAC HOLDINGS INC	7,890	329.96	2,603,384.40
GENERAL DYNAMICS CORP	29,149	191.77	5,589,903.73
GENERAL ELECTRIC CO	1,103,693	13.91	15,352,369.63
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	87,567	228.19	19,981,913.73
HOWMET AEROSPACE INC	50,470	35.30	1,781,591.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,787	221.28	1,059,267.36
IDEX CORP	9,516	222.75	2,119,689.00
ILLINOIS TOOL WORKS	36,202	233.49	8,452,804.98
INGERSOLL-RAND INC	46,883	48.21	2,260,229.43
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	90,377	66.20	5,982,957.40
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	25,838	218.55	5,646,894.90
LOCKHEED MARTIN CORP	31,021	391.51	12,145,031.71
MASCO CORP	32,488	59.24	1,924,589.12
NORTHROP GRUMMAN CORP	19,498	371.84	7,250,136.32
OTIS WORLDWIDE CORP	51,780	79.61	4,122,205.80
PACCAR INC	43,981	93.37	4,106,505.97
PARKER HANNIFIN CORP	16,222	307.38	4,986,318.36
PENTAIR PLC	21,660	69.15	1,497,789.00
QUANTA SERVICES INC	17,762	92.24	1,638,366.88
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	191,308	88.97	17,020,672.76
ROCKWELL AUTOMATION INC	14,815	274.73	4,070,124.95
ROPER TECHNOLOGIES INC	13,180	446.78	5,888,560.40
SMITH (A.O.) CORP	18,067	68.20	1,232,169.40
SNAP-ON INC	6,926	251.09	1,739,049.34
STANLEY BLACK & DECKER INC	20,232	209.15	4,231,522.80

TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,835	416.97	2,433,019.95
TEXTRON INC	28,665	69.97	2,005,690.05
TRANE TECHNOLOGIES PLC	29,918	182.07	5,447,170.26
TRANSDIGM GROUP INC	6,908	662.55	4,576,895.40
UNITED RENTALS INC	8,920	316.02	2,818,898.40
WABTEC CORP	22,767	82.39	1,875,773.13
WW GRAINGER INC	5,511	459.81	2,534,012.91
XYLEM INC	22,663	119.00	2,696,897.00
CINTAS CORP	11,237	346.80	3,896,991.60
COPART INC	25,601	124.34	3,183,228.34
EQUIFAX INC	15,644	228.72	3,578,095.68
IHS MARKIT LTD	46,842	105.88	4,959,630.96
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	16,479	141.68	2,334,744.72
LEIDOS HOLDINGS INC	17,054	104.43	1,780,949.22
NIELSEN HOLDINGS PLC	42,238	26.92	1,137,046.96
REPUBLIC SERVICES INC	26,110	108.56	2,834,501.60
ROBERT HALF INTL INC	14,845	89.83	1,333,526.35
ROLLINS INC	30,102	32.80	987,345.60
VERISK ANALYTICS INC	19,905	167.80	3,340,059.00
WASTE MANAGEMENT INC	48,825	139.57	6,814,505.25
ALASKA AIR GROUP INC	14,734	65.56	965,961.04
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	80,819	24.25	1,959,860.75
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,208	98.55	1,695,848.40
CSX CORP	96,005	98.07	9,415,210.35
DELTA AIR LINES INC	81,608	46.08	3,760,496.64
EXPEDITORS INTL WASH INC	21,301	124.75	2,657,299.75
FEDEX CORP	30,715	303.34	9,317,088.10
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	10,630	163.57	1,738,749.10
KANSAS CITY SOUTHERN	11,137	295.60	3,292,097.20
NORFOLK SOUTHERN CORP	31,711	274.82	8,714,817.02
OLD DOMINION FREIGHT LINE	11,797	254.29	2,999,859.13
SOUTHWEST AIRLINES CO	74,243	58.28	4,326,882.04
UNION PACIFIC CORP	84,353	222.95	18,806,501.35
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	40,276	57.30	2,307,814.80
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	90,594	212.92	19,289,274.48
APTIV PLC	33,983	157.25	5,343,826.75
BORGWARNER INC	30,610	53.11	1,625,697.10
FORD MOTOR CO	491,701	15.88	7,808,211.88
GENERAL MOTORS CO	159,644	63.23	10,094,290.12
TESLA INC	96,670	605.13	58,497,917.10
DR HORTON INC	41,971	92.33	3,875,182.43
GARMIN LTD	18,803	143.27	2,693,905.81

