

【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】	2022年6月30日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【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】	D C 外国株式インデックス・オープン
【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】	10兆円を上限とします。
【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】

DC外国株式インデックス・オープン

（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振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、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又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。
当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及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、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又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。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。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】

10兆円を上限とします。

（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」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。基準価額につきましては、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

2022年 7月 1日から2022年12月28日までとします。

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（ 8 ） 【 申込取扱場所 】

下記の照会先にお問い合わせください。

（ 照会先 ）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（ 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 ）

（ 9 ） 【 払込期日 】

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとし、継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、委託会社の指定する口座を経由して、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」又は「受託者」ということがあります。）の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

（ 10 ） 【 払込取扱場所 】

取得申込みを受け付けた販売会社とします。販売会社の詳細につきましては、上記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

（ 11 ） 【 振替機関に関する事項 】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ） 【 その他 】

< 振替受益権について >

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとし、

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

当ファンドは「分配金再投資コース」（自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）専用ファンドです。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）

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、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及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できます。

< 受付不可日 >

分配金再投資コースの収益分配金の再投資の場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

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

フランクフルト証券取引所の休業日

ユーロネクスト パリ証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

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】

<ファンドの目的>

当ファンドは、日本を除く世界の主要国の株式に投資し、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）に連動する投資成果を目指します。

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法における、当ファンドの商品分類及び属性区分は下記の通りです。

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

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		（日本	ファンド	（ ）		
大型株	年2回	を除く）			TOPIX	条件付運用型
中小型株			ファンド・	なし		
	年4回	日本	オブ・ファン		その他	ロング・
債券			ズ		（MSCI コク	ショート型/絶
一般	年6回	北米			サイ・イン	対収益追求型
公債	（隔月）				デックス	
社債		欧州			（円ベ	その他
その他債券	年12回				ス））	（ ）
クレジット属	（毎月）	アジア				
性						
（ ）	日々	オセアニア				
不動産投信	その他					
	（ ）	中南米				
その他資産						
（投資信託証券		アフリカ				
（株式一般）						
資産複合		中近東				
（ ）		（中東）				
資産配分						
固定型		エマージ				
資産配分		ング				
変更型						

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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。

属性区分表に記載している「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おります。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）でもご覧いただけます。

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」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

- (1) 単位型投信...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う。
- (2) 追加型投信...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う。

[投資対象地域による区分]

- (1) 国内...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (2) 海外...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (3) 内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及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う。

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (2) 債券...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (3) 不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、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及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う。
- (4) その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる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う。

[独立した区分]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) 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号及び第2号に規定する証券投資信託並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う。

[補足分類]

- (1) インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資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う。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1)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う。

大型株...目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

中小型株...目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)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う。

公債...目論見書又は投資信託約款において、日本国又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、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

社債...目論見書又は投資信託約款において、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う。

その他債券...目論見書又は投資信託約款において、公債又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う。

格付等クレジットによる属性...目論見書又は投資信託約款において、上記 から の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合...以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

資産配分固定型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

資産配分変更型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

[決算頻度による属性区分]

(1)年1回...目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。

(2)年2回...目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。

(3)年4回...目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。

(4)年6回(隔月)...目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。

(5)年12回(毎月)...目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

(6)日々...目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

(1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、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う。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

- (2)日本...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (3)北米...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、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))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

- (1)ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、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く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2)ファンド・オブ・ファンズ...「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・ファンズをいう。

[為替ヘッジによる属性区分]

- (1)為替ヘッジあり...目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又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う。
- (2)為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

- (1)日経225
- (2)TOPIX
- (3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[特殊型]

- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、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・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (3)ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右さ

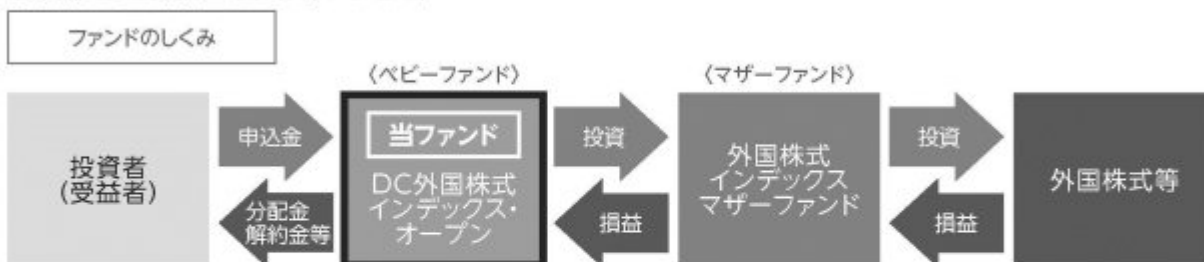
れにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

(4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)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う。

<ファンドの特色>

1. 日本を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とし、ファミリーファンド方式で運用を行います。

●原則として、為替ヘッジは行いません。

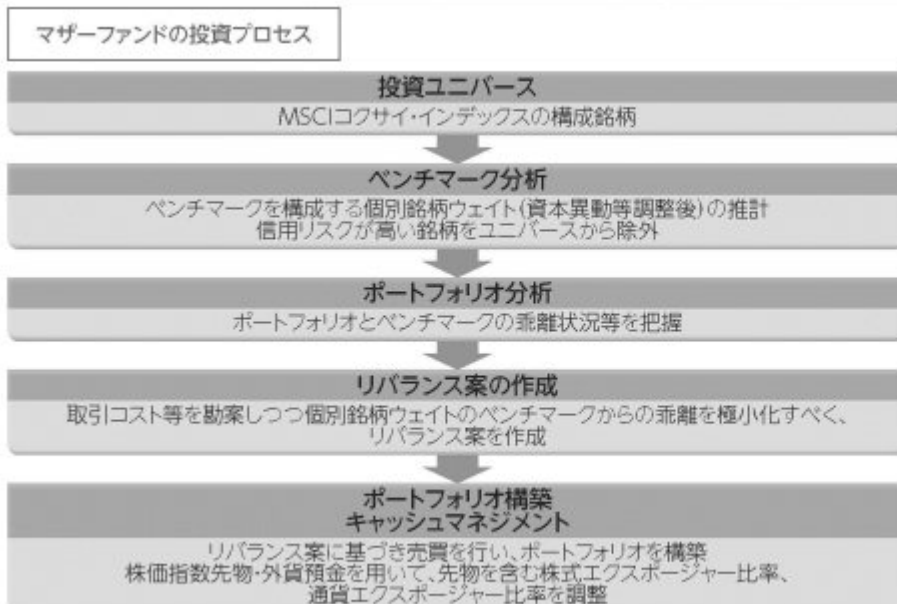


? ファミリーファンド方式とは

投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。

<マザーファンドの概要>

マザーファンド	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
外国株式インデックスマザーファンド	原則として、MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)を構成している国の株式	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

2. MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)に連動する投資成果を目指します。

? MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)とは

MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

分配方針

- 原則として、毎年9月30日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益等の全額とします。
- 分配金額については、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、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

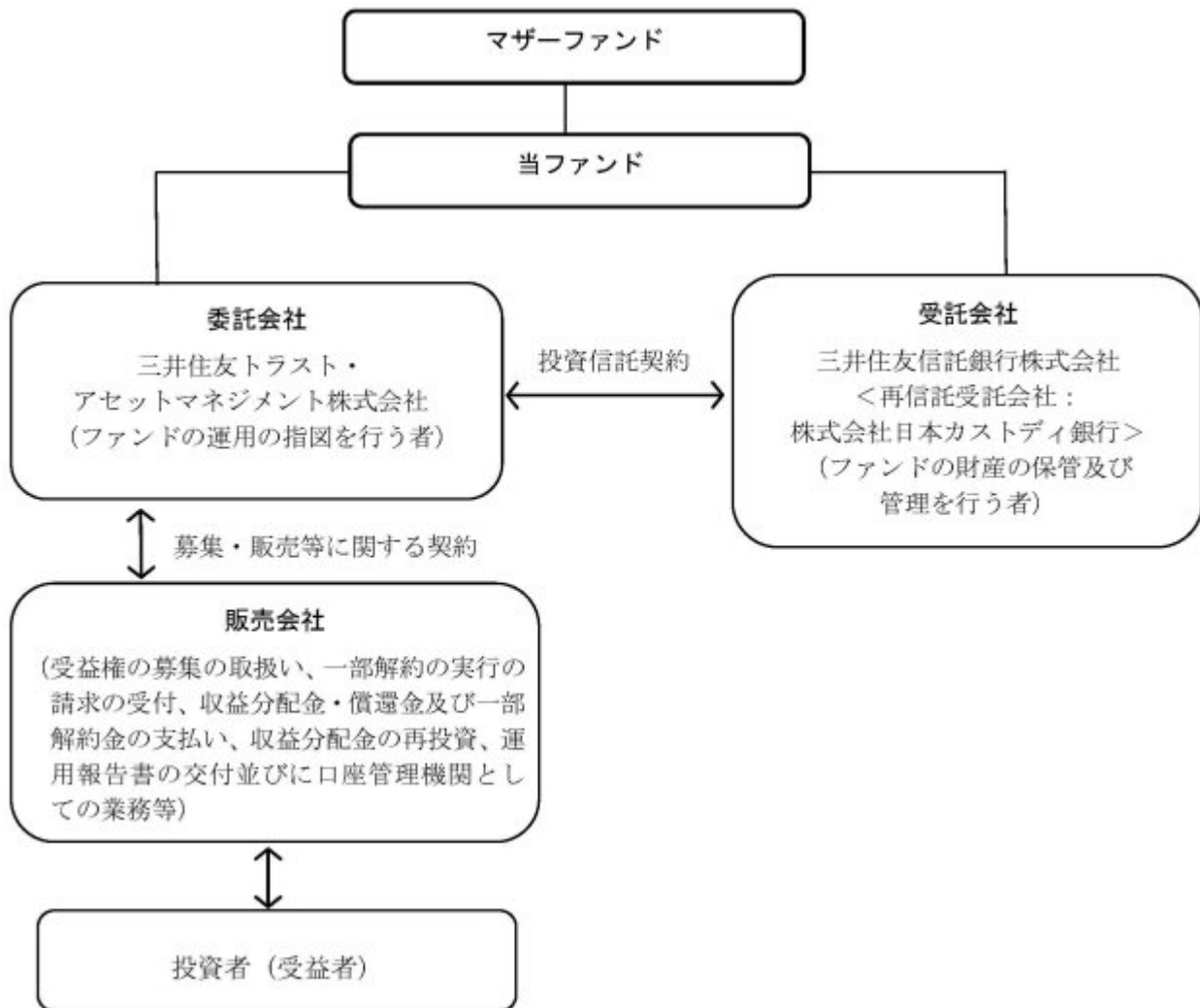
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2001年10月1日	本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
2012年 4月1日	本ファンドの名称を「すみしん DC外国株式インデックス・オープン」から「DC外国株式インデックス・オープン」に変更 本ファンドの主要投資対象である「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に変更

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2022年 4月28日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

- 1986年11月1日： 住信キャピタルマネジメント株式会社設立
- 1987年2月20日： 投資顧問業の登録
- 1987年9月9日： 投資一任契約に係る業務の認可
- 1990年10月1日： 住信投資顧問株式会社に商号変更
- 1999年2月15日： 住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 1999年3月25日： 証券投資信託委託業の認可
- 2007年9月30日： 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）
- 2012年4月1日： 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 2018年10月1日： 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

ハ．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

2【投資方針】

（１）【投資方針】

（イ）基本方針

当ファンドは、確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。

（ロ）運用方法

投資対象

外国株式インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下「マザーファンド受益証券」ということがあります。）を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。

投資態度

- 1)主として、マザーファンド受益証券に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- 2)株式の実質組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
- 3)実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- 4)運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の実質組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 5)有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。
- 6)ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- 7)投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- 8)投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、為替先渡取引を行うことができます。

（２）【投資対象】

（イ）本ファンド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、投資信託約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限り。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

- 2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

（ロ）委託者は、信託金を主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに次に掲げる有価証券（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。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
 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. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（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. 資産の流動化に関する法律に規定す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. コマーシャル・ペーパー
 11. 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
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
 13. 証券投資信託または外国証券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。）
 14. 投資証券もしくは投資法人債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。）
 15. 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。）
 16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 17. 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。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 20. 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。）
 21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号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、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

(八) 委託者は、信託金を、前記(ロ)に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（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。）により運用することを指図することができます。

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号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

- (二) 前記(ロ)の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前記(八)第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(参考) マザーファンドの概要

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

原則として、MSCI コクサイ・インデックスを構成している国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

原則としてMSCI コクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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ため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに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（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対す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投資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10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、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、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

（3）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、今後変更されることがあります。



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

委託会社は、受託会社又は再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書を再信託受託会社より受け取っております。

(4) 【分配方針】

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

- ・ 分配対象額の範囲

経費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。

- ・ 分配対象額についての分配方針

委託者が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

- ・ 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

株式への実質投資割合には制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

委託者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、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、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、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。前文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、委託者が投資することを指図することができるものとします。

（投資信託約款第19条）

委託者は、投資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るものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。（投資信託約款第22条）

1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハ

に掲げるものをいいます。)ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。(以下同じ。)また、委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことを指図することができます。(投資信託約款第23条)

委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨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。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、原則として本ファンドの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。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。(投資信託約款第24条)

委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことを指図することができます。為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として本ファンドの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可能なものについてはこの限りではありません。為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の時価総額を超えないものとします。(投資信託約款第25条)

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。(投資信託約款第26条)

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、投資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、投資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。

委託者は、投資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。この予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。(投資信託約款第28条)

委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当(一部解約に伴う支払資金の手当のために借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を目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図を行うことができます。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。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資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投資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投資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、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資

金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資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。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第36条）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対す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投資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10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、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、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

前記 から における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対する、本ファンドの投資信託財産に属する前記 から に掲げる当該各資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該各資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の合計額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。前記 、 および における「投資信託財産に属するとみなした額」も同様です。

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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全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) ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は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。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

信用リスク

有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

ファンドは、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。

同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。

ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

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、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要性が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止、取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

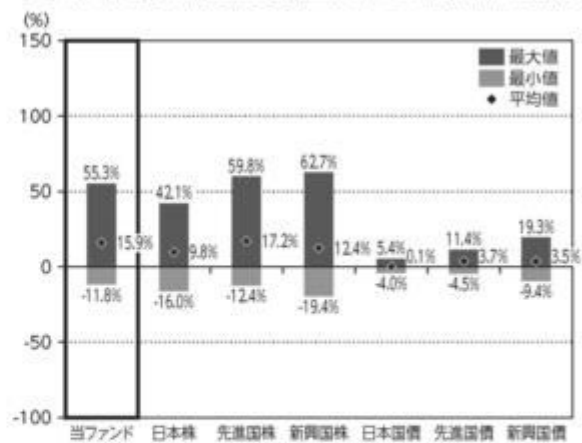
【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- *当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いますので、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。
- *当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- *2017年5月～2022年4月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の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。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- *当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いますので、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。

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX協研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての可能性を有するマーケットベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る権利又は商標は、株式会社JPX協研又は株式会社JPX協研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る権利又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
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、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI(宝債)	NOMURA-BPI(宝債)とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに關し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、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている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、本ファンドの権限、販売あるいは販売促進を行っていません。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及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、誤差または遅延につき同責任を負いません。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 J.P. Morganグローバル・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・フロー・レティナ(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金(解約)手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられます。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.88%（税抜 0.8%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.286% (税抜 0.26%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.528% (税抜 0.48%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.066% (税抜 0.06%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

(4) 【その他の手数料等】

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、先物取引・オプション取引に要する費用（ ）、組入資産の保管に要する費用（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

（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。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

上記は、2022年 4月28日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

税金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】

以下は、2022年4月28日現在の状況について記載してあります。

【DC外国株式インデックス・オープン】

（１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	50,471,291,533	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		24,991,199	0.05
合計(純資産総額)		50,496,282,732	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、本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】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	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	11,856,627,404	3.9270	46,561,645,336	4.2568	50,471,291,533	99.95