HANESBRANDS INC	39,302	19.46	764,816.92
HASBRO INC	16,530	94.75	1,566,217.50
LEGGETT & PLATT INC	15,295	54.67	836,177.65
LENNAR CORP-A	35,318	95.76	3,382,051.68
MOHAWK INDUSTRIES INC	7,540	201.25	1,517,425.00
NEWELL BRANDS INC	49,624	28.21	1,399,893.04
NIKE INC -CL B	160,151	133.95	21,452,226.45
NVR INC	436	4,808.51	2,096,510.36
PULTEGROUP INC	34,256	56.71	1,942,657.76
PVH CORP	8,348	110.66	923,789.68
RALPH LAUREN CORP	5,590	120.95	676,110.50
TAPESTRY INC	35,884	43.35	1,555,571.40
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	22,191	22.07	489,755.37
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	22,404	19.25	431,277.00
VF CORP	39,293	79.27	3,114,756.11
WHIRLPOOL CORP	7,961	235.79	1,877,124.19
BOOKING HOLDINGS INC	5,156	2,298.52	11,851,169.12
CAESARS ENTERTAINMENT INC	26,001	110.60	2,875,710.60
CARNIVAL CORP	99,065	30.89	3,060,117.85
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,537	1,323.26	4,680,370.62
DARDEN RESTAURANTS INC	16,461	137.29	2,259,930.69
DOMINO'S PIZZA INC	4,874	437.92	2,134,422.08
EXPEDIA GROUP INC	17,127	170.35	2,917,584.45
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	34,996	124.90	4,371,000.40
LAS VEGAS SANDS CORP	41,238	56.52	2,330,771.76
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	33,441	142.48	4,764,673.68
MCDONALD'S CORP	93,870	231.69	21,748,740.30
MGM RESORTS INTERNATIONAL	51,562	43.41	2,238,306.42
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	47,310	33.11	1,566,434.10
PENN NATIONAL GAMING INC	19,251	84.25	1,621,896.75
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	27,597	94.48	2,607,364.56
STARBUCKS CORP	148,190	111.33	16,497,992.70
WYNN RESORTS LTD	13,509	129.10	1,744,011.90
YUM! BRANDS INC	37,760	118.32	4,467,763.20
ACTIVISION BLIZZARD INC	97,434	97.12	9,462,790.08
ALPHABET INC-CL A	37,874	2,402.30	90,984,710.20
ALPHABET INC-CL C	36,279	2,466.09	89,467,279.11
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	17,786	680.56	12,104,440.16
COMCAST CORP-CLASS A	575,234	56.92	32,742,319.28
DISCOVERY INC - A	18,894	31.24	590,248.56
DISCOVERY INC-C	40,145	29.34	1,177,854.30
DISH NETWORK CORP-A	32,522	45.03	1,464,465.66