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

(注)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

【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】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第11期計算期間末 (2012年10月 1日)	5,083,992,515	5,083,992,515	10,868	10,868
第12期計算期間末 (2013年 9月30日)	7,817,677,232	7,817,677,232	16,277	16,277
第13期計算期間末 (2014年 9月30日)	10,784,005,815	10,784,005,815	20,456	20,456
第14期計算期間末 (2015年 9月30日)	11,660,543,974	11,660,543,974	20,674	20,674
第15期計算期間末 (2016年 9月30日)	12,010,556,272	12,010,556,272	19,557	19,557
第16期計算期間末 (2017年10月 2日)	16,657,048,067	16,657,048,067	25,863	25,863
第17期計算期間末 (2018年10月 1日)	20,827,907,679	20,827,907,679	28,917	28,917
第18期計算期間末 (2019年 9月30日)	22,583,883,724	22,583,883,724	27,818	27,818
第19期計算期間末 (2020年 9月30日)	28,088,372,694	28,088,372,694	29,948	29,948
第20期計算期間末 (2021年 9月30日)	44,437,735,913	44,437,735,913	41,202	41,202
2021年 4月末日	39,720,317,755		39,173	
5月末日	40,827,617,799		39,718	
6月末日	42,711,820,092		40,683	
7月末日	43,865,495,514		41,226	
8月末日	45,375,017,778		42,210	
9月末日	44,437,735,913		41,202	
10月末日	47,926,153,807		44,183	
11月末日	48,400,864,456		43,972	
12月末日	50,685,125,315		45,735	
2022年 1月末日	47,240,374,117		42,506	
2月末日	47,079,956,632		42,196	

3月末日	52,597,548,068		46,648	
4月末日	50,496,282,732		44,624	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	0
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	0
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	0
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	0
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	0
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	0
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	0
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	0
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	0
第20期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	22.6
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	49.8
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	25.7
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	1.1
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	5.4
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	32.2
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	11.8
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	3.8
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	7.7
第20期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	37.6
第21期中間計算期間	2021年10月 1日～2022年 3月31日	13.2

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	1,321,582,335	827,989,915	4,677,750,157
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	1,531,761,261	1,406,635,777	4,802,875,641

第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	1,521,908,168	1,052,984,543	5,271,799,266
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	1,857,940,393	1,489,664,884	5,640,074,775
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	1,413,274,013	912,179,071	6,141,169,717
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	1,664,339,529	1,365,115,383	6,440,393,863
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	1,965,600,718	1,203,377,289	7,202,617,292
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	2,336,552,629	1,420,598,127	8,118,571,794
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	3,634,946,823	2,374,557,577	9,378,961,040
第20期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	3,776,870,397	2,370,451,251	10,785,380,186
第21期中間計算期間	2021年10月 1日～2022年 3月31日	1,743,920,506	1,253,924,867	11,275,375,825

(注)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	352,768,959,240	67.28
	イギリス	22,297,482,372	4.25
	カナダ	19,957,673,254	3.81
	スイス	17,437,552,071	3.33
	フランス	15,458,609,266	2.95
	ドイツ	11,919,878,961	2.27
	オーストラリア	11,044,828,939	2.11
	アイルランド	9,399,426,739	1.79
	オランダ	8,865,318,090	1.69
	スウェーデン	4,916,116,962	0.94
	デンマーク	4,159,113,238	0.79
	スペイン	3,587,053,773	0.68
	香港	3,207,837,279	0.61
	イタリア	2,593,564,481	0.49
	フィンランド	1,827,816,852	0.35
	シンガポール	1,685,976,444	0.32
	ジャージー	1,618,116,735	0.31
	ベルギー	1,303,677,703	0.25
	ノルウェー	1,139,807,079	0.22
	イスラエル	1,086,275,918	0.21
ケイマン	1,061,245,601	0.20	
パミュダ	788,675,570	0.15	
キュラソー	551,480,042	0.11	
ルクセンブルク	461,878,546	0.09	

	ニュージーランド	421,815,193	0.08
	オーストリア	305,481,652	0.06
	ポルトガル	247,683,335	0.05
	リベリア	171,983,411	0.03
	パナマ	139,322,893	0.03
	マン島	117,492,509	0.02
	小計	500,542,144,148	95.46
投資信託受益証券	オーストラリア	158,266,929	0.03
	香港	65,309,729	0.01
	小計	223,576,658	0.04
投資証券	アメリカ	11,143,260,931	2.13
	オーストラリア	764,586,096	0.15
	イギリス	326,175,148	0.06
	フランス	249,410,326	0.05
	シンガポール	235,114,273	0.04
	香港	188,133,792	0.04
	カナダ	62,534,175	0.01
	小計	12,969,214,741	2.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		10,629,396,495	2.03
合計(純資産総額)		524,364,332,042	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザー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	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,918,405,120	1.51
	買建	カナダ	679,013,874	0.13
	買建	ドイツ	1,719,702,827	0.33
	買建	イギリス	215,389,359	0.04
	買建	オーストラリア	331,633,050	0.06

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場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、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザー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。

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		603,093,045	0.12

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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仲値によって評価しております。発表されていない場合は、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。

(注2)投資比率とは、マザー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

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	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	1,284,469	16,057.24	20,625,032,914	20,175.61	25,914,945,858	4.94
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	558,777	32,182.82	17,983,023,965	36,495.72	20,392,974,075	3.89
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	35,733	417,087.30	14,903,780,603	356,083.99	12,723,949,300	2.43
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	66,795	83,548.85	5,580,646,094	113,591.37	7,587,336,134	1.45
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	23,507	303,703.69	7,139,162,664	294,559.78	6,924,216,875	1.32
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	22,377	310,753.62	6,953,733,790	296,430.83	6,633,232,741	1.27
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	73,563	53,080.01	3,904,724,864	66,209.55	4,870,573,612	0.93
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	205,370	21,809.55	4,479,028,310	23,465.40	4,819,090,430	0.92
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	196,119	21,030.38	4,124,458,642	23,729.56	4,653,819,343	0.89
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	101,985	37,297.23	3,803,758,858	42,469.67	4,331,270,192	0.83
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	185,146	42,360.14	7,842,811,924	22,544.05	4,173,941,977	0.80
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	189,391	17,376.77	3,291,004,036	20,535.12	3,889,168,730	0.74
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	219,354	14,767.84	3,239,386,530	16,639.07	3,649,848,754	0.70
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	231,226	21,163.96	4,893,659,295	15,646.18	3,617,803,894	0.69
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	130,637	29,289.87	3,826,341,793	27,590.21	3,604,302,865	0.69
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	330,112	7,521.55	2,482,956,621	10,906.71	3,600,435,984	0.69
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	68,686	46,464.33	3,191,449,575	46,591.91	3,200,211,944	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	81,549	41,094.74	3,351,235,165	38,864.17	3,169,334,689	0.60
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	150,711	13,374.37	2,015,666,093	20,133.08	3,034,277,584	0.58
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	437,000	4,990.74	2,180,956,789	6,409.49	2,800,949,927	0.53

アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	137,691	14,586.95	2,008,492,007	20,310.91	2,796,629,949	0.53
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	319,753	7,124.66	2,278,134,415	8,448.06	2,701,293,041	0.52
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	576,261	5,462.37	3,147,753,911	4,671.17	2,691,815,977	0.51
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	54,689	41,943.24	2,293,833,853	48,408.82	2,647,430,231	0.50
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	34,433	48,743.87	1,678,397,751	71,398.74	2,458,473,117	0.47
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	107,665	19,063.54	2,052,476,939	22,531.17	2,425,818,526	0.46
アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活必需品小売り	120,012	18,301.98	2,196,457,919	19,875.36	2,385,282,472	0.45
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	32,460	61,250.30	1,988,185,049	72,102.32	2,340,441,450	0.45
アメリカ	株式	LILLY (ELI) & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	63,296	25,738.49	1,629,143,869	36,736.69	2,325,285,999	0.44
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	32,248	75,018.90	2,419,209,778	71,813.32	2,315,835,976	0.44

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.63
		素材	4.44
		資本財	5.93
		商業・専門サービス	1.19
		運輸	1.96
		自動車・自動車部品	2.25
		耐久消費財・アパレル	1.61
		消費者サービス	1.78
		メディア・娯楽	5.61
		小売	4.97
		食品・生活必需品小売り	1.63
		食品・飲料・タバコ	4.22
		家庭用品・パーソナル用品	1.75
		ヘルスケア機器・サービス	4.85
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.52		
銀行	5.71		

	各種金融	4.62
	保険	3.14
	不動産	0.44
	ソフトウェア・サービス	10.81
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.42
	電気通信サービス	1.52
	公益事業	3.11
	半導体・半導体製造装置	4.34
	小計	95.46
投資信託受益証券		0.04
投資証券		2.47
合計		97.97

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	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	S&P 500 EMIN	買建	294	アメリカドル	62,830,853	8,096,383,717	61,449,675	7,918,405,120	1.51
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	27	カナダドル	7,014,701.5	704,626,766	6,759,720	679,013,874	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	44	スイスフラン	5,122,808	680,821,183	5,275,600	701,127,240	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	205	ユーロ	7,599,250	1,032,206,128	7,498,900	1,018,575,587	0.19
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	20	オーストラリアドル	3,578,915	328,186,505	3,616,500	331,633,050	0.06
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	18	イギリスポンド	1,323,227.5	213,754,170	1,333,350	215,389,359	0.04

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場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、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザー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。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	3,790,000.00	487,492,200	488,270,220	0.09

スイスフラン	買建	450,000.00	59,806,800	59,811,525	0.01
オーストラリアドル	買建	600,000.00	55,007,400	55,011,300	0.01

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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仲値によって評価しております。発表されていない場合は、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。

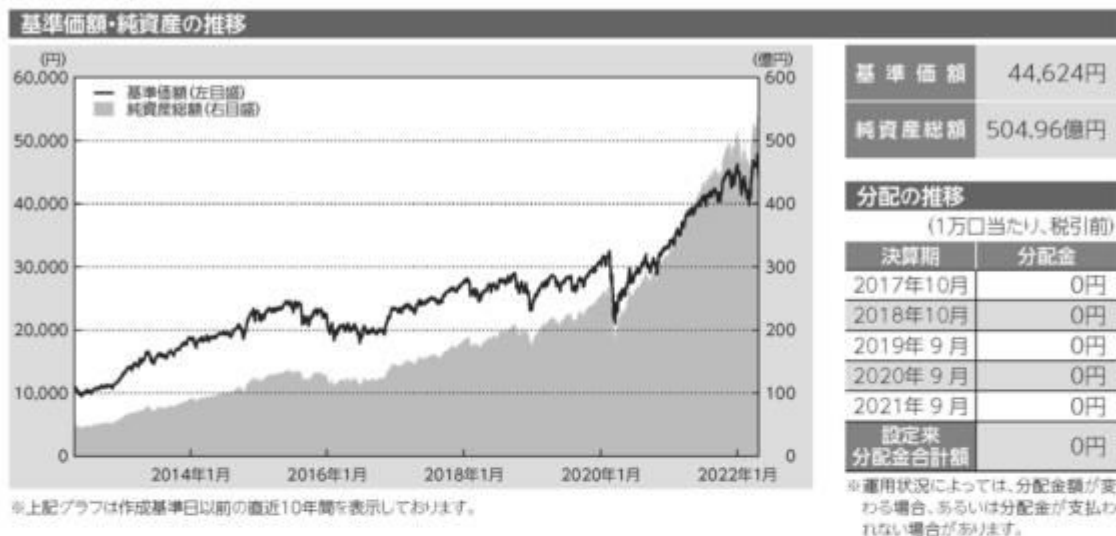
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

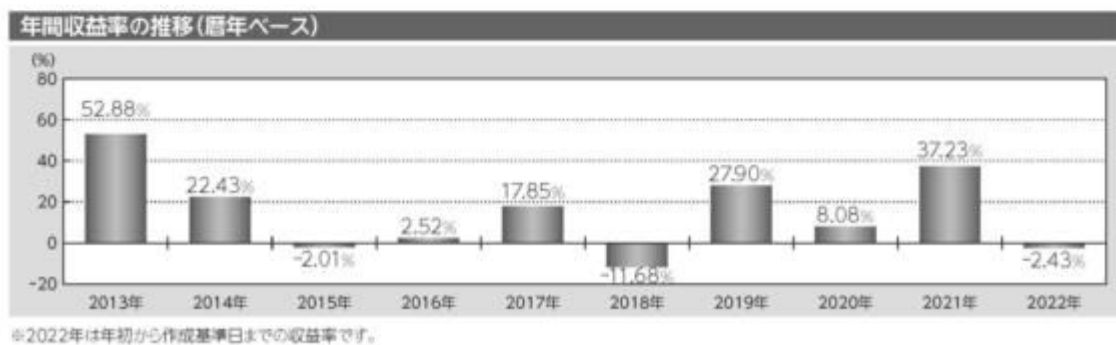
当初設定日：2001年10月1日
作成基準日：2022年4月28日



主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.9%
MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	3.9%
AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	2.4%
TESLA INC	アメリカ	株式	自動車・自動車部品	1.4%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	メディア・娯楽	1.3%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	メディア・娯楽	1.3%
UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア機器・サービス	0.9%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.9%
NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	0.9%
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	各種金融	0.8%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。



記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページ等でご確認いただけます。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に

規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

< 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

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

フランクフルト証券取引所の休業日

ユーロネクスト パリ証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、取引所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、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及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できます。

< その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

< 問い合わせ先 >

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

< 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（https://www.smtam.jp/）でご覧いただけます。

< 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにも拘ることとなります。

< 受付不可日 >

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないもの
とします。

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

フランクフルト証券取引所の休業日

ユーロネクスト パリ証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、取引所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、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、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一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記< 解約価額 >の規定に準じて計算された価額とします。

< 一部解約の制限 >

当ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

< その他 >

一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

< 問い合わせ先 >

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

< 基準価額の算出方法 >

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令及び一

般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、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。

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象である株式の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日（外国で取引されているものについては、原則として、本ファンドの基準価額計算日の前日）の当該取引所における最終相場で評価します。

外貨建資産等の円換算

外貨建資産の円換算については、原則として、わが国における本ファンドの基準価額計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は、原則として、わが国における本ファンドの基準価額計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

< 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<https://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2001年10月1日設定）

ただし、下記「(5)その他 <投資信託契約の終了（償還）と手続き>」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（4）【計算期間】

原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、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。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

(1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

- ・受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

委託会社は上記（１）によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの繰上償還について、あらかじめ、ファンドを繰上償還しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係る全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。

上記の公告及び書面には、受益者で異議のある者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。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

上記の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二分の一を超えるときは、ファンドの繰上償還を行いません。

委託会社は、このファンドの繰上償還を行わないこととしたときは、ファンドの繰上償還を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、全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。

ファンドの繰上償還において、上記 から までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1) 投資信託約款の変更

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができます。

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき
- ・やむを得ない事情が発生したとき

委託会社は、投資信託約款の変更を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続に従います。

(2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの重大な約款変更について、あらかじめ、変更をしようとする旨及びその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係る全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。

上記の公告及び書面には、受益者で異議のある者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。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

上記の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二分の一を超えるときは、当該約款変更を行いません。

委託会社は、当該約款変更を行わないこととしたときは、約款変更を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全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。

< 受託会社の辞任及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、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記<投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>に従い、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。

< 反対者の買取請求権 >

ファンドの償還又は重大な約款変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、販売会社を經由して受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、投資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。

< 運用報告書 >

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知っている受益者に対して交付します。

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名

義で混蔵寄託することができるものとします。

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

上記 ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、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いて、一部解約の実行の請求をすることにより換金する権利を有します。

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4) 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写を請求することができます。

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)」並びに同規則第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、第20期計算期間(2020年10月1日から2021年9月30日まで)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【財務諸表】

【DC外国株式インデックス・オープン】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第19期 (2020年 9月30日現在)	第20期 (2021年 9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	171,250,808	356,065,393
親投資信託受益証券	28,074,341,859	44,415,581,004
流動資産合計	28,245,592,667	44,771,646,397
資産合計	28,245,592,667	44,771,646,397
負債の部		
流動負債		
未払解約金	43,899,050	146,679,642
未払受託者報酬	8,397,302	13,916,170
未払委託者報酬	103,566,694	171,632,647
未払利息	395	865
その他未払費用	1,356,532	1,681,160
流動負債合計	157,219,973	333,910,484
負債合計	157,219,973	333,910,484
純資産の部		
元本等		
元本	9,378,961,040	10,785,380,186
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	18,709,411,654	33,652,355,727
(分配準備積立金)	5,256,965,241	13,838,330,132
元本等合計	28,088,372,694	44,437,735,913
純資産合計	28,088,372,694	44,437,735,913
負債純資産合計	28,245,592,667	44,771,646,397

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期		第20期	
	自	2019年10月1日	自	2020年10月1日
	至	2020年9月30日	至	2021年9月30日
営業収益				
受取利息		445		1,030
有価証券売買等損益		2,225,082,048		11,418,840,209
営業収益合計		2,225,082,493		11,418,841,239
営業費用				
支払利息		56,862		63,291
受託者報酬		16,279,799		24,478,876
委託者報酬		200,784,088		301,905,920
その他費用		1,356,682		1,681,160
営業費用合計		218,477,431		328,129,247
営業利益又は営業損失（ ）		2,006,605,062		11,090,711,992
経常利益又は経常損失（ ）		2,006,605,062		11,090,711,992
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,006,605,062		11,090,711,992
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（ ）		72,830,758		1,399,758,864
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		14,465,311,930		18,709,411,654
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,553,040,129		10,171,843,188
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		6,553,040,129		10,171,843,188
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,242,714,709		4,919,852,243
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,242,714,709		4,919,852,243
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		18,709,411,654		33,652,355,727

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	第19期 (2020年 9月30日現在)	第20期 (2021年 9月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,378,961,040口	10,785,380,186口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.9948円 (29,948円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 4.1202円 (41,202円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第19期 自 2019年10月 1日 至 2020年 9月30日			第20期 自 2020年10月 1日 至 2021年 9月30日		
分配金の計算過程			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	- 円	費用控除後の配当等収益額	A	- 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	1,561,744,969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	9,690,970,418円
収益調整金額	C	16,356,676,515円	収益調整金額	C	20,707,337,256円
分配準備積立金額	D	3,695,220,272円	分配準備積立金額	D	4,147,359,714円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	21,613,641,756円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	34,545,667,388円
当ファンドの期末残存口数	F	9,378,961,040口	当ファンドの期末残存口数	F	10,785,380,186口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	23,044円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	32,030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

	第20期 自 2020年10月 1日 至 2021年 9月30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第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	第20期 (2021年 9月30日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価と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 「(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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
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。

(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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第19期	第20期
	自 2019年10月 1日 至 2020年 9月30日	自 2020年10月 1日 至 2021年 9月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	8,118,571,794円	9,378,961,040円
期中追加設定元本額	3,634,946,823円	3,776,870,397円
期中一部解約元本額	2,374,557,577円	2,370,451,251円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第19期	第20期
	(2020年 9月30日現在)	(2021年 9月30日現在)
	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	2,218,452,852	11,232,018,138
合計	2,218,452,852	11,232,018,138

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（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

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	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	11,358,612,128	44,415,581,004
合計		11,358,612,128	44,415,581,004

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

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)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見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

	2021年 9月30日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	9,501,832,807
コール・ローン	10,937,684,705
株式	491,298,241,864
投資信託受益証券	298,398,739
投資証券	11,255,215,996
派生商品評価勘定	8,256,876
未収入金	12,429,117
未収配当金	503,836,659
前払金	309,036,646
差入委託証拠金	3,582,860,908
流動資産合計	527,707,794,317
資産合計	527,707,794,317
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	315,919,839
未払金	181,633,385
未払解約金	10,181,642,548
未払利息	26,577
流動負債合計	10,679,222,349
負債合計	10,679,222,349
純資産の部	
元本等	
元本	132,221,776,468
剰余金	
剰余金又は欠損金()	384,806,795,500
元本等合計	517,028,571,968
純資産合計	517,028,571,968

	2021年 9月30日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	527,707,794,317

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 9月30日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

2021年 9月30日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「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)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2021年 9月30日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	132,221,776,468口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.9103円 (1万口当たり純資産額) (39,103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

2021年 9月30日現在	
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第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2021年 9月30日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2.金融商品の時価等に関する事項

	2021年 9月30日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(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 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年10月 1日
期首元本額	150,010,636,596円
期中追加設定元本額	15,439,913,865円
期中一部解約元本額	33,228,773,993円
期末元本額	132,221,776,468円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,964,909,856円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,011,048円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	28,710,411,889円
世界経済インデックスファンド	9,138,354,270円
外国株式インデックス・オープン	840,545,238円
D C マイセレクション 2 5	844,204,517円
D C マイセレクション 5 0	3,980,357,562円
D C マイセレクション 7 5	4,492,096,568円
D C 外国株式インデックス・オープン	11,358,612,128円
D C マイセレクション S 2 5	413,352,438円
D C マイセレクション S 5 0	1,867,873,708円
D C マイセレクション S 7 5	1,532,562,549円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	52,239,057円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	162,563,416円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	116,261,022円
D C 世界経済インデックスファンド	9,849,873,631円
外国株式インデックス・オープン（S M A 専用）	1,897,240,610円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	5,429,856円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	5,085,097円

区分	2021年 9月30日現在
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	30,651,038円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	17,781,320円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	76,257,228円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	12,750,051円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	41,681,582円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	352,357,833円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	202,258,641円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,478,686,511円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	267,630,010円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	39,660,231円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	203,090,545円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	67,836,532円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,150,842,543円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,307,556,069円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,155,854,781円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,175,668,297円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,441,608,434円
分散投資コア戦略ファンドA	1,517,087,653円
分散投資コア戦略ファンドS	8,477,877,522円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,243,539,649円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,119,136,449円
コア投資戦略ファンド（切替型）	999,532,971円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	631,767,441円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,522,803円
SMT インデックスバランス・オープン	171,945,015円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	656,763,819円
外国株式SMTBセクション（SMA専用）	21,509,876,713円
SMT 世界経済インデックス・オープン	167,598,404円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	591,923,509円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	113,154,300円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,566,408円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	125,140,418円
グローバル経済コア	663,777,209円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	12,046,249円
DCターゲット・イヤーフンド2055	4,620,529円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	689,570,302円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	87,359,812円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	12,811,065円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	9,445,670円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	4,238,406円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	4,332,041円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	542,232,596円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	876,266,903円

区分	2021年 9月30日現在
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,583,370,135円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	989,757,963円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	156,929,133円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	55,608,951円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	9,923,033円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	9,708,100円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	277,587,747円
SMTAMバランスファンド2002（適格機関投資家専用）	260,107,582円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	279,785,392円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	270,292,284円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	268,409,933円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	265,829,351円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	266,176,902円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 9月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	13,676,374,795
投資信託受益証券	7,649,503
投資証券	391,116,245
合計	14,075,140,543

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式インデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引	14,625,557,282	-	14,316,520,636	309,036,646
	買建				
合計		14,625,557,282	-	14,316,520,636	309,036,646

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2021年 9月30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	1,236,146,328	-	1,237,360,995	1,214,667
	アメリカドル	1,029,217,830	-	1,031,101,956	1,884,126
	カナダドル	23,863,718	-	23,796,239	67,479
	ユーロ	103,012,840	-	102,590,190	422,650
	イギリスポンド	39,296,140	-	39,111,540	184,600
	スイスフラン	40,755,800	-	40,761,070	5,270
	売建	317,500,742	-	317,341,726	159,016
	カナダドル	317,500,742	-	317,341,726	159,016
合計		1,553,647,070	-	1,554,702,721	1,373,683

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	57,980	25.05	1,452,399.00	
	CABOT OIL & GAS CORP	64,000	22.55	1,443,200.00	
	CHENIERE ENERGY INC	19,034	97.59	1,857,528.06	
	CHEVRON CORP	159,475	103.33	16,478,551.75	
	CONOCOPHILLIPS	110,899	68.04	7,545,567.96	
	DEVON ENERGY CORPORATION	51,677	35.75	1,847,452.75	
	EOG RESOURCES INC	48,739	82.57	4,024,379.23	
	EXXON MOBIL	349,538	59.88	20,930,335.44	
	HALLIBURTON CO	77,539	22.16	1,718,264.24	
	HESS CORP	22,781	78.36	1,785,119.16	
	KINDER MORGAN INC	169,739	16.92	2,871,983.88	

MARATHON PETROLEUM CORP	54,237	61.93	3,358,897.41
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	79,106	30.03	2,375,553.18
ONEOK INC	37,709	58.81	2,217,666.29
PHILLIPS 66	35,503	69.96	2,483,789.88
PIONEER NATURAL RESOURCES	19,754	170.30	3,364,106.20
SCHLUMBERGER	116,716	30.33	3,539,996.28
VALERO ENERGY CORP	34,683	70.31	2,438,561.73
WILLIAMS COS	98,553	26.27	2,588,987.31
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	18,561	260.22	4,829,943.42
ALBEMARLE CORP	9,440	218.97	2,067,076.80
AMCOR PLC	132,975	11.73	1,559,796.75
AVERY DENNISON CORP	6,638	212.84	1,412,831.92
BALL CORP	27,925	89.74	2,505,989.50
CELANESE CORP-SERIES A	9,842	153.85	1,514,191.70
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	56.52	1,077,892.92
CORTEVA INC	58,500	42.86	2,507,310.00
CROWN HOLDINGS INC	11,212	100.98	1,132,187.76
DOW INC	60,946	58.82	3,584,843.72
DUPONT DE NEMOURS INC	43,310	69.15	2,994,886.50
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	104.00	1,151,800.00
ECOLAB INC	21,075	212.70	4,482,652.50
FMC CORP	10,507	93.24	979,672.68
FREEMONT-MCMORAN INC	119,724	33.11	3,964,061.64
INT'L PAPER CO	30,800	57.16	1,760,528.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	21,184	134.08	2,840,350.72
LINDE PLC	42,897	299.14	12,832,208.58
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,673	95.86	2,173,433.78
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,321	353.80	1,882,569.80
MOSAIC CO/THE	31,911	36.49	1,164,432.39
NEWMONT CORPORATION	65,375	53.71	3,511,291.25
NUCOR CORP	25,565	99.79	2,551,131.35
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	141.38	1,086,788.06
PPG INDUSTRIES INC	19,278	145.75	2,809,768.50
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	78.49	820,691.44
SEALED AIR CORP	11,690	55.87	653,120.30
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	20,917	282.26	5,904,032.42
STEEL DYNAMICS INC	18,273	59.55	1,088,157.15
VULCAN MATERIALS CO	11,347	173.76	1,971,654.72
WESTROCK CO	21,356	51.88	1,107,949.28
3 M COMPANY	47,702	180.88	8,628,337.76
ALLEGION PLC	7,601	135.22	1,027,807.22
AMETEK INC	19,666	126.83	2,494,238.78

BOEING CO	45,757	225.36	10,311,797.52
CARRIER GLOBAL CORP	67,383	52.85	3,561,191.55
CATERPILLAR	45,084	197.87	8,920,771.08
CUMMINS INC	12,028	230.67	2,774,498.76
DEERE&CO	24,503	350.87	8,597,367.61
DOVER CORP	12,202	159.30	1,943,778.60
EATON CORP	33,384	153.47	5,123,442.48
EMERSON ELECTRIC CO	49,115	95.64	4,697,358.60
FASTENAL CO	48,796	52.82	2,577,404.72
FORTIVE CORP	25,722	72.33	1,860,472.26
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	91.78	946,251.80
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	406.53	2,118,427.83
GENERAL DYNAMICS CORP	20,350	198.39	4,037,236.50
GENERAL ELECTRIC CO	90,337	106.28	9,601,016.36
GRAINGER (WW) INC	3,846	401.74	1,545,092.04
HEICO CORP	3,640	133.90	487,396.00
HEICO CORP-CLASS A	6,449	122.29	788,648.21
HONEYWELL INTL INC	57,260	214.92	12,306,319.20
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	31.91	1,008,164.54
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	197.33	694,996.26
IDEX CORP	5,916	213.00	1,260,108.00
ILLINOIS TOOL WORKS	26,587	213.26	5,669,943.62
INGERSOLL-RAND INC	31,562	51.41	1,622,602.42
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	51.03	903,231.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	60,279	70.49	4,249,066.71
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	16,974	223.03	3,785,711.22
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,062	300.48	920,069.76
LOCKHEED MARTIN CORP	20,558	350.29	7,201,261.82
MASCO CORP	19,462	55.69	1,083,838.78
NORDSON CORP	4,121	242.91	1,001,032.11
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,693	362.98	4,607,305.14
OTIS WORLDWIDE CORP	33,153	83.32	2,762,307.96
OWENS CORNING	8,642	88.12	761,533.04
PACCAR INC	28,106	81.06	2,278,272.36
PARKER HANNIFIN CORP	10,508	288.59	3,032,503.72
PENTAIR PLC	14,533	74.84	1,087,649.72
PLUG POWER INC	41,884	25.19	1,055,057.96
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	124,825	86.99	10,858,526.75
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,938	297.86	2,960,132.68
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,784	455.54	4,001,463.36
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	55.43	766,486.04
SMITH (A.O.) CORP	12,146	63.55	771,878.30

SNAP-ON INC	4,900	215.07	1,053,843.00
STANLEY BLACK&DECKER	13,718	182.12	2,498,322.16
SUNRUN INC	13,917	41.61	579,086.37
TEXTRON	18,893	71.60	1,352,738.80
TRANE TECHNOLOGIES PLC	19,522	176.41	3,443,876.02
TRANSDIGM GROUP INC	4,425	634.50	2,807,662.50
UNITED RENTALS INC	6,103	362.09	2,209,835.27
WABTEC CORP	15,024	88.14	1,324,215.36
XYLEM INC	15,209	127.78	1,943,406.02
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	79.45	902,869.80
CINTAS CORP	8,043	389.26	3,130,818.18
CLARIVATE PLC	27,357	21.84	597,476.88
COPART INC	18,067	141.42	2,555,035.14
COSTAR GROUP INC	32,116	85.38	2,742,064.08
EQUIFAX INC	10,409	256.55	2,670,428.95
IHS MARKIT LTD	30,929	117.03	3,619,620.87
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,661	136.42	1,454,373.62
LEIDOS HOLDINGS	11,220	97.95	1,098,999.00
REPUBLIC SERVICES INC	18,483	122.49	2,263,982.67
ROBERT HALF INTL INC	9,566	102.54	980,897.64
ROLLINS INC	17,468	36.05	629,721.40
TRANSUNION	15,741	113.51	1,786,760.91
VERISK ANALYTICS INC	12,503	202.37	2,530,232.11
WASTE CONNECTIONS INC	21,275	126.52	2,691,713.00
WASTE MANAGEMENT INC	34,610	151.60	5,246,876.00
AMERCO	734	661.20	485,320.80
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,292	88.44	998,664.48
CSX CORP	186,396	30.36	5,658,982.56
DELTA AIR LINES INC	14,609	43.36	633,446.24
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	121.06	1,727,768.32
FEDEX CORP	20,644	221.09	4,564,181.96
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	170.08	1,199,404.16
KANSAS CITY SOUTHERN	7,340	273.10	2,004,554.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	52.17	558,219.00
LYFT INC-A	21,288	53.32	1,135,076.16
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,133	244.24	5,161,523.92
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	293.17	2,346,239.51
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	52.54	711,023.82
UBER TECHNOLOGIES INC	99,588	44.52	4,433,657.76
UNION PACIFIC CORP	54,736	201.68	11,039,156.48
UNITED PARCEL SERVICE B	59,600	184.74	11,010,504.00
APTIV PLC	22,055	150.64	3,322,365.20