ELECTRONIC ARTS INC	36,124	145.72	5,263,989.28	
FACEBOOK INC-CLASS A	302,837	336.58	101,928,877.46	
FOX CORP - CLASS A	43,177	37.15	1,604,025.55	
FOX CORP - CLASS B	18,657	35.60	664,189.20	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	50,362	33.44	1,684,105.28	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	18,462	89.70	1,656,041.40	
NETFLIX INC	55,746	494.66	27,575,316.36	
NEWS CORP - CLASS A	44,891	25.85	1,160,432.35	
NEWS CORP - CLASS B	16,264	24.36	396,191.04	
OMNICOM GROUP	27,180	82.78	2,249,960.40	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	14,472	184.26	2,666,610.72	
TWITTER INC	100,450	59.63	5,989,833.50	
VIACOMCBS INC - CLASS B	72,662	41.74	3,032,911.88	
WALT DISNEY CO/THE	228,459	176.99	40,434,958.41	
ADVANCE AUTO PARTS INC	8,418	193.01	1,624,758.18	
AMAZON.COM INC	53,885	3,198.01	172,324,768.85	
AUTOZONE INC	2,794	1,384.65	3,868,712.10	
BEST BUY CO INC	29,695	117.10	3,477,284.50	
CARMAX INC	20,402	114.56	2,337,253.12	
DOLLAR GENERAL CORP	30,827	206.00	6,350,362.00	
DOLLAR TREE INC	28,902	100.35	2,900,315.70	
EBAY INC	81,371	65.45	5,325,731.95	
ETSY INC	15,722	168.32	2,646,327.04	
GAP INC/THE	23,613	31.35	740,267.55	
GENUINE PARTS CO	18,174	127.87	2,323,909.38	
HOME DEPOT INC	135,602	309.96	42,031,195.92	
L BRANDS INC	29,456	66.14	1,948,219.84	
LKQ CORP	35,547	49.53	1,760,642.91	
LOWE'S COS INC	92,101	190.25	17,522,215.25	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,846	525.44	4,648,042.24	
POOL CORP	5,058	435.55	2,203,011.90	
ROSS STORES INC	44,832	119.22	5,344,871.04	
TARGET CORP	63,067	230.89	14,561,539.63	
TJX COMPANIES INC	151,176	65.32	9,874,816.32	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	14,484	181.20	2,624,500.80	
ULTA BEAUTY INC	7,097	332.80	2,361,881.60	
COSTCO WHOLESALE CORP	55,706	380.40	21,190,562.40	
KROGER CO	97,874	38.97	3,814,149.78	
SYSCO CORP	64,253	79.83	5,129,316.99	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	90,032	54.56	4,912,145.92	
WALMART INC	174,435	140.90	24,577,891.50	
ALTRIA GROUP INC	233,861	50.49	11,807,641.89	

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	70,151	68.66	4,816,567.66
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	23,197	79.96	1,854,832.12
CAMPBELL SOUP CO	26,981	49.46	1,334,480.26
COCA-COLA CO/THE	488,237	56.04	27,360,801.48
CONAGRA BRANDS INC	60,458	38.79	2,345,165.82
CONSTELLATION BRANDS INC-A	21,396	239.08	5,115,355.68
GENERAL MILLS INC	76,599	63.72	4,880,888.28
HERSHEY CO/THE	18,036	173.99	3,138,083.64
HORMEL FOODS CORP	35,933	49.18	1,767,184.94
JM SMUCKER CO/THE	13,924	138.13	1,923,322.12
KELLOGG CO	31,952	66.41	2,121,932.32
KRAFT HEINZ CO/THE	83,325	43.88	3,656,301.00
LAMB WESTON HOLDINGS INC	18,972	83.80	1,589,853.60
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	30,926	89.49	2,767,567.74
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	24,680	60.66	1,497,088.80
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	177,630	63.67	11,309,702.10
MONSTER BEVERAGE CORP	46,645	94.30	4,398,623.50
PEPSICO INC	173,674	147.75	25,660,333.50
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	196,097	98.56	19,327,320.32
TYSON FOODS INC-CL A	36,455	78.33	2,855,520.15
CHURCH & DWIGHT CO INC	30,741	86.02	2,644,340.82
CLOROX COMPANY	15,593	178.64	2,785,533.52
COLGATE-PALMOLIVE CO	106,930	83.90	8,971,427.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	28,950	302.96	8,770,692.00
KIMBERLY-CLARK CORP	42,506	131.08	5,571,686.48
PROCTER & GAMBLE CO/THE	310,032	136.42	42,294,565.44
ABBOTT LABORATORIES	222,937	110.00	24,523,070.00
ABIOMED INC	5,822	291.15	1,695,075.30
ALIGN TECHNOLOGY INC	9,062	580.27	5,258,406.74
AMERISOURCEBERGEN CORP	18,711	118.26	2,212,762.86
ANTHEM INC	30,814	389.10	11,989,727.40
BAXTER INTERNATIONAL INC	63,371	81.26	5,149,527.46
BECTON DICKINSON AND CO	36,521	239.56	8,748,970.76
BOSTON SCIENTIFIC CORP	178,226	42.14	7,510,443.64
CARDINAL HEALTH INC	37,435	58.90	2,204,921.50
CENTENE CORP	73,026	71.28	5,205,293.28
CERNER CORP	37,849	79.53	3,010,130.97
CIGNA CORP	44,259	247.60	10,958,528.40
COOPER COS INC/THE	6,154	374.40	2,304,057.60
CVS HEALTH CORP	164,998	86.33	14,244,277.34
DANAHER CORP	79,774	240.24	19,164,905.76
DAVITA INC	9,564	118.68	1,135,055.52