AUTOLIV INC	6,776	87.09	590,121.84
BORGWARNER INC	19,781	44.24	875,111.44
FORD MOTOR COMPANY	320,829	14.30	4,587,854.70
GENERAL MOTORS CO	108,886	52.93	5,763,335.98
LEAR CORP	5,287	158.50	837,989.50
TESLA INC	67,711	781.31	52,903,281.41
DR HORTON INC	27,764	86.48	2,401,030.72
GARMIN LTD	12,854	158.01	2,031,060.54
HASBRO INC	10,572	92.24	975,161.28
LENNAR CORP-CL A	22,762	96.34	2,192,891.08
LULULEMON ATHLETICA INC	10,358	410.22	4,249,058.76
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	182.95	926,092.90
NEWELL BRANDS INC	31,461	23.90	751,917.90
NIKE B	105,216	146.02	15,363,640.32
NVR INC	297	4,942.25	1,467,848.25
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	85.40	1,856,254.40
PULTE GROUP INC	21,609	47.92	1,035,503.28
VF CORP	28,638	68.54	1,962,848.52
WHIRLPOOL CORP	5,220	211.63	1,104,708.60
AIRBNB INC-CLASS A	10,665	168.07	1,792,466.55
ARAMARK	20,955	33.58	703,668.90
BOOKING HOLDINGS INC	3,378	2,377.82	8,032,275.96
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	113.40	1,991,304.00
CARNIVAL CORPORATION	70,520	25.52	1,799,670.40
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,304	1,846.54	4,254,428.16
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	153.68	1,646,220.16
DOMINO'S PIZZA INC	3,251	483.00	1,570,233.00
DRAFTKINGS INC - CL A	27,674	48.32	1,337,207.68
EXPEDIA GROUP INC	11,638	166.27	1,935,050.26
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,788	135.16	3,215,186.08
LAS VEGAS SANDS CORP	29,370	36.40	1,069,068.00
MARRIOTT INTL A	23,009	151.91	3,495,297.19
MCDONALD'S CORP	61,557	244.28	15,037,143.96
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	9.90	174,853.80
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,064	43.85	1,449,856.40
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,267	90.67	1,746,938.89
STARBUCKS CORP	97,088	112.17	10,890,360.96
VAIL RESORTS INC	3,574	342.59	1,224,416.66
WYNN RESORTS LTD	9,302	83.63	777,926.26
YUM BRANDS INC	24,252	123.04	2,983,966.08
ACTIVISION BLIZZARD INC	65,003	77.38	5,029,932.14
ALPHABET INC-CL A	24,877	2,687.07	66,846,240.39

ALPHABET INC-CL C	24,088	2,690.42	64,806,836.96
ALTICE USA INC- A	22,505	19.53	439,522.65
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	44,000	35.54	1,563,760.00
CABLE ONE INC	445	1,833.51	815,911.95
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	11,040	733.18	8,094,307.20
COMCAST CORP-CL A	378,603	55.93	21,175,265.79
DISCOVERY INC - A	12,804	25.42	325,477.68
DISCOVERY INC-C	28,190	24.37	686,990.30
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	44.14	888,626.48
ELECTRONIC ARTS INC	23,411	137.94	3,229,313.34
FACEBOOK INC-A	198,185	339.61	67,305,607.85
FOX CORP - CLASS A	27,658	40.25	1,113,234.50
FOX CORP- CLASS B	15,092	37.25	562,177.00
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	128.44	863,245.24
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	37.49	1,268,436.66
LIBERTY BROADBAND-A	2,579	169.20	436,366.80
LIBERTY BROADBAND-C	12,312	173.25	2,133,054.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	50.80	781,253.20
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	47.67	647,549.28
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	47.50	303,240.00
LIVE NATION ENTERTAINMENT	13,908	91.41	1,271,330.28
MATCH GROUP INC	21,851	152.38	3,329,655.38
NETFLIX INC	36,617	599.06	21,935,780.02
NEWS CORP-CLASS A	33,479	23.81	797,134.99
OMNICOM GROUP	18,031	73.55	1,326,180.05
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	50.37	2,305,283.79
ROKU INC	9,122	302.92	2,763,236.24
SEA LTD-ADR	5,838	311.78	1,820,171.64
SIRIUS XM HOLDINGS INC	99,548	6.10	607,242.80
SNAP INC - A	78,901	71.76	5,661,935.76
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,738	151.60	1,476,280.80
THE WALT DISNEY CO	150,108	172.68	25,920,649.44
TWITTER INC	66,866	60.07	4,016,640.62
VIACOMCBS INC-CLASS B	48,586	40.12	1,949,270.32
ZILLOW GROUP INC-A	5,497	86.88	477,579.36
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	85.66	1,150,156.82
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	216.77	1,154,083.48
AMAZON.COM	37,556	3,301.12	123,976,862.72
AUTOZONE INC	1,779	1,737.00	3,090,123.00
BATH & BODY WORKS INC	19,806	67.43	1,335,518.58
BEST BUY COMPANY INC	18,175	109.43	1,988,890.25
BURLINGTON STORES INC	5,808	303.18	1,760,869.44

CARMAX INC	13,891	146.45	2,034,336.95
CARVANA CO	5,700	305.81	1,743,117.00
CHEWY INC - CLASS A	6,878	67.71	465,709.38
DOLLAR GENERAL CORP	19,606	216.97	4,253,913.82
DOLLAR TREE INC	20,151	100.51	2,025,377.01
DOORDASH INC - A	6,300	205.83	1,296,729.00
EBAY	56,933	69.97	3,983,602.01
ETSY INC	10,294	205.30	2,113,358.20
GENUINE PARTS CO	12,119	124.16	1,504,695.04
HOME DEPOT	87,860	336.93	29,602,669.80
LKQ CORP	22,779	51.40	1,170,840.60
LOWES COMPANIES	58,268	207.10	12,067,302.80
MERCADOLIBRE INC	3,687	1,662.99	6,131,444.13
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,694	626.00	3,564,444.00
POOL CORP	3,304	446.83	1,476,326.32
ROSS STORES INC	29,776	114.97	3,423,346.72
TARGET (DAYTON HUDSON)	40,741	235.85	9,608,764.85
TJX COMPANIES INC	99,106	69.90	6,927,509.40
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,932	208.14	2,067,246.48
ULTA BEAUTY INC	4,520	378.35	1,710,142.00
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	270.85	1,625,100.00
COSTCO WHOLESALE CORP	36,370	451.79	16,431,602.30
KROGER CO	61,306	41.34	2,534,390.04
SYSCO CORP	43,568	80.93	3,525,958.24
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	48.71	2,911,250.57
WALMART INC	127,410	140.44	17,893,460.40
ALTRIA GROUP INC	152,143	48.74	7,415,449.82
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	45,402	60.78	2,759,533.56
BOSTON BEER COMPANY INC-A	744	513.99	382,408.56
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26,220	67.88	1,779,813.60
BUNGE LIMITED	11,604	80.94	939,227.76
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	42.85	679,986.65
COCA-COLA CO	337,573	52.96	17,877,866.08
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	55.31	851,442.14
CONAGRA BRANDS INC	41,157	34.66	1,426,501.62
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,180	211.76	3,002,756.80
GENERAL MILLS INC	49,646	60.77	3,016,987.42
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,532	171.90	2,154,250.80
HORMEL FOODS CORP	23,338	41.62	971,327.56
JM SMUCKER CO	9,145	122.16	1,117,153.20
KELLOGG CO	21,630	65.30	1,412,439.00
KEURIG DR PEPPER INC	59,596	34.64	2,064,405.44

KRAFT HEINZ CO/THE	57,338	37.53	2,151,895.14
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	61.61	796,247.64
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	21,088	83.69	1,764,854.72
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	47.32	694,137.08
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	115,437	59.05	6,816,554.85
MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	89.33	2,882,411.11
PEPSICO INC	113,536	152.30	17,291,532.80
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	128,506	99.49	12,785,061.94
TYSON FOODS INC	25,074	80.49	2,018,206.26
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,055	84.26	1,774,094.30
CLOROX COMPANY	10,830	168.11	1,820,631.30
COLGATE-PALMOLIVE CO	67,648	77.08	5,214,307.84
ESTEE LAUDER CO-CL A	19,298	306.40	5,912,907.20
KIMBERLY-CLARK CORP	27,550	135.78	3,740,739.00
PROCTER & GAMBLE CO	201,599	142.02	28,631,089.98
ABBOTT LABORATORIES	146,670	119.46	17,521,198.20
ABIOMED INC	3,781	329.51	1,245,877.31
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,263	673.06	4,215,374.78
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	122.50	1,579,760.00
ANTHEM INC	20,133	388.80	7,827,710.40
BAXTER INTERNATIONAL	40,994	81.81	3,353,719.14
BECTON DICKINSON & CO	24,401	251.79	6,143,927.79
BOSTON SCIENTIFIC CORP	118,882	43.89	5,217,730.98
CARDINAL HEALTH	24,692	51.59	1,273,860.28
CENTENE CORP	48,540	63.26	3,070,640.40
CERNER CORP	25,323	71.13	1,801,224.99
CIGNA CORP	28,583	203.93	5,828,931.19
CVS HEALTH CORP	108,379	86.79	9,406,213.41
DANAHER CORP	52,981	306.61	16,244,504.41
DAVITA INC	5,784	121.19	700,962.96
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	58.43	1,038,534.82
DEXCOM INC	8,037	545.58	4,384,826.46
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	51,036	113.52	5,793,606.72
HCA HEALTHCARE INC	22,436	252.21	5,658,583.56
HENRY SCHEIN INC	11,747	78.28	919,555.16
HOLOGIC INC	21,687	73.99	1,604,621.13
HUMANA INC	10,553	395.35	4,172,128.55
IDEXX LABORATORIES INC	7,161	629.55	4,508,207.55
INSULET CORP	5,311	278.97	1,481,609.67
INTUITIVE SURGICAL INC	9,753	992.35	9,678,389.55
LABORATORY CRP OF AMER	8,285	286.91	2,377,049.35
MASIMO CORP	4,147	270.43	1,121,473.21

MCKESSON CORP	12,843	205.45	2,638,594.35
MEDTRONIC PLC	111,197	126.58	14,075,316.26
MOLINA HEALTHCARE INC	4,940	280.13	1,383,842.20
NOVOCURE LTD	7,933	116.17	921,576.61
OAK STREET HEALTH INC	7,613	44.58	339,387.54
QUEST DIAGNOSTICS	11,335	147.68	1,673,952.80
RESMED INC	12,370	265.36	3,282,503.20
STERIS PLC	8,018	209.11	1,676,643.98
STRYKER CORP	27,883	267.89	7,469,576.87
TELADOC HEALTH INC	11,375	125.92	1,432,340.00
TELEFLEX INC	3,934	385.20	1,515,376.80
THE COOPER COS INC	4,134	422.30	1,745,788.20
UNITEDHEALTH GROUP INC	77,990	400.41	31,227,975.90
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,102	143.27	874,233.54
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	282.94	3,184,489.70
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,317	432.41	2,731,533.97
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,300	149.36	2,583,928.00
10X GENOMICS INC-CLASS A	5,655	145.94	825,290.70
ABBVIE INC	145,725	108.84	15,860,709.00
AGILENT TECHNOLOGIES	24,927	160.00	3,988,320.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	177.45	1,711,150.35
AMGEN	47,322	214.90	10,169,497.80
AVANTOR INC	42,980	40.82	1,754,443.60
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	749.27	1,388,397.31
BIO-TECHNE CORP	3,245	490.53	1,591,769.85
BIOGEN INC	12,750	285.56	3,640,890.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	76.79	1,135,186.57
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	184,073	60.62	11,158,505.26
CATALENT INC	13,739	134.24	1,844,323.36
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	423.09	1,778,670.36
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	32.35	1,166,573.35
EXACT SCIENCES CORP	14,756	91.65	1,352,387.40
GILEAD SCIENCES INC	103,105	70.94	7,314,268.70
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	109.82	1,968,633.32
ILLUMINA INC	11,968	411.61	4,926,148.48
INCYTE CORP	15,212	68.67	1,044,608.04
IQVIA HOLDINGS INC	16,036	242.91	3,895,304.76
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	131.63	654,332.73
JOHNSON & JOHNSON	217,670	164.02	35,702,233.40
LILLY (ELI) & CO	67,257	230.36	15,493,322.52
MERCK & CO	208,894	75.09	15,685,850.46
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,917	1,408.44	2,699,979.48

MODERNA INC	28,139	378.90	10,661,867.10
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	94.39	799,860.86
NOVAVAX INC	5,754	203.53	1,171,111.62
PERKINELMER INC	9,372	175.05	1,640,568.60
PFIZER	462,196	43.53	20,119,391.88
PPD INC	11,027	46.80	516,063.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,586	606.70	5,209,126.20
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	15,534	36.68	569,787.12
SEAGEN INC	11,471	164.25	1,884,111.75
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	9.97	801,597.97
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,450	579.60	18,808,020.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,153	182.22	3,854,499.66
VIATRIS INC	103,541	13.86	1,435,078.26
WATERS CORP	5,228	365.17	1,909,108.76
ZOETIS INC	39,050	194.99	7,614,359.50
BANK OF AMERICA CORP	637,169	43.07	27,442,868.83
CITIGROUP	170,381	71.53	12,187,352.93
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,041	47.99	1,729,607.59
FIFTH THIRD BANCORP	57,022	43.34	2,471,333.48
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,827	194.83	2,888,744.41
HUNTINGTON BANCSHARES INC	127,582	15.67	1,999,209.94
JPMORGAN CHASE & CO	250,254	165.95	41,529,651.30
KEY CORP	83,212	21.99	1,829,831.88
M & T BANK CORP	10,537	152.99	1,612,055.63
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,597	197.44	7,028,271.68
REGIONS FINL CORP	81,824	21.69	1,774,762.56
SVB FINANCIAL GROUP	4,545	655.99	2,981,474.55
TRUIST FINANCIAL CORP	110,428	59.42	6,561,631.76
US BANCORP	118,032	60.26	7,112,608.32
WELLS FARGO & CO	341,090	47.03	16,041,462.70
ALLY FINANCIAL INC	31,445	51.62	1,623,190.90
AMERICAN EXPRESS	56,226	171.54	9,645,008.04
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,404	270.71	2,545,756.84
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,153	62.35	944,789.55
BANK NEW YORK CO	67,972	52.63	3,577,366.36
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	109,624	277.29	30,397,638.96
BLACKROCK INC	12,568	856.57	10,765,371.76
BLACKSTONE INC	56,237	118.92	6,687,704.04
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	37,066	166.55	6,173,342.30
CARLYLE GROUP INC/THE	12,595	47.39	596,877.05
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	125.18	1,110,972.50
CME GROUP INC	30,156	196.16	5,915,400.96

DISCOVER FINANCIAL SERVICES	24,840	126.98	3,154,183.20
EQUITABLE HOLDINGS INC	32,815	30.19	990,684.85
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	394.51	1,241,917.48
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	30.46	794,092.20
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	89.42	385,936.72
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,994	384.89	10,774,610.66
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	47,143	116.90	5,511,016.70
INVESCO LTD	26,420	24.60	649,932.00
KKR & CO INC	43,643	60.84	2,655,240.12
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	423.66	1,358,677.62
MOODY'S CORP	14,125	359.42	5,076,807.50
MORGAN STANLEY	115,016	99.55	11,449,842.80
MSCI INC	6,908	610.70	4,218,715.60
NASDAQ INC	9,657	193.99	1,873,361.43
NORTHERN TRUST CORP	15,902	110.29	1,753,831.58
PRICE T ROWE GROUP INC	19,057	201.90	3,847,608.30
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	93.58	1,449,179.88
S&P GLOBAL INC	19,828	426.62	8,459,021.36
SCHWAB (CHARLES) CORP	118,978	75.38	8,968,561.64
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	60.01	573,095.50
STATE STREET CORP	29,894	86.54	2,587,026.76
SYNCHRONY FINANCIAL	49,509	50.54	2,502,184.86
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	81.87	741,824.07
VOYA FINANCIAL INC	10,050	61.62	619,281.00
AFLAC	54,481	52.74	2,873,327.94
ALLEGHANY CORP	1,276	627.81	801,085.56
ALLSTATE CORP	24,717	129.33	3,196,649.61
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	126.98	802,386.62
AMERICAN INT'L GROUP	71,038	55.84	3,966,761.92
AON PLC	18,508	291.25	5,390,455.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,031	38.84	1,321,764.04
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	150.89	2,468,409.51
ASSURANT INC	4,726	160.61	759,042.86
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	10,207	69.72	711,632.04
BROWN & BROWN INC	19,873	56.23	1,117,458.79
CHUBB LTD	37,517	176.39	6,617,623.63
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	116.35	1,488,232.85
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	177.79	385,093.14
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	253.04	831,995.52
FNF GROUP	24,961	45.90	1,145,709.90
GLOBE LIFE INC	8,106	90.10	730,350.60
HARTFORD FINANCIAL SVCS	30,371	71.68	2,176,993.28

LINCOLN NATIONAL CORP	16,364	70.53	1,154,152.92
LOEWS CORP	18,851	54.34	1,024,363.34
MARKEL CORP	1,156	1,207.84	1,396,263.04
MARSH & MCLENNAN COS	42,677	154.48	6,592,742.96
METLIFE INC	60,762	62.58	3,802,485.96
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,072	65.35	1,507,755.20
PROGRESSIVE CORP	47,880	91.14	4,363,783.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,127	105.89	3,507,818.03
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,733	139.58	521,052.14
TRAVELERS COS INC/THE	21,022	154.88	3,255,887.36
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,021	228.99	2,523,698.79
WR BERKLEY CORP	11,715	73.46	860,583.90
CBRE GROUP INC-A	27,882	98.61	2,749,444.02
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.75	468,825.00
WEYERHAEUSER CO	63,665	36.58	2,328,865.70
ACCENTURE PLC-CL A	52,468	323.53	16,974,972.04
ADOBE INC	39,486	577.70	22,811,062.20
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	105.71	1,445,372.83
ANSYS INC	7,474	340.96	2,548,335.04
AUTODESK INC	18,457	287.99	5,315,431.43
AUTOMATIC DATA PROCESS	34,970	199.58	6,979,312.60
AVALARA INC	6,847	175.54	1,201,922.38
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	60.11	841,299.56
BLACK KNIGHT INC	14,413	71.22	1,026,493.86
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	168.40	1,640,552.80
CADENCE DESIGN SYSTEMS	23,282	152.25	3,544,684.50
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	112.98	1,205,270.64
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	114.89	933,366.36
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	108.15	1,129,518.60
CLOUDFLARE INC - CLASS A	19,762	112.34	2,220,063.08
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	42,997	75.58	3,249,713.26
COUPA SOFTWARE INC	6,059	216.55	1,312,076.45
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,466	239.57	3,705,189.62
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	158.73	492,063.00
DATADOG INC - CLASS A	15,147	138.14	2,092,406.58
DOCUSIGN INC	15,919	256.89	4,089,431.91
DROPBOX INC-CLASS A	28,845	29.24	843,427.80
DYNATRACE INC	14,790	70.14	1,037,370.60
EPAM SYSTEMS INC	4,753	570.25	2,710,398.25
FAIR ISAAC CORP	2,615	399.75	1,045,346.25
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	50,915	123.34	6,279,856.10
FISERV INC	49,211	110.67	5,446,181.37

FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,523	265.92	1,734,596.16
FORTINET INC	11,565	288.83	3,340,318.95
GARTNER INC	6,968	307.85	2,145,098.80
GLOBAL PAYMENTS INC	24,126	160.70	3,877,048.20
GODADDY INC - CLASS A	13,798	69.78	962,824.44
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	118.84	750,831.12
HUBSPOT INC	3,646	681.24	2,483,801.04
INTL BUSINESS MACHINES CORP	73,589	139.18	10,242,117.02
INTUIT INC	22,531	546.93	12,322,879.83
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	166.16	1,045,312.56
MASTERCARD INC-CLASS A	73,080	353.19	25,811,125.20
MICROSOFT CORP	592,083	284.00	168,151,572.00
MONGODB INC	4,623	458.49	2,119,599.27
NORTONLIFELOCK INC	50,376	25.55	1,287,106.80
OKTA INC	10,230	233.33	2,386,965.90
ORACLE CORP	154,576	91.25	14,105,060.00
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	24.52	3,070,982.88
PALO ALTO NETWORKS INC	7,957	473.07	3,764,217.99
PAYCHEX INC	27,703	107.85	2,987,768.55
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	495.00	2,096,325.00
PAYPAL HOLDINGS INC	92,194	259.00	23,878,246.00
PTC INC	9,984	120.00	1,198,080.00
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	212.13	1,356,147.09
SALESFORCE.COM INC	80,235	270.50	21,703,567.50
SERVICENOW INC	16,268	618.02	10,053,949.36
SNOWFLAKE INC-CLASS A	15,775	293.80	4,634,695.00
SPLUNK INC	13,355	137.57	1,837,247.35
SQUARE INC - A	32,257	236.04	7,613,942.28
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	69.98	1,353,063.30
SYNOPSYS INC	12,728	302.62	3,851,747.36
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	35,780	67.81	2,426,241.80
TWILIO INC - A	13,692	312.80	4,282,857.60
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	454.98	1,519,178.22
UNITY SOFTWARE INC	4,329	125.83	544,718.07
VERISIGN INC	8,760	205.73	1,802,194.80
VISA INC-CLASS A SHARES	139,816	226.68	31,693,490.88
VMWARE INC-CLASS A	6,812	150.52	1,025,342.24
WESTERN UNION CO	38,757	20.78	805,370.46
WIX.COM LTD	5,010	193.88	971,338.80
WORKDAY INC-CLASS A	15,505	249.51	3,868,652.55
ZENDESK INC	10,500	116.27	1,220,835.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,545	257.41	4,516,258.45

ZSCALER INC	6,234	258.88	1,613,857.92
AMPHENOL CORPORATION	48,807	74.54	3,638,073.78
APPLE INC	1,380,967	142.83	197,243,516.61
ARISTA NETWORKS INC	4,720	345.98	1,633,025.60
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	114.39	697,779.00
CDW CORP/DE	11,982	185.39	2,221,342.98
CISCO SYSTEMS	347,932	55.48	19,303,267.36
COGNEX CORP	14,352	79.76	1,144,715.52
CORNING	64,989	37.13	2,413,041.57
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	105.38	2,369,047.78
F5 NETWORKS INC	5,350	202.45	1,083,107.50
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	109,149	14.09	1,537,909.41
HP INC	106,353	27.31	2,904,500.43
IPG PHOTONICS CORP	3,207	159.10	510,233.70
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	28.36	718,103.56
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,989	166.89	2,501,514.21
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,091	235.66	3,320,685.06
NETAPP INC	18,303	90.33	1,653,309.99
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	17,940	83.10	1,490,814.00
TE CONNECTIVITY LTD	27,668	138.71	3,837,828.28
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	432.52	1,686,395.48
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	84.31	1,785,348.56
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	56.70	1,462,293.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,612	525.67	2,424,390.04
AT&T INC	589,139	27.40	16,142,408.60
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	29.83	462,842.28
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	29.72	816,913.64
LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	13.21	974,488.49
T-MOBILE US INC	52,257	128.10	6,694,121.70
VERIZON COMMUNICATIONS	341,758	54.38	18,584,800.04
AES CORP	54,375	22.94	1,247,362.50
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	56.75	1,179,151.50
AMEREN CORPORATION	20,898	82.34	1,720,741.32
AMERICAN ELECTRIC POWER	41,494	82.17	3,409,561.98
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,464	170.30	2,633,519.20
ATMOS ENERGY CORP	11,419	88.91	1,015,263.29
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	25.11	1,209,347.82
CMS ENERGY CORP	23,697	59.85	1,418,265.45
CONSOLIDATED EDISON INC	28,745	73.45	2,111,320.25
DOMINION ENERGY INC	66,075	74.35	4,912,676.25
DTE ENERGY COMPANY	16,240	113.13	1,837,231.20
DUKE ENERGY CORP	63,155	98.34	6,210,662.70

EDISON INTL	32,117	56.43	1,812,362.31
ENERGY CORP	16,926	100.74	1,705,125.24
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	46.83	975,656.22
EVERGY INC	18,475	63.16	1,166,881.00
EVERSOURCE ENERGY	29,303	82.14	2,406,948.42
EXELON CORP	81,616	48.63	3,968,986.08
FIRSTENERGY CORP	45,787	36.30	1,662,068.10
NEXTERA ENERGY INC	161,732	78.35	12,671,702.20
NISOURCE INC	35,781	24.23	866,973.63
NRG ENERGY INC	19,068	41.48	790,940.64
PG&E CORP	118,132	9.51	1,123,435.32
PINNACLE WEST CAPITAL	8,632	72.40	624,956.80
PPL CORPORATION	63,429	28.47	1,805,823.63
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	43,258	61.26	2,649,985.08
SEMPRA ENERGY	25,825	127.46	3,291,654.50
SOUTHERN CO	88,673	62.64	5,554,476.72
UGI CORP	18,019	43.02	775,177.38
VISTRA CORP	37,797	16.95	640,659.15
WEC ENERGY GROUP INC	26,821	89.01	2,387,337.21
XCEL ENERGY INC	43,741	62.67	2,741,248.47
ADVANCED MICRO DEVICES	100,094	100.35	10,044,432.90
ANALOG DEVICES	44,237	168.84	7,468,975.08
APPLIED MATERIALS	75,599	128.27	9,697,083.73
BROADCOM INC	33,697	489.48	16,494,007.56
ENPHASE ENERGY INC	10,113	148.40	1,500,769.20
INTEL CORP	333,302	53.49	17,828,323.98
KLA CORP	12,889	335.30	4,321,681.70
LAM RESEARCH CORP	11,723	567.51	6,652,919.73
MARVELL TECHNOLOGY INC	66,930	60.15	4,025,839.50
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,404	153.07	3,429,380.28
MICRON TECHNOLOGY	94,036	71.64	6,736,739.04
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	484.61	1,711,157.91
NVIDIA CORP	206,048	205.17	42,274,868.16
NXP SEMICONDUCTORS NV	23,203	198.75	4,611,596.25
ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	45.84	1,650,056.64
QORVO INC	9,678	169.91	1,644,388.98
QUALCOMM	92,990	129.28	12,021,747.20
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	166.55	2,227,106.60
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	4,600	261.87	1,204,602.00
TERADYNE INC	14,398	109.17	1,571,829.66
TEXAS INSTRUMENTS	76,189	193.07	14,709,810.23
XILINX INC	20,982	148.28	3,111,210.96

	アメリカドル 小計	26,094,261		3,202,341,648.22 (358,406,077,268)	
カナダドル	CAMECO CORP	26,880	26.27	706,137.60	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,194	46.29	4,313,950.26	
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	12.85	1,242,158.10	
	ENBRIDGE	163,399	50.79	8,299,035.21	
	IMPERIAL OIL	24,763	40.03	991,262.89	
	INTER PIPELINE LTD	8,455	19.93	168,508.15	
	KEYERA CORP	18,607	31.95	594,493.65	
	PARKLAND CORP	14,075	35.55	500,366.25	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	39.79	1,817,050.14	
	SUNCOR ENERGY	116,208	26.45	3,073,701.60	
	TC ENERGY CORP	82,908	61.38	5,088,893.04	
	AGNICO EAGLE MINES	20,293	65.22	1,323,509.46	
	B2GOLD CORP	90,243	4.22	380,825.46	
	BARRICK GOLD CORP	153,589	22.43	3,445,001.27	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	66.40	872,429.60	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	23.26	1,000,180.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	15,363	164.21	2,522,758.23	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	8.01	415,294.47	
	KINROSS GOLD CORP	108,451	6.68	724,452.68	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,428	52.97	1,240,981.16	
	LUNDIN MINING CORP	62,243	9.10	566,411.30	
	NUTRIEN LTD	48,966	82.85	4,056,833.10	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	29.29	539,258.19	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	40,561	31.78	1,289,028.58	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,800	108.48	846,144.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	39,528	47.93	1,894,577.04	
	YAMANA GOLD INC	81,672	4.90	400,192.80	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	19,724	17.56	346,353.44	
	CAE INC	25,999	37.64	978,602.36	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,705	106.50	820,582.50	
	WSP GLOBAL INC	8,602	153.41	1,319,632.82	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	47.60	642,838.00	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	78.40	803,208.00		
THOMSON REUTERS CORP	15,013	141.55	2,125,090.15		
AIR CANADA	13,805	23.74	327,730.70		
CANADIAN NATL RAILWAY CO	57,324	147.59	8,460,449.16		
CP RAILWAY LIMITED	52,569	84.20	4,426,309.80		
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	96.83	2,254,396.06		
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	47.58	812,618.82		
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	78.63	1,814,229.99		

QUEBECOR INC -CL B	15,200	30.52	463,904.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	37.02	1,311,322.44
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	183.34	991,686.06
DOLLARAMA INC	26,700	55.41	1,479,447.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	66,914	48.77	3,263,395.78
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	38.20	582,664.60
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	85.66	1,106,127.58
METRO INC	18,840	60.77	1,144,906.80
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	136.54	939,804.82
SAPUTO INC	24,489	32.16	787,566.24
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	35.87	997,186.00
CANOPY GROWTH CORP	20,989	17.53	367,937.17
BANK MONTREAL	53,539	128.35	6,871,730.65
BANK NOVA SCOTIA	100,660	78.83	7,935,027.80
CANADIAN IMPERIAL BANK	36,854	142.50	5,251,695.00
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	96.69	2,638,573.41
ROYAL BANK OF CANADA	116,213	126.71	14,725,349.23
TORONTO-DOMINION BANK	151,853	84.93	12,896,875.29
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	106,335	68.10	7,241,413.50
IGM FINANCIAL INC	7,685	45.20	347,362.00
ONEX CORP	6,603	90.20	595,590.60
TMX GROUP LTD	4,685	137.60	644,656.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	513.04	1,094,314.32
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	38.51	916,075.88
IA FINANCIAL CORP INC	10,099	71.80	725,108.20
INTACT FINANCIAL CORP	13,312	169.53	2,256,783.36
MANULIFE FINANCIAL CORP	163,056	24.75	4,035,636.00
POWER CORP OF CANADA	43,577	41.17	1,794,065.09
SUN LIFE FINANCIAL INC	50,702	65.91	3,341,768.82
FIRSTSERVICE CORP	3,690	231.13	852,869.70
BLACKBERRY LIMITED	39,400	12.24	482,256.00
CGI INC - CL A	18,428	109.60	2,019,708.80
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,661	2,076.66	3,449,332.26
LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	126.00	1,045,296.00
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	145.04	623,817.04
OPEN TEXT CORP	24,643	62.54	1,541,173.22
SHOPIFY INC - CLASS A	9,220	1,717.91	15,839,130.20
BCE INC	6,203	63.28	392,525.84
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,584	59.63	1,823,723.92
TELUS CORP	32,908	27.86	916,816.88
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	18.80	974,178.40
ALTAGAS INCOME LTD	24,395	24.98	609,387.10

	ATCO LTD -CLASS I	5,241	40.79	213,780.39
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	49.49	558,989.55
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	34.26	353,700.24
	EMERA INC	18,723	57.47	1,076,010.81
	FORTIS INC	36,823	56.22	2,070,189.06
	HYDRO ONE LTD	32,299	30.19	975,106.81
	NORTHLAND POWER INC	17,854	40.34	720,230.36
	カナダドル 小計	3,380,581		196,731,672.25 (17,275,008,140)
ユーロ	ENI	218,529	11.38	2,488,608.25
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	9.57	471,180.13
	NESTE OIL OYJ	32,126	48.69	1,564,214.94
	OMV AG	12,549	50.86	638,242.14
	REPSOL SA	127,332	11.24	1,431,975.67
	TENARIS SA	40,648	8.93	362,986.64
	TOTALENERGIES SE	208,459	41.03	8,554,115.06
	VOPAK	6,360	34.42	218,911.20
	AIR LIQUIDE	38,463	139.68	5,372,511.84
	AKZO NOBEL	15,301	94.16	1,440,742.16
	ARCELORMITTAL	61,651	25.84	1,593,370.09
	ARKEMA	5,949	114.45	680,863.05
	BASF SE	74,374	65.83	4,896,040.42
	COVESTRO AG	17,254	59.16	1,020,746.64
	CRH PLC	64,773	40.83	2,644,681.59
	EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	27.37	540,666.98
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	40.42	232,900.04
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	64.78	844,795.98
	KONINKLIJKE DSM NV	14,947	172.35	2,576,115.45
	LANXESS	7,293	59.12	431,162.16
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	45.35	884,506.40
	SOLVAY SA	6,906	107.20	740,323.20
	STORA ENSO OYJ R	42,169	14.38	606,601.06
	SYMRISE AG	11,456	112.45	1,288,227.20
	UMICORE	17,605	50.96	897,150.80
	UPM KYMMENE OYJ	45,603	30.63	1,396,819.89
	VOESTALPINE AG	7,152	32.12	229,722.24
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	20,729	23.62	489,618.98
	AIRBUS SE	47,862	117.30	5,614,212.60
	ALSTOM	24,388	32.74	798,463.12
	BOUYGUES ORD	21,446	36.39	780,419.94
	BRENTAG SE	12,514	80.34	1,005,374.76
	CNH INDUSTRIAL NV	81,026	14.53	1,177,307.78