DENTSPLY SIRONA INC	27,822	65.52	1,822,897.44
DEXCOM INC	12,125	386.98	4,692,132.50
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	78,555	96.34	7,567,988.70
HCA HEALTHCARE INC	33,379	211.87	7,072,008.73
HENRY SCHEIN INC	18,710	77.30	1,446,283.00
HOLOGIC INC	32,727	60.89	1,992,747.03
HUMANA INC	16,205	416.00	6,741,280.00
IDEXX LABORATORIES INC	10,752	560.35	6,024,883.20
INTUITIVE SURGICAL INC	14,817	831.12	12,314,705.04
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	11,988	264.06	3,165,551.28
MCKESSON CORP	20,183	195.03	3,936,290.49
MEDTRONIC PLC	169,704	123.96	21,036,507.84
QUEST DIAGNOSTICS INC	16,712	128.93	2,154,678.16
RESMED INC	18,657	206.70	3,856,401.90
STERIS PLC	10,867	193.83	2,106,350.61
STRYKER CORP	41,188	249.54	10,278,053.52
TELEFLEX INC	5,846	392.77	2,296,133.42
UNITEDHEALTH GROUP INC	118,995	400.25	47,627,748.75
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	10,057	158.98	1,598,861.86
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	9,148	333.32	3,049,211.36
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	26,182	157.90	4,134,137.80
ABBVIE INC	222,290	113.01	25,120,992.90
AGILENT TECHNOLOGIES INC	38,307	137.65	5,272,958.55
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	27,638	176.28	4,872,026.64
AMGEN INC	72,685	237.19	17,240,155.15
BIO-RAD LABORATORIES-A	2,771	579.58	1,606,016.18
BIOGEN INC	19,134	395.85	7,574,193.90
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	281,933	64.77	18,260,800.41
CATALENT INC	21,629	103.92	2,247,685.68
CHARLES RIVER LABORATORIES	6,330	340.24	2,153,719.20
ELI LILLY & CO	100,115	222.52	22,277,589.80
GILEAD SCIENCES INC	158,012	67.42	10,653,169.04
ILLUMINA INC	18,354	430.34	7,898,460.36
INCYTE CORP	24,013	85.11	2,043,746.43
IQVIA HOLDINGS INC	24,059	233.20	5,610,558.80
JOHNSON & JOHNSON	330,866	164.84	54,539,951.44
MERCK & CO. INC.	318,331	72.80	23,174,496.80
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,887	1,248.77	3,605,198.99
ORGANON & CO	31,833	31.42	1,000,192.86
PERKINELMER INC	14,099	137.52	1,938,894.48
PERRIGO CO PLC	18,314	46.74	855,996.36
PFIZER INC	701,930	38.99	27,368,250.70