DASSAULT AVIATION SA	2,130	94.70	201,711.00
EIFFAGE	7,964	87.98	700,672.72
FERROVIAL SA	41,438	25.50	1,056,669.00
GEA GROUP AG	13,382	39.14	523,771.48
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	85.78	1,063,500.44
KION GROUP AG	5,887	81.22	478,142.14
KNORR-BREMSE AG	6,822	93.38	637,038.36
KONE OYJ-B	29,051	60.60	1,760,490.60
LEGRAND SA	21,768	93.38	2,032,695.84
MTU AERO ENGINES AG	4,753	198.50	943,470.50
PRYSMIAN SPA	21,155	30.78	651,150.90
RATIONAL AG	483	821.20	396,639.60
SAFRAN SA	28,410	112.52	3,196,693.20
SAINT-GOBAIN	40,093	59.66	2,391,948.38
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,808	144.86	6,490,886.88
SIEMENS	63,910	143.42	9,165,972.20
SIEMENS ENERGY AG	36,181	23.59	853,509.79
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	22.30	500,300.50
THALES SA	9,665	84.44	816,112.60
VINCI S.A.	43,434	90.62	3,935,989.08
WARTSILA OYJ	41,917	10.28	430,906.76
BUREAU VERITAS SA	25,073	26.52	664,935.96
RANDSTAD NV	11,218	58.12	651,990.16
TELEPERFORMANCE	4,734	345.40	1,635,123.60
WOLTERS KLUWER	22,949	91.42	2,097,997.58
ADP	2,382	114.75	273,334.50
AENA SME SA	6,542	148.90	974,103.80
ATLANTIA SPA	46,597	16.48	768,151.54
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	6.25	145,473.27
DEUTSCHE POST AG-REG	81,964	55.52	4,550,641.28
GETLINK	29,362	13.65	400,791.30
INPOST SA	12,480	14.27	178,164.48
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,107	84.47	2,205,258.29
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	67.60	337,391.60
CONTINENTAL AG	9,928	95.11	944,252.08
DAIMLER AG	69,397	77.40	5,371,327.80
FAURECIA	10,948	40.85	447,225.80
FERRARI NV	10,170	180.40	1,834,668.00
MICHELIN	13,839	133.60	1,848,890.40
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	86.12	1,011,479.40
RENAULT SA	17,362	31.39	544,993.18
STELLANTIS NV	170,174	16.66	2,835,098.84

VALEO SA	21,538	24.15	520,142.70
VITESCO TECHNOLOGIES GROUP A	1,985	51.70	102,624.50
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,167	196.04	2,973,338.68
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	275.80	685,638.80
ADIDAS AG	15,395	271.00	4,172,045.00
ESSILORLUXOTTICA	23,442	167.42	3,924,659.64
HERMES INTERNATIONAL	2,539	1,209.00	3,069,651.00
KERING	6,205	616.60	3,826,003.00
LVMH	22,813	625.50	14,269,531.50
MONCLER SPA	14,361	52.94	760,271.34
PUMA SE	9,220	95.74	882,722.80
SEB SA	2,282	123.70	282,283.40
ACCOR	14,436	31.85	459,786.60
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	14,518	175.90	2,553,716.20
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	44.80	363,238.40
SODEXO	8,135	76.82	624,930.70
BOLLORE	83,646	5.02	419,902.92
PUBLICIS GROUPE	17,077	57.74	986,025.98
SCOUT24 AG	7,492	60.96	456,712.32
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	51.28	362,600.88
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	61,243	22.99	1,408,282.78
VIVENDI SE	61,243	10.63	651,319.30
DELIVERY HERO SE	13,414	112.75	1,512,428.50
HELLOFRESH SE	13,805	79.68	1,099,982.40
INDITEX	87,326	32.19	2,811,023.94
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	65.14	1,014,360.08
PROSUS	75,024	69.54	5,217,168.96
ZALANDO SE	17,664	80.16	1,415,946.24
CARREFOUR	52,544	15.97	839,390.40
COLRUYT SA	5,424	48.36	262,304.64
JERONIMO MARTINS	24,901	17.30	430,911.80
KESKO OYJ-B SHS	20,083	30.36	609,719.88
KONINKLIJKE AHOLD NV	87,400	29.07	2,540,718.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,788	49.72	3,171,539.36
DANONE (GROUPE)	54,643	59.36	3,243,608.48
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	12.16	596,776.32
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	75.00	802,575.00
HEINEKEN NV	22,407	89.82	2,012,596.74
JDE PEET'S BV	7,000	25.98	181,860.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	114.55	1,494,877.50
PERNOD-RICARD	16,970	190.95	3,240,421.50
REMY COINTREAU	2,382	168.20	400,652.40

BEIERSDORF AG	9,190	95.52	877,828.80
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	75.50	662,890.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	81.36	1,174,757.04
LOREAL	21,038	363.30	7,643,105.40
AMPLIFON SPA	11,650	41.92	488,368.00
BIOMERIEUX	4,175	99.60	415,830.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	167.30	573,839.00
DIASORIN SPA	2,070	181.85	376,429.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,472	60.76	1,061,598.72
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	41.31	1,391,692.59
KONINKLIJKE PHILIPS	77,215	39.02	3,013,315.37
ORPEA	4,336	100.10	434,033.60
SARTORIUS AG-VORZUG	2,224	540.00	1,200,960.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	55.68	1,200,850.56
ARGENX SE	4,178	254.70	1,064,136.60
BAYER	79,047	47.42	3,748,408.74
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	110.60	1,130,332.00
GRIFOLS SA	27,685	21.72	601,318.20
IPSEN	3,532	80.88	285,668.16
MERCK KGAA	10,555	185.25	1,955,313.75
ORION OYJ-CLASS B	9,854	33.81	333,163.74
QIAGEN N.V.	17,038	44.35	755,635.30
RECORDATI SPA	9,859	48.99	482,992.41
SANOFI	94,644	83.71	7,922,649.24
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,419	476.00	1,151,444.00
UCB (GROUPE)	9,389	94.56	887,823.84
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	12.34	492,864.66
BANCO BILBAO VIZCAYA	534,866	5.74	3,071,200.57
BANCO SANTANDER SA	1,404,532	3.15	4,433,405.25
BNP PARIBAS	93,068	55.26	5,142,937.68
CAIXABANK	380,168	2.70	1,028,734.60
COMMERZBANK AG	94,388	5.76	544,524.37
CREDIT AGRICOLE SA	89,515	12.04	1,078,297.69
ERSTE GROUP BANK AG	23,905	37.84	904,565.20
FINECOBANK SPA	53,120	15.52	824,688.00
ING GROEP NV-CVA	320,768	12.66	4,060,922.88
INTESA SANPAOLO	1,346,514	2.45	3,311,077.92
KBC GROEP NV	21,052	76.80	1,616,793.60
MEDIOBANCA	53,990	10.33	557,986.65
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	22.40	279,776.00
SOCIETE GENERALE	67,846	27.11	1,839,644.29
UNICREDIT SPA	168,352	11.50	1,936,048.00

AMUNDI SA	6,226	73.25	456,054.50
DEUTSCHE BANK NAMEN	177,263	10.99	1,949,538.47
DEUTSCHE BOERSE	14,999	140.15	2,102,109.85
EURAZEO SA	3,357	81.25	272,756.25
EXOR NV	10,345	71.96	744,426.20
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	94.68	806,200.20
SOFINA	1,238	338.80	419,434.40
WENDEL	2,023	120.20	243,164.60
AEGON	166,267	4.43	736,562.81
AGEAS	16,065	40.46	649,989.90
ALLIANZ SE-REG	34,366	195.88	6,731,612.08
ASSICURAZIONI GENERALI	97,567	18.42	1,797,184.14
AXA SA	155,519	23.94	3,723,124.86
CNP ASSURANCES	16,287	13.77	224,353.42
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	153.00	662,949.00
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,376	239.60	2,725,689.60
NN GROUP NV	22,611	45.10	1,019,756.10
POSTE ITALIANE SPA	46,035	11.83	544,594.05
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	42.70	1,839,302.50
SCOR SE	13,354	25.43	339,592.22
AROUNDTOWN SA	94,068	5.93	558,575.78
DEUTSCHE WOHNEN SE	28,092	52.98	1,488,314.16
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	123.95	653,836.25
VONOVIA SE	45,080	53.08	2,392,846.40
ADYEN NV	1,666	2,495.00	4,156,670.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,584	57.64	2,051,061.76
ATOS SE	9,750	45.32	441,870.00
BECHTLE AG	7,659	59.32	454,331.88
CAPGEMINI SA	12,715	181.05	2,302,050.75
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	45.39	2,395,357.96
EDENRED	18,664	46.73	872,168.72
NEMETSCHKE SE	5,455	89.06	485,822.30
NEXI SPA	41,348	16.64	688,030.72
SAP SE	85,576	117.78	10,079,141.28
TEAMVIEWER AG	14,174	25.74	364,838.76
WORLDLINE SA	20,332	66.63	1,354,721.16
NOKIA OYJ	450,608	4.73	2,132,952.96
CELLNEX TELECOM SA	41,435	53.06	2,198,541.10
DEUTSCHE TELEKOM	269,906	17.53	4,733,071.61
ELISA A	13,387	53.54	716,739.98
ILIAD SA	1,253	182.00	228,046.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.61	292,025.25

	KPN (KON.)	282,927	2.73	772,390.71
	ORANGE	171,535	9.40	1,612,772.07
	PROXIMUS	13,141	17.11	224,842.51
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.34	294,812.48
	TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.36	169,440.97
	TELEFONICA	402,460	4.08	1,643,042.95
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.43	240,272.31
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	33.49	318,590.37
	E.ON SE	185,377	10.71	1,986,129.17
	EDP RENOVAVEIS SA	21,466	21.10	452,932.60
	ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	11.14	440,263.94
	ELIA GROUP SA/NV	2,925	104.00	304,200.00
	ENAGAS	15,690	19.17	300,777.30
	ENDESA	25,972	17.86	463,859.92
	ENEL	651,071	6.79	4,422,725.30
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.55	1,027,176.15
	ENGIE	158,224	11.61	1,838,246.43
	FORTUM OYJ	32,550	26.72	869,736.00
	IBERDROLA SA	487,356	8.93	4,354,038.50
	NATURGY ENERGY GROUP SA	23,310	21.91	510,722.10
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	17.27	684,444.64
	RWE STAMM	55,390	31.42	1,740,353.80
	SNAM SPA	147,559	4.78	705,627.13
	SUEZ	32,549	19.69	640,889.81
	TERNA SPA	130,230	6.21	809,509.68
	UNIPER SE	7,335	36.12	264,940.20
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,427	26.27	1,140,827.29
	VERBUND AG	6,430	90.65	582,879.50
	ASM INTERNATIONAL NV	3,483	336.20	1,170,984.60
	ASML HOLDING NV	34,516	647.70	22,356,013.20
	INFINEON TECHNOLOGIES	105,296	35.23	3,710,104.56
	STMICROELECTRONICS	55,076	37.51	2,065,900.76
	ユーロ 小計	15,756,322		397,624,142.61 (51,635,471,159)
イギリスポンド	BP PLC	1,696,535	3.38	5,739,377.90
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	341,807	16.51	5,643,917.18
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	308,298	16.48	5,080,751.04
	ANGLO AMERICAN PLC	108,946	25.56	2,785,204.49
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	13.76	493,378.56
	BHP GROUP PLC	175,556	18.61	3,268,501.60
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	84.62	924,388.88
	EVRAZ PLC	43,000	5.76	248,024.00

GLENCORE PLC	823,141	3.47	2,862,884.39
JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	26.58	447,819.84
MONDI PLC	36,710	18.14	666,102.95
RIO TINTO PLC REG	91,370	48.20	4,404,490.85
ASHTED GROUP PLC	37,034	56.80	2,103,531.20
BAE SYSTEMS PLC	260,104	5.70	1,484,673.63
BUNZL PLC	24,880	24.57	611,301.60
DCC PLC	9,127	62.56	570,985.12
FERGUSON PLC	17,761	104.30	1,852,472.30
MELROSE INDUSTRIES PLC	319,777	1.79	574,159.60
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	1.44	919,524.41
SMITHS GROUP PLC	37,146	14.21	527,844.66
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	150.45	829,581.30
EXPERIAN PLC	74,115	31.08	2,303,494.20
INTERTEK GROUP PLC	13,890	49.24	683,943.60
RELX PLC	158,847	21.57	3,426,329.79
RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	5.85	821,808.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	6.70	490,599.80
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	10,924	43.34	473,446.16
BURBERRY GROUP PLC	29,776	18.11	539,392.24
PERSIMMON PLC	25,686	26.59	682,990.74
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.55	411,077.87
COMPASS GROUP PLC	142,427	15.42	2,196,224.34
ENTAIN PLC	49,630	21.65	1,074,489.50
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	48.84	783,442.44
WHITBREAD PLC	17,434	33.86	590,315.24
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	5.89	427,235.95
INFORMA PLC	110,598	5.57	616,252.05
PEARSON	66,305	7.12	472,356.82
WPP PLC	95,821	10.01	959,647.31
JD SPORTS FASHION PLC	41,365	10.61	438,882.65
KINGFISHER PLC	198,587	3.46	687,111.02
NEXT PLC	11,468	83.94	962,623.92
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	2.96	619,726.32
OCADO GROUP PLC	44,612	16.68	744,351.22
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.90	430,913.17
TESCO PLC	666,000	2.56	1,708,290.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	33,490	19.18	642,338.20
BRITISH AMERICAN TOBACCO	181,738	27.36	4,973,260.37
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	24.32	436,787.20
DIAGEO	195,886	35.61	6,976,479.89
IMPERIAL BRANDS PLC	80,986	15.62	1,265,001.32

	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	57,728	58.45	3,374,201.60
	UNILEVER PLC	214,937	40.63	8,733,964.99
	SMITH & NEPHEW PLC	68,595	13.15	902,024.25
	ASTRAZENECA	127,338	88.33	11,247,765.54
	GLAXOSMITHKLINE	418,936	14.05	5,886,050.80
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	24.47	402,629.38
	BARCLAYS	1,426,525	1.87	2,678,728.64
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,705,000	3.93	6,709,175.00
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,838,937	0.46	2,711,310.39
	NATWEST GROUP PLC	443,701	2.24	996,108.74
	STANDARD CHARTERED PLC	212,446	4.37	928,813.91
	3I GROUP PLC	74,757	12.74	952,404.18
	ABRDN PLC	210,980	2.55	537,999.00
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	14.39	476,006.81
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	27,592	74.06	2,043,463.52
	M&G PLC	229,107	2.03	466,920.06
	SCHRODERS PLC	11,794	35.98	424,348.12
	ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	15.12	618,922.08
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	31.26	508,131.30
	AVIVA PIC	332,730	4.01	1,334,247.30
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.88	327,499.20
	LEGAL & GENERAL GROUP	514,539	2.80	1,444,310.97
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.43	328,140.43
	PRUDENTIAL	210,968	14.47	3,053,761.80
	AVEVA GROUP PLC	10,917	36.39	397,269.63
	SAGE GROUP PLC	95,210	7.09	675,038.90
	HALMA PLC	31,069	28.45	883,913.05
	BT GROUP PLC	769,485	1.62	1,251,952.09
	VODAFONE GROUP PLC	2,376,986	1.15	2,745,418.83
	NATIONAL GRID PLC	286,046	8.98	2,569,551.21
	SEVERN TRENT PLC	22,468	26.24	589,560.32
	SSE PLC	81,663	16.00	1,306,608.00
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	9.76	571,975.12
	イギリスボンド 小計	24,358,251		146,955,941.99 (22,106,582,353)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	17.71	308,118.58
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	875.00	502,250.00
	GIVAUDAN-REG	748	4,233.00	3,166,284.00
	HOLCIM LTD	45,387	45.33	2,057,392.71
	SIKA AG-BR	11,766	298.00	3,506,268.00
	ABB LTD	141,281	31.37	4,431,984.97
	GEBERIT AG-REG	2,964	691.20	2,048,716.80

	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,375	242.00	332,750.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	252.70	781,348.40
	ADECCO GROUP AG-REG	14,573	47.91	698,192.43
	SGS SA	506	2,716.00	1,374,296.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	325.70	1,490,728.90
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	43,541	97.88	4,261,793.08
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	247.90	615,535.70
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	48.28	190,126.64
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,106.00	589,680.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	108,500.00	1,085,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,300.00	844,600.00
	NESTLE SA - REGISTERED	237,137	112.46	26,668,427.02
	ALCON INC	42,603	75.92	3,234,419.76
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,677	353.60	1,653,787.20
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	854	1,679.00	1,433,866.00
	LONZA GROUP AG-REG	6,195	696.80	4,316,676.00
	NOVARTIS	182,811	77.23	14,118,493.53
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,799	379.80	1,063,060.20
	ROCHE HOLDING GENUSS	57,934	338.05	19,584,588.70
	VIFOR PHARMA AG	4,486	119.60	536,525.60
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,854	71.40	203,775.60
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	9.34	1,994,330.36
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	62.42	1,179,550.74
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	1,461.50	2,678,929.50
	UBS GROUP AG	298,295	15.07	4,495,305.65
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,362	142.80	622,893.60
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,849	469.30	1,337,035.70
	SWISS RE LTD	24,674	80.82	1,994,152.68
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,260	385.50	4,726,230.00
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	91.05	517,072.95
	TEMENOS AG - REG	5,150	126.30	650,445.00
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	83.62	1,228,043.32
	SWISSCOM	2,187	538.00	1,176,606.00
	スイスフラン 小計	1,441,140		123,699,281.32 (14,829,069,844)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	317.40	5,466,262.80
	BOLIDEN AB	23,903	279.00	6,668,937.00
	SCA SV CELLULOSA B	56,967	135.70	7,730,421.90
	ALFA LAVAL AB	27,268	322.40	8,791,203.20
	ASSA ABLOY AB-B	86,548	255.00	22,069,740.00
	ATLAS COPCO A	55,390	529.40	29,323,466.00
	ATLAS COPCO B	31,902	448.80	14,317,617.60

EPIROC AB-A	58,039	178.05	10,333,843.95		
EPIROC AB-B	37,972	151.15	5,739,467.80		
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	270.80	3,791,741.60		
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	107,624	111.40	11,989,313.60		
SANDVIK AB	96,684	200.30	19,365,805.20		
SKANSKA B	25,507	222.30	5,670,206.10		
SKF AB-B	35,405	206.40	7,307,592.00		
VOLVO AB-A SHS	13,514	196.70	2,658,203.80		
VOLVO B	123,279	195.16	24,059,129.64		
SECURITAS B	29,533	137.50	4,060,787.50		
ELECTROLUX AB-SER B	21,269	207.60	4,415,444.40		
HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	105.75	4,093,794.00		
EVOLUTION AB	14,096	1,341.40	18,908,374.40		
EMBRACER GROUP AB	37,510	85.00	3,188,350.00		
HENNES & MAURITZ B	65,999	184.70	12,190,015.30		
ICA GRUPPEN AB	9,493	403.10	3,826,628.30		
SWEDISH MATCH AB	127,270	76.60	9,748,882.00		
ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	273.50	13,531,139.00		
NORDEA BANK ABP	253,851	113.38	28,781,626.38		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,470	123.90	17,156,433.00		
SVENSKA HANDELSBK A	131,166	98.28	12,890,994.48		
SWEDBANK AB-A	72,526	176.04	12,767,477.04		
EQT AB	20,102	358.70	7,210,587.40		
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	10,115	279.60	2,828,154.00		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	269.50	3,009,776.00		
INVESTOR AB-B SHS	142,777	188.94	26,976,286.38		
KINNEVIK AB - B	18,792	305.15	5,734,378.80		
LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	478.10	3,480,568.00		
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	9,450	528.00	4,989,600.00		
SINCH AB	44,150	165.90	7,324,485.00		
ERICSSON (LM) B	225,508	99.00	22,325,292.00		
HEXAGON AB-B SHS	169,708	135.05	22,919,065.40		
TELE2 AB-B SHS	32,829	127.95	4,200,470.55		
TELIA CO AB	230,643	36.24	8,358,502.32		
スウェーデンクローナ 小計	2,723,117		450,200,063.84 (5,722,042,811)		
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	76,370	217.30	16,595,201.00	
	NORSK HYDRO	96,800	64.92	6,284,256.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,408	432.60	7,098,100.80	
	ADEVINTA ASA	19,117	148.15	2,832,183.55	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,274	368.00	3,412,832.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	7,082	415.80	2,944,695.60	

	MOWI ASA	31,968	229.00	7,320,672.00
	ORKLA	69,804	78.80	5,500,555.20
	DNB BANK ASA	71,795	197.35	14,168,743.25
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	193.25	3,589,425.50
	TELENOR ASA	51,193	146.30	7,489,535.90
	ノルウェークローネ 小計	468,385		77,236,200.80 (987,078,646)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	535.20	4,540,101.60
	NOVOZYMES A/S	17,111	449.00	7,682,839.00
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	755	2,750.00	2,076,250.00
	VESTAS WIND SYSSEMS A/S	81,654	266.30	21,744,460.20
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	17,520.00	5,238,480.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	514	18,465.00	9,491,010.00
	DSV A/S	16,380	1,528.50	25,036,830.00
	PANDORA A/S	8,163	789.80	6,447,137.40
	CARLSBERG AS-B	8,646	1,045.00	9,035,070.00
	AMBU A/S-B	13,555	196.30	2,660,846.50
	COLOPLAST-B	9,208	1,008.00	9,281,664.00
	DEMANT A/S	8,512	325.30	2,768,953.60
	GN STORE NORD A/S	9,226	447.50	4,128,635.00
	GENMAB A/S	5,250	2,725.00	14,306,250.00
	NOVO NORDISK A/S-B	138,589	613.20	84,982,774.80
	DANSKE BANK A/S	56,132	108.00	6,062,256.00
TRYG A/S	29,772	144.90	4,313,962.80	
ORSTED A/S	15,439	871.80	13,459,720.20	
	デンマーククローネ 小計	427,688		233,257,241.10 (4,072,671,429)
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	27.31	563,377.99
	OIL SEARCH LTD	186,117	4.31	802,164.27
	SANTOS	156,437	7.03	1,099,752.11
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	38.27	490,353.51
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,404	23.50	1,748,494.00
	BHP GROUP LTD	245,638	36.39	8,938,766.82
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	20.14	700,267.80
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	3.48	425,095.92
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,483	14.80	2,049,548.40
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	49.76	1,838,532.48
	NEWCREST MINING LIMITED	74,098	22.63	1,676,837.74
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	8.50	863,838.00
	ORICA LTD	38,288	12.04	460,987.52
	RIO TINTO LTD	32,028	96.89	3,103,192.92
SOUTH32 LTD	341,133	3.39	1,156,440.87	

REECE LTD	16,814	18.20	306,014.80	
BRAMBLES LTD	108,007	10.64	1,149,194.48	
AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	3.70	708,516.70	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.54	470,900.00	
TRANSURBAN GROUP	233,493	13.71	3,201,189.03	
TRANSURBAN GROUP-RTS	25,943	0.65	16,992.66	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	44,067	46.20	2,035,895.40	
CROWN RESORTS LTD	30,328	9.42	285,689.76	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	154.30	546,376.30	
TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	4.82	877,302.66	
REA GROUP LTD	5,276	159.35	840,730.60	
SEEK LTD	31,593	31.00	979,383.00	
WESFARMERS LTD	92,850	55.31	5,135,533.50	
COLES GROUP LTD	115,478	16.63	1,920,399.14	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	6.83	750,623.83	
WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	38.28	3,824,210.28	
TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	11.90	839,402.20	
COCHLEAR LIMITED	4,783	218.99	1,047,429.17	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	68.00	1,104,864.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	40,076	39.34	1,576,589.84	
CSL LIMITED	36,928	286.86	10,593,166.08	
AUST AND NZ BANKING GROUP	239,681	27.49	6,588,830.69	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	148,199	102.62	15,208,181.38	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	278,638	27.24	7,590,099.12	
WESTPAC BANKING	302,673	25.17	7,618,279.41	
ASX LTD	14,549	80.89	1,176,868.61	
MACQUARIE GROUP LIMITED	27,074	177.97	4,818,359.78	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	35.70	389,558.40	
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	229,407	4.90	1,124,094.30	
MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	3.52	949,907.20	
QBE INSURANCE GROUP	111,591	11.43	1,275,485.13	
SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	12.45	1,485,957.30	
AFTERPAY LTD	19,441	121.93	2,370,441.13	
COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	18.13	804,536.88	
WISETECH GLOBAL LTD	13,801	52.15	719,722.15	
XERO LTD	11,340	137.85	1,563,219.00	
TELSTRA CORP	308,467	3.90	1,203,021.30	
AGL ENERGY LTD	64,235	5.87	377,059.45	
AUSNET SERVICES	187,145	2.56	479,091.20	
ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	4.72	781,608.40	
オーストラリアドル 小計	5,726,175		120,652,374.61 (9,707,690,061)	

ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.68	905,838.63
	A2 MILK CO LTD	66,854	6.17	412,489.18
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	31.24	1,248,975.20
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	14.58	529,501.86
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.73	819,713.73
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.36	410,938.68
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.98	550,509.12
ニュージーランドドル 小計		609,297		4,877,966.40 (375,359,514)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	229,496	52.05	11,945,266.80
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	117,500	155.30	18,247,750.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	24.00	4,128,000.00
	MTR CORP	125,000	42.10	5,262,500.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	29.15	3,498,000.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	39.30	6,838,200.00
	SANDS CHINA LTD	198,000	15.80	3,128,400.00
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	5.32	702,240.00
	WYNN MACAU LTD	140,800	6.54	920,832.00
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	15.20	2,617,440.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	19.82	2,891,738.00
	WH GROUP LTD	809,301	5.58	4,515,899.58
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	23.45	6,601,175.00
	HANG SENG BANK	59,400	135.00	8,019,000.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	101,400	474.80	48,144,720.00
	AIA GROUP LTD	986,800	89.05	87,874,540.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	45.50	7,484,568.00
	ESR CAYMAN LTD	157,000	23.40	3,673,800.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	17.96	3,107,080.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	30.20	3,781,885.60
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	32.05	4,370,818.75
	SINO LAND CO	315,400	10.54	3,324,316.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	98.40	10,627,200.00
	SWIRE PACIFIC A	40,500	45.45	1,840,725.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	19.72	1,897,064.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	157,000	39.00	6,123,000.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	44.00	2,970,000.00
CLP HOLDINGS	137,500	75.25	10,346,875.00	
HONG KONG & CHINA GAS	904,657	11.82	10,693,045.74	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	45.80	5,129,600.00	
香港ドル 小計		6,660,153		290,705,679.47 (4,180,347,670)
	KEPPEL CORP LTD	137,300	5.22	716,706.00

シンガポールドル	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.79	558,646.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.03	544,909.96	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.72	442,800.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.14	739,404.00	
	DBS GROUP	141,500	30.11	4,260,565.00	
	OCBC BANK	257,100	11.46	2,946,366.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	25.59	2,402,901.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	9.91	775,953.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.52	786,720.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.92	296,176.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.85	325,375.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	17.97	461,829.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	584,543	2.47	1,443,821.21	
シンガポールドル 小計		2,681,475		16,702,172.17 (1,372,918,552)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	24.39	1,652,568.84	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	468.20	1,004,757.20	
	BANK HAPOLIM BM	98,310	28.33	2,785,122.30	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,864	27.27	2,968,721.28	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	17.23	1,714,385.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	108.20	1,352,824.60	
	AZRIELI GROUP	4,323	295.60	1,277,878.80	
	NICE LTD	5,891	901.30	5,309,558.30	
イスラエルシェケル 小計		399,293		18,065,816.32 (627,924,417)	
合 計		90,726,138		491,298,241,864 (491,298,241,864)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	114,413	981,663.54	
		LENDLEASE GROUP	64,786	688,027.32	
		SYDNEY AIRPORT	124,551	1,021,318.20	
	オーストラリアドル 小計		303,750	2,691,009.06 (216,518,588)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,689,030.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,005,000.00	
	香港ドル 小計		595,500	5,694,030.00 (81,880,151)	
	投資信託受益証券合計			899,250	298,398,739 (298,398,739)

投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	738,772.20	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,971	2,115,647.64	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,461	10,114,844.61	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,062,772.96	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,549,700.00	
		BOSTON PROPERTIES	13,029	1,449,085.38	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	1,163,047.41	
		CROWN CASTLE INTL CORP	35,499	6,239,659.23	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,924	3,511,086.24	
		DUKE REALTY CORP	31,540	1,533,474.80	
		EQUINIX INC	7,500	6,011,850.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	1,119,027.80	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29,400	2,397,570.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,510	1,784,854.30	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,869,404.68	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,539,462.65	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	945,838.18	
		INVITATION HOMES INC	46,840	1,824,418.00	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,033,575.06	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	1,034,744.48	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,603	1,824,089.85	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	636,535.71	
		PROLOGIS INC	60,840	7,692,609.60	
		PUBLIC STORAGE	13,171	3,981,856.72	
		REALTY INCOME CORP	31,608	2,087,708.40	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	858,880.15	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	9,113	3,032,624.14	
		SIMON PROPERTY GROUP	26,818	3,589,589.30	
		SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,712,650.45	
		UDR INC	24,265	1,298,905.45	
		VENTAS INC	31,565	1,780,581.65	
		VEREIT INC	17,894	819,903.08	
		VICI PROPERTIES INC	43,921	1,267,999.27	
VORNADO REALTY TRUST	15,390	664,386.30			
WELLTOWER INC	35,679	2,989,543.41			
WP CAREY INC	14,258	1,054,379.10			
	アメリカドル 小計	1,009,388	85,331,078.20	(9,550,254,272)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	527,532.32		
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	336,752.60		
	カナダドル 小計	24,377	864,284.92	(75,892,858)	

ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	365,004.72
	GECINA SA	4,459	529,506.25
	KLEPIERRE	17,225	338,729.62
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	685,534.35
ユーロ 小計		37,101	1,918,774.94 (249,172,113)
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	403,581.94
	LAND SECURITIES GROUP PLC	66,349	467,362.35
	SEGRO PLC	93,383	1,126,198.98
イギリスポンド 小計		239,146	1,997,143.27 (300,430,262)
オーストラ リアドル	DEXUS	94,090	1,005,822.10
	GOODMAN GROUP	139,848	2,973,168.48
	GPT GROUP	167,884	841,098.84
	MIRVAC GROUP	266,683	784,048.02
	SCENTRE GROUP	486,663	1,430,789.22
	STOCKLAND	207,412	922,983.40
	VICINITY CENTERS	365,149	600,670.10
オーストラリアドル 小計		1,727,729	8,558,580.16 (688,623,359)
香港ドル	LINK REIT	170,500	11,125,125.00
香港ドル 小計		170,500	11,125,125.00 (159,979,297)
シンガポ ールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	858,096.76
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	461,129	940,703.16
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	455,400.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	273,085	554,362.55
シンガポールドル 小計		1,238,352	2,808,562.47 (230,863,835)
投資証券合計		4,446,593	11,255,215,996 (11,255,215,996)
合計			11,553,614,735 (11,553,614,735)