REGENERON PHARMACEUTICALS	13,231	514.99	6,813,832.69
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	49,558	444.45	22,026,053.10
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	32,648	209.16	6,828,655.68
VIATRIS INC	151,619	15.39	2,333,416.41
WATERS CORP	7,825	318.71	2,493,905.75
ZOETIS INC	59,790	175.10	10,469,229.00
BANK OF AMERICA CORP	956,203	43.12	41,231,473.36
CITIGROUP INC	262,697	79.31	20,834,499.07
CITIZENS FINANCIAL GROUP	52,925	49.90	2,640,957.50
COMERICA INC	18,452	77.69	1,433,535.88
FIFTH THIRD BANCORP	90,870	41.99	3,815,631.30
FIRST REPUBLIC BANK/CA	22,236	194.48	4,324,457.28
HUNTINGTON BANCSHARES INC	128,065	15.58	1,995,252.70
JPMORGAN CHASE & CO	384,068	165.66	63,624,704.88
KEYCORP	120,438	22.74	2,738,760.12
M & T BANK CORP	16,042	159.72	2,562,228.24
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	57,393	18.84	1,081,284.12
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	53,252	193.11	10,283,493.72
REGIONS FINANCIAL CORP	119,436	22.51	2,688,504.36
SVB FINANCIAL GROUP	6,904	602.38	4,158,831.52
TRUIST FINANCIAL CORP	169,192	60.06	10,161,671.52
US BANCORP	171,934	60.54	10,408,884.36
WELLS FARGO & CO	520,331	47.11	24,512,793.41
ZIONS BANCORP NA	19,329	57.81	1,117,409.49
AMERICAN EXPRESS CO	82,185	165.92	13,636,135.20
AMERIPRISE FINANCIAL INC	14,891	264.86	3,944,030.26
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	101,233	51.82	5,245,894.06
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	240,025	289.46	69,477,636.50
BLACKROCK INC	17,858	884.96	15,803,615.68
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	57,848	163.55	9,461,040.40
CBOE GLOBAL MARKETS INC	13,916	112.00	1,558,592.00
CME GROUP INC	45,155	218.10	9,848,305.50
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	38,647	123.59	4,776,382.73
FRANKLIN RESOURCES INC	35,539	35.45	1,259,857.55
GOLDMAN SACHS GROUP INC	43,304	388.16	16,808,880.64
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	70,593	110.40	7,793,467.20
INVESCO LTD	49,492	28.99	1,434,773.08
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,776	448.59	2,142,465.84
MOODY'S CORP	20,227	335.07	6,777,460.89
MORGAN STANLEY	188,897	93.21	17,607,089.37
MSCI INC	10,377	464.37	4,818,767.49
NASDAQ INC	14,376	168.90	2,428,106.40
NORTHERN TRUST CORP	25,698	118.93	3,056,263.14

RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,656	130.67	2,045,769.52
S&P GLOBAL INC	30,288	381.23	11,546,694.24
SCHWAB (CHARLES) CORP	188,286	74.73	14,070,612.78
STATE STREET CORP	44,918	86.41	3,881,364.38
SYNCHRONY FINANCIAL	66,915	50.45	3,375,861.75
T ROWE PRICE GROUP INC	28,606	195.44	5,590,756.64
AFLAC INC	80,483	57.39	4,618,919.37
ALLSTATE CORP	38,048	134.49	5,117,075.52
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	108,857	53.07	5,777,040.99
AON PLC-CLASS A	27,939	247.52	6,915,461.28
ARTHUR J GALLAGHER & CO	25,364	143.54	3,640,748.56
ASSURANT INC	7,761	162.55	1,261,550.55
CHUBB LTD	56,653	169.45	9,599,850.85
CINCINNATI FINANCIAL CORP	18,811	122.76	2,309,238.36
EVEREST RE GROUP LTD	5,286	257.79	1,362,677.94
GLOBE LIFE INC	10,907	106.47	1,161,268.29
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	44,242	65.17	2,883,251.14
LINCOLN NATIONAL CORP	23,280	71.04	1,653,811.20
LOEWS CORP	29,125	57.31	1,669,153.75
MARSH & MCLENNAN COS	63,942	137.97	8,822,077.74
METLIFE INC	94,607	66.21	6,263,929.47
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	32,294	65.52	2,115,902.88
PROGRESSIVE CORP	73,670	96.39	7,101,051.30
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	49,863	108.07	5,388,694.41
TRAVELERS COS INC/THE	31,708	157.76	5,002,254.08
UNUM GROUP	22,357	31.72	709,164.04
WILLIS TOWERS WATSON PLC	15,599	256.99	4,008,787.01
WR BERKLEY CORP	18,381	75.69	1,391,257.89
CBRE GROUP INC - A	43,012	87.74	3,773,872.88
ACCENTURE PLC-CL A	79,852	282.19	22,533,435.88
ADOBE INC	60,321	509.47	30,731,739.87
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	20,595	115.95	2,387,990.25
ANSYS INC	11,141	328.57	3,660,598.37
AUTODESK INC	27,654	278.89	7,712,424.06
AUTOMATIC DATA PROCESSING	53,839	196.72	10,591,208.08
BROADRIDGE FINANCIAL SOUTION	14,598	158.28	2,310,571.44
CADENCE DESIGN SYS INC	35,039	124.93	4,377,422.27
CITRIX SYSTEMS INC	15,673	117.06	1,834,681.38
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	66,664	71.30	4,753,143.20
DXC TECHNOLOGY CO	30,256	40.36	1,221,132.16
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	78,146	143.53	11,216,295.38
FISERV INC	74,908	109.66	8,214,411.28

FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	10,355	272.51	2,821,841.05
FORTINET INC	17,394	223.54	3,888,254.76
GARTNER INC	11,114	231.10	2,568,445.40
GLOBAL PAYMENTS INC	37,121	191.20	7,097,535.20
INTL BUSINESS MACHINES CORP	112,473	148.02	16,648,253.46
INTUIT INC	34,463	457.21	15,756,828.23
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	10,036	156.20	1,567,623.20
MASTERCARD INC - A	110,381	364.08	40,187,514.48
MICROSOFT CORP	949,473	253.81	240,985,742.13
NORTONLIFELOCK INC	73,273	28.43	2,083,151.39
ORACLE CORP	233,446	83.94	19,595,457.24
PAYCHEX INC	40,713	101.75	4,142,547.75
PAYCOM SOFTWARE INC	6,177	320.24	1,978,122.48
PAYPAL HOLDINGS INC	147,406	260.60	38,414,003.60
PTC INC	13,403	132.57	1,776,835.71
SALESFORCE.COM INC	115,504	238.14	27,506,122.56
SERVICENOW INC	24,659	459.46	11,329,824.14
SYNOPSYS INC	19,127	252.59	4,831,288.93
TYLER TECHNOLOGIES INC	5,103	407.55	2,079,727.65
VERISIGN INC	12,461	218.93	2,728,086.73
VISA INC-CLASS A SHARES	213,512	231.32	49,389,595.84
WESTERN UNION CO	54,227	24.63	1,335,611.01
AMPHENOL CORP-CL A	75,506	68.19	5,148,754.14
APPLE INC	1,986,722	125.90	250,128,299.80
ARISTA NETWORKS INC	6,937	352.51	2,445,361.87
CDW CORP/DE	17,432	165.76	2,889,528.32
CISCO SYSTEMS INC	531,849	53.92	28,677,298.08
CORNING INC	96,904	42.60	4,128,110.40
F5 NETWORKS INC	8,044	187.31	1,506,721.64
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	162,192	15.90	2,578,852.80
HP INC	157,808	30.55	4,821,034.40
IPG PHOTONICS CORP	4,913	205.78	1,010,997.14
JUNIPER NETWORKS INC	38,834	27.97	1,086,186.98
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	22,875	148.15	3,388,931.25
MOTOROLA SOLUTIONS INC	21,284	207.69	4,420,473.96
NETAPP INC	28,023	81.03	2,270,703.69
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	25,129	98.65	2,478,975.85
TE CONNECTIVITY LTD	41,672	139.01	5,792,824.72
TRIMBLE INC	31,625	78.22	2,473,707.50
WESTERN DIGITAL CORP	38,000	76.13	2,892,940.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	6,576	506.18	3,328,639.68
AT&T INC	897,451	29.08	26,097,875.08

LUMEN TECHNOLOGIES INC	126,261	14.78	1,866,137.58	
T-MOBILE US INC	73,511	143.51	10,549,563.61	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	520,701	57.20	29,784,097.20	
AES CORP	83,992	25.32	2,126,677.44	
ALLIANT ENERGY CORP	31,893	58.10	1,852,983.30	
AMEREN CORPORATION	31,580	86.13	2,719,985.40	
AMERICAN ELECTRIC POWER	62,434	85.67	5,348,720.78	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	22,214	157.47	3,498,038.58	
ATMOS ENERGY CORP	16,640	100.97	1,680,140.80	
CENTERPOINT ENERGY INC	70,397	25.58	1,800,755.26	
CMS ENERGY CORP	36,110	62.80	2,267,708.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	42,002	77.31	3,247,174.62	
DOMINION ENERGY INC	101,342	76.41	7,743,542.22	
DTE ENERGY COMPANY	23,763	137.85	3,275,729.55	
DUKE ENERGY CORP	96,788	101.86	9,858,825.68	
EDISON INTERNATIONAL	47,178	56.21	2,651,875.38	
ENTERGY CORP	24,999	106.59	2,664,643.41	
EVERGY INC	28,942	62.68	1,814,084.56	
EVERSOURCE ENERGY	44,068	82.11	3,618,423.48	
EXELON CORP	122,877	45.86	5,635,139.22	
FIRSTENERGY CORP	68,219	38.57	2,631,206.83	
NEXTERA ENERGY INC	246,810	72.47	17,886,320.70	
NISOURCE INC	52,586	25.51	1,341,468.86	
NRG ENERGY INC	28,086	34.51	969,247.86	
PINNACLE WEST CAPITAL	15,054	86.99	1,309,547.46	
PPL CORP	95,417	29.08	2,774,726.36	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	64,238	60.87	3,910,167.06	
SEMPRA ENERGY	39,637	136.10	5,394,595.70	
SOUTHERN CO/THE	133,069	64.67	8,605,572.23	
WEC ENERGY GROUP INC	40,314	93.56	3,771,777.84	
XCEL ENERGY INC	67,563	70.12	4,737,517.56	
ADVANCED MICRO DEVICES	152,565	81.35	12,411,162.75	
ANALOG DEVICES INC	46,483	164.48	7,645,523.84	
APPLIED MATERIALS INC	115,621	138.97	16,067,850.37	
BROADCOM INC	51,421	463.78	23,848,031.38	
ENPHASE ENERGY INC	16,226	137.47	2,230,588.22	
INTEL CORP	511,510	57.09	29,202,105.90	
KLA CORP	19,395	318.55	6,178,277.25	
LAM RESEARCH CORP	18,004	649.58	11,695,038.32	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	33,097	101.50	3,359,345.50	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	33,945	153.57	5,212,933.65	
MICRON TECHNOLOGY INC	140,885	84.04	11,839,975.40	

MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	5,444	342.64	1,865,332.16	
NVIDIA CORP	78,063	704.76	55,015,679.88	
NXP SEMICONDUCTORS NV	34,903	201.15	7,020,738.45	
QORVO INC	14,234	183.86	2,617,063.24	
QUALCOMM INC	143,074	133.32	19,074,625.68	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	20,215	169.72	3,430,889.80	
TERADYNE INC	20,900	130.80	2,733,720.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	115,972	188.55	21,866,520.60	
XILINX INC	31,401	127.73	4,010,849.73	
アメリカドル 小計	36,607,617		4,389,000,408.75 (480,376,094,737)	
合 計	36,607,617		480,376,094,737 (480,376,094,737)	

(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	15,800	2,962,816.00	
		AMERICAN TOWER CORP	57,128	15,346,294.64	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	17,936	3,804,943.04	
		BOSTON PROPERTIES INC	17,832	2,196,010.80	
		CROWN CASTLE INTL CORP	54,301	10,753,770.04	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	35,354	5,603,609.00	
		DUKE REALTY CORP	46,928	2,281,170.08	
		EQUINIX INC	11,232	8,930,113.92	
		EQUITY RESIDENTIAL	42,169	3,350,748.74	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,018	2,490,551.16	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	16,599	2,599,071.42	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	9,483	1,135,304.76	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	67,944	2,316,210.96	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	91,404	1,626,991.20	
		IRON MOUNTAIN INC	36,757	1,680,530.04	
		KIMCO REALTY CORP	57,043	1,259,509.44	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	14,403	2,392,626.36	
		PROLOGIS INC	93,131	11,425,311.08	
		PUBLIC STORAGE	19,156	5,578,610.32	
		REALTY INCOME CORP	45,959	3,233,215.65	
		REGENCY CENTERS CORP	18,383	1,227,984.40	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	13,870	4,371,824.00	

SIMON PROPERTY GROUP INC	41,419	5,550,146.00	
UDR INC	38,004	1,876,637.52	
VENTAS INC	47,299	2,702,664.86	
VORNADO REALTY TRUST	18,011	900,730.11	
WELLTOWER INC	53,174	4,087,485.38	
WEYERHAEUSER CO	96,173	3,433,376.10	
アメリカドル合計	1,084,910	115,118,257.02	
		(12,599,693,230)	
合計		12,599,693,230	
		(12,599,693,230)	

(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 477銘柄	97.44%		97.44%
	投資証券 28銘柄		2.56%	2.56%

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】

【MAXIS米国株式(S&P500)上場投信(為替ヘッジあり)】

【純資産額計算書】

令和3年6月30日現在

(単位:円)

資産総額	3,850,272,627
負債総額	24,527,324
純資産総額(-)	3,825,745,303
発行済口数	345,500口
1口当たり純資産価額(/)	11,073

(参考)

S & P 500 インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 6月30日現在
(単位:円)

資産総額	563,960,387,519
負債総額	20,037,365,177
純資産総額(-)	543,923,022,342
発行済口数	184,975,418,583口
1口当たり純資産価額(/)	2.9405
(10,000口当たり)	(29,405)

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】

<更新後>

(1) 資本金の額等

2021年6月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

(2) 委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

・投資運用の意思決定機構

投資環境見通しの策定

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

投資行動のモニタリング1

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

投資行動のモニタリング2

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

ファンドに関係する法人等の管理

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

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署は、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】

<更新後>

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

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	897	17,600,344
追加型公社債投資信託	16	1,436,394
単位型株式投資信託	79	355,163
単位型公社債投資信託	45	187,593
合計	1,037	19,579,494

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】

<更新後>

(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
その他未払金	2	3,818,195
未払費用	2	4,402,578
未払消費税等		629,469
未払法人税等		617,341
賞与引当金		933,517

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】

	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	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
投資有価証券償還益		585,179
収益分配金等時効完成分		101,734
受取賃貸料	2	65,808
その他		19,987
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
時効後支払損引当金繰入		
事務過誤費		3,483
賃貸関連費用		20,339
その他		1,920
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								株主資本合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金合計		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	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			利益剰余金合計		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	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		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	1,815	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ついて、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	
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、次表には含まれてありません(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、記載していません。

(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	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	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)を含めてあります。

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。

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	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	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)を含めてあります。

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		第36期	
	(自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)		(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		第36期	
	(自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)		(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		第36期	
	(令和2年3月31日現在)		(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	第36期
	(自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	(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	24,035	41,361
費用処理額		
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	269,848	329,255
退職給付費用		

(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	第36期
	(令和2年3月31日現在)	(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	第36期
	(令和2年3月31日現在)	(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	第36期
	(令和2年3月31日現在)	(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	株三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	4,073,855千円	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(株)	東京都千代田区	40,500百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	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	株三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	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(株)	東京都千代田区	40,500百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	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

あります。

2. 親会社に関する注記

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

（1株当たり情報）

	第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

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】

<更新後>

（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（2021年3月末現在）
事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

（2）販売会社

名称	資本金の額 (2021年3月末現在)	事業の内容
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616 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。
みずほ証券株式会社	125,167 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。
JPモルガン証券株式会社	73,272 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

大和証券株式会社	100,000 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。
フィリップ証券株式会社	950 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。
S M B C 日興証券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村證券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
BNPパリバ証券株式会社	102,025 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	5,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

3 【資本関係】

<訂正前>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2020年11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。

<訂正後>

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6月末現在）

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

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

独立監査人の監査報告書

令和3年7月7日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会御中

PwC あらた有限責任監査法人

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MAXIS米国株式(S&P500)上場投信(為替ヘッジあり)の令和3年2月24日から令和3年6月8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、MAXIS米国株式(S&P500)上場投信(為替ヘッジあり)の令和3年6月8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。

監査人は、経営者に対して、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

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。

[次へ](#)

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。