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 599銘柄	97.4%			71.3%
	投資証券 36銘柄			2.6%	1.9%
カナダドル	株式 89銘柄	99.6%			3.4%
	投資証券 2銘柄			0.4%	0.0%
ユーロ	株式 233銘柄	99.5%			10.3%
	投資証券 4銘柄			0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 83銘柄	98.7%			4.4%
	投資証券 3銘柄			1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.0%			2.9%
スウェーデンクローナ	株式 41銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式 11銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式 55銘柄	91.5%			1.9%
	投資信託受益証券 3銘柄		2.0%		0.0%
	投資証券 7銘柄			6.5%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 30銘柄	94.5%			0.8%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.6%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	85.6%			0.3%
	投資証券 4銘柄			14.4%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

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

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、第21期中間計算期間(2021年10月1日から2022年3月31日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【DC外国株式インデックス・オープン】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第20期 (2021年 9月30日現在)	第21期中間計算期間 (2022年 3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	356,065,393	347,956,460
親投資信託受益証券	44,415,581,004	52,571,116,620
未収入金	-	22,626,004
流動資産合計	44,771,646,397	52,941,699,084
負債の部		
流動負債		
未払解約金	146,679,642	132,572,709
未払受託者報酬	13,916,170	15,802,946
未払委託者報酬	171,632,647	194,902,995
未払利息	865	339
その他未払費用	1,681,160	872,027
流動負債合計	333,910,484	344,151,016
負債合計	333,910,484	344,151,016
純資産の部		
元本等		
元本	10,785,380,186	11,275,375,825
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	33,652,355,727	41,322,172,243
(分配準備積立金)	13,838,330,132	12,352,414,387
元本等合計	44,437,735,913	52,597,548,068
純資産合計	44,437,735,913	52,597,548,068
負債純資産合計	44,771,646,397	52,941,699,084

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第20期中間計算期間 自 2020年10月 1日 至 2021年 3月31日	第21期中間計算期間 自 2021年10月 1日 至 2022年 3月31日
営業収益		
受取利息	501	853
有価証券売買等損益	7,387,648,180	6,200,869,992
営業収益合計	7,387,648,681	6,200,870,845
営業費用		
支払利息	21,693	38,533
受託者報酬	10,562,706	15,802,946
委託者報酬	130,273,273	194,902,995
その他費用	820,790	872,027
営業費用合計	141,678,462	211,616,501
営業利益又は営業損失（ ）	7,245,970,219	5,989,254,344
経常利益又は経常損失（ ）	7,245,970,219	5,989,254,344
中間純利益又は中間純損失（ ）	7,245,970,219	5,989,254,344
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	393,019,236	229,683,067
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	18,709,411,654	33,652,355,727
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,393,963,922	5,845,235,954
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,393,963,922	5,845,235,954
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,531,444,231	3,934,990,715
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,531,444,231	3,934,990,715
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	27,424,882,328	41,322,172,243

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

(中間貸借対照表に関する注記)

	第20期 (2021年 9月30日現在)	第21期中間計算期間 (2022年 3月31日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	10,785,380,186口	11,275,375,825口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 4.1202円 (41,202円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 4.6648円 (46,648円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第21期中間計算期間 (2022年 3月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価と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 「(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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第20期	第21期中間計算期間
	自 2020年10月 1日 至 2021年 9月30日	自 2021年10月 1日 至 2022年 3月31日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	9,378,961,040円	10,785,380,186円
期中追加設定元本額	3,776,870,397円	1,743,920,506円
期中一部解約元本額	2,370,451,251円	1,253,924,867円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見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

項目	2022年 3月31日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	12,801,869,444
コール・ローン	391,251,191
株式	524,606,925,605
投資信託受益証券	208,990,429
投資証券	12,606,689,846
派生商品評価勘定	1,089,053,253
未収入金	4,350,741
未収配当金	730,390,437
差入委託証拠金	2,646,092,071
流動資産合計	555,085,613,017

	2022年 3月31日現在
項目	金額（円）
資産合計	555,085,613,017
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,184
前受金	1,089,009,966
未払解約金	254,916,577
未払利息	382
流動負債合計	1,343,929,109
負債合計	1,343,929,109
純資産の部	
元本等	
元本	124,518,911,903
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	429,222,772,005
元本等合計	553,741,683,908
純資産合計	553,741,683,908
負債純資産合計	555,085,613,017

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 3月31日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

2022年 3月31日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2022年 3月31日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	124,518,911,903口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産 の額	1口当たり純資産額 4.4470円 (1万口当たり純資産額) (44,470円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2022年 3月31日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(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 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2022年 3月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年10月 1日
期首元本額	132,221,776,468円
期中追加設定元本額	7,213,692,127円
期中一部解約元本額	14,916,556,692円
期末元本額	124,518,911,903円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,886,510,233円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,148,332円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	31,162,461,042円

区分	2022年 3月31日現在
世界経済インデックスファンド	10,099,663,442円
外国株式インデックス・オープン	865,287,008円
DCマイセレクション25	827,345,608円
DCマイセレクション50	3,607,070,972円
DCマイセレクション75	4,391,452,376円
DC外国株式インデックス・オープン	11,821,703,760円
DCマイセレクションS25	399,488,432円
DCマイセレクションS50	1,825,233,718円
DCマイセレクションS75	1,551,653,435円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	45,599,625円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	160,966,794円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	117,201,266円
DC世界経済インデックスファンド	9,585,800,215円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,499,956,601円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	3,828,753円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	5,004,952円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	29,953,713円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	15,432,161円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	52,688,817円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	11,849,129円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	35,082,386円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	298,499,770円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	181,729,693円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,327,907,432円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	145,878,711円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	36,366,014円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	171,203,708円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	60,019,266円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,070,240,865円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,174,381,431円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,098,412,400円
コア投資戦略ファンド（安定型）	627,085,146円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,422,871,340円
分散投資コア戦略ファンドA	1,459,650,384円
分散投資コア戦略ファンドS	8,191,074,649円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,257,105,064円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,076,132,620円
コア投資戦略ファンド（切替型）	459,934,007円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	601,704,577円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,200,175円
SMT インデックスバランス・オープン	158,640,557円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	398,523,389円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	16,083,024,063円

区分	2022年 3月31日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン	184,363,802円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	696,129,388円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	132,757,241円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	3,985,680円
i - S M T グローバル株式インデックス（ノーロード）	157,133,980円
グローバル経済コア	637,021,180円
S B I資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	12,922,651円
D Cターゲット・イヤーフンド2055	5,049,523円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	283,162,252円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	65,769,583円
D Cターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	24,374,695円
D Cターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	23,115,509円
D Cターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	8,733,343円
D Cターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	11,862,443円
F O F s用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	300,531,303円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	348,492,414円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,025,171,367円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,148,190,451円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	209,520,766円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	121,952,881円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	48,779,071円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	80,489,222円
S M T A M海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	248,911,281円
S M T A M海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	260,033,035円
S M T A M海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	252,448,023円
S M T A M海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	250,931,421円
S M T A M海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	239,889,089円
S M T A M海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	236,166,458円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	162,055,820円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 3月31日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	14,768,967,623	-	15,857,977,589	1,089,009,966
	合計	14,768,967,623	-	15,857,977,589	1,089,009,966

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2022年 3月31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	248,478,400	-	248,437,297	41,103
	アメリカドル	248,478,400	-	248,437,297	41,103
	合計	248,478,400	-	248,437,297	41,103

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【DC外国株式インデックス・オープン】

【純資産額計算書】

(2022年 4月28日現在)

資産総額	50,650,994,158円
負債総額	154,711,426円
純資産総額（ - ）	50,496,282,732円
発行済口数	11,316,009,501口
1口当たり純資産額（ / ）	4.4624円
（1万口当たり純資産額）	（44,624円）

(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

(2022年 4月28日現在)

資産総額	526,415,959,002円
負債総額	2,051,626,960円
純資産総額（ - ）	524,364,332,042円
発行済口数	123,181,528,169口
1口当たり純資産額（ / ）	4.2568円
（1万口当たり純資産額）	（42,568円）

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。

(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

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り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り消された場合又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、振替受益権を表示する受益証券を発行し

ません。

受益権の譲渡

- イ．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又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．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及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又は記録するものとします。ただし、上記イ．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。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。
- ハ．上記イ．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又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又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。

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又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。

質権口記載又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又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従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（2022年 4月28日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

会社が取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。

取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。

また、監査等委員以外取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部に

において、ファンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定します。

[D0（実行）]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

[CHECK（検証・評価）]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立した運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - D0 - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2022年 6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

2022年4月28日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	545	14,288,273
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	72	235,344
単位型公社債投資信託	51	236,285
合計	668	14,759,902

3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」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。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「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）により作成しております。

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第35期事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第36期事業年度の中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	24,869	21,589
金銭の信託	5,823	10,857
前払費用	348	397
未収委託者報酬	7,284	8,471
未収運用受託報酬	5,842	6,151
未収収益	190	177
その他	4,624	3,428
流動資産合計	48,983	51,072
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 256	1 301
器具備品	1 576	1 692
その他	1 0	1 0
有形固定資産合計	832	993
無形固定資産		
ソフトウェア	3,030	4,104
その他	40	41
無形固定資産合計	3,070	4,145
投資その他の資産		
投資有価証券	8,469	9,950
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	700	311
その他	35	39
投資その他の資産合計	14,842	15,937
固定資産合計	18,745	21,077
資産合計	67,729	72,149

（単位：百万円）

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	38	44
未払金	7,988	7,572
未払収益分配金	0	0
未払手数料	3,355	4,154
その他未払金	4,632	3,417
未払費用	204	1,046
未払法人税等	897	517
賞与引当金	324	556
その他	1,070	818
流動負債合計	10,524	10,555
固定負債		
退職給付引当金	600	626
資産除去債務	132	133
その他	7	8
固定負債合計	740	768
負債合計	11,264	11,324
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	305	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	35,122	38,258
利益剰余金合計	37,528	40,858
株主資本合計	56,767	60,098
評価・換算差額等		
金		
その他有価証券評価差額	587	791
繰延ヘッジ損益	284	65
評価・換算差額等合計	302	726
純資産合計	56,464	60,824
負債・純資産合計	67,729	72,149

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	34,967	37,224
運用受託報酬	11,091	10,982
その他営業収益	500	403
営業収益合計	46,559	48,611
営業費用		
支払手数料	15,998	17,936
広告宣伝費	331	203
公告費	0	-
調査費	5,018	5,064
調査費	788	898
委託調査費	4,217	4,154
図書費	11	11
営業雑経費	3,434	4,492
通信費	52	56
印刷費	470	449
協会費	53	58
諸会費	16	18
情報機器関連費	2,726	3,815
その他営業雑経費	114	93
営業費用合計	24,783	27,696
一般管理費		
給料	5,756	5,976
役員報酬	244	214
給料・手当	4,962	4,861
賞与	549	901
退職給付費用	118	170
福利費	535	608
交際費	14	1
旅費交通費	190	13
租税公課	344	315
不動産賃借料	269	276
寄付金	7	3
減価償却費	334	748
業務委託費	864	966
諸経費	750	848
一般管理費合計	9,185	9,929
営業利益	12,589	10,984

（単位：百万円）

	前事業年度 （自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）	当事業年度 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）
営業外収益		
受取利息	15	2
収益分配金	119	101
金銭の信託運用益	-	3,038
投資有価証券売却益	483	1
投資有価証券償還益	316	54
為替差益	273	-
デリバティブ利益	666	-
その他	30	45
営業外収益合計	1,906	3,243
営業外費用		
金銭の信託運用損	1,076	-
投資有価証券売却損	4	0
投資有価証券償還損	19	0
為替差損	-	158
デリバティブ費用	-	3,782
その他	19	5
営業外費用合計	1,118	3,946
経常利益	13,377	10,281
特別損失		
システム統合費用	149	110
特別損失合計	149	110
税引前当期純利益	13,227	10,170
法人税、住民税及び事業税	4,263	3,242
法人税等調整額	193	65
法人税等合計	4,070	3,177
当期純利益	9,157	6,993

（3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金				
	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	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	-	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	393	133	526	50,442
当期変動額				
剰余金の配当				2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	980	151	829	829
当期変動額合計	980	151	829	6,022
当期末残高	587	284	302	56,464

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金				
	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	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					

剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	-	3,136	3,330	3,330
当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	587	284	302	56,464
当期変動額				
剰余金の配当				3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,379	349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	349	1,029	4,360
当期末残高	791	65	726	60,824

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

移動平均法による原価法によっております。

(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によっております。（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しております。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

5. 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、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

6. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。

7. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 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

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「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」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
建物	77	百万円	106	百万円
器具備品	285	"	391	"
その他	4	"	4	"
計	367	"	503	"

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

4. 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

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	利益剰余金	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

4. 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

2021年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	利益剰余金	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（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

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの

軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針7.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
（1）現金及び預金	24,869	24,869	-
（2）金銭の信託	5,823	5,823	-
（3）未収委託者報酬	7,284	7,284	-
（4）未収運用受託報酬	5,842	5,842	-
（5）投資有価証券 その他有価証券	8,469	8,469	-
（6）未払金	(7,988)	(7,988)	-
（7）デリバティブ取引（*2）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	6	6	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(114)	(114)	-
デリバティブ取引計	(107)	(107)	-

（*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（*2）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
（1）現金及び預金	21,589	21,589	-
（2）金銭の信託	10,857	10,857	-
（3）未収委託者報酬	8,471	8,471	-
（4）未収運用受託報酬	6,151	6,151	-
（5）投資有価証券 その他有価証券	9,950	9,950	-

(6) 未払金	(7,572)	(7,572)	-
(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(357)	(357)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)	(73)	-
デリバティブ取引計	(431)	(431)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金

現金及び預金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) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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。

(5) 投資有価証券 その他有価証券

投資有価証券の時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(6) 未払金

未払金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。

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(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の貸借対照表計上額

(単位:百万円)

区分	前事業年度 2020年3月31日	当事業年度 2021年3月31日
非上場株式	0	0

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、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 その他有価証券」には含めておりません。

(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

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	24,869	-	-	-
未収委託者報酬	7,284	-	-	-
未収運用受託報酬	5,842	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	9	5,605	-

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,589	-	-	-
未収委託者報酬	8,471	-	-	-
未収運用受託報酬	6,151	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	10	5,751	0

（有価証券関係）

1. 子会社株式

前事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

当事業年度（2021年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	891	806	84
小計	891	806	84
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	7,578	8,509	931
小計	7,578	8,509	931
合計	8,469	9,316	846

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			

その他	9	10	1
小計	9	10	1
合計	9,950	8,809	1,141

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額0百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
109	1	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2020年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	1,443	-	23	23
	英ポンド	79	-	1	1
	カナダドル	15	-	0	0
	スイスフラン	26	-	0	0
	香港ドル	247	-	4	4
	人民元	18	-	0	0
	ユーロ	223	-	2	2
合計		2,055	-	32	32

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	8,412	-	358	358
合計		8,412	-	358	358

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		2,819	-	44
	英ポンド		2,660	-	67
	カナダドル		6	-	0
	スイスフラン		35	-	0
	香港ドル		71	-	1
	ユーロ		72	-	0
	合計		5,666	-	114

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2021年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

	種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	2,889	-	41	41
	英ポンド	128	-	0	0
	カナダドル	21	-	0	0
	スイスフラン	51	-	0	0
	香港ドル	128	-	1	1
	ユーロ	246	-	0	0
	買建				
	米ドル	99	-	1	1
	香港ドル	2	-	0	0
	合計	3,567	-	41	41

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

	種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	13,711	-	315	315
	合計	13,711	-	315	315

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 子会社株式				
	米ドル		3,993	-	57	
	英ポンド		3,108	-	15	
	カナダドル		3	-	0	
	スイスフラン		57	-	0	
	香港ドル		110	-	1	
	ユーロ		108	-	0	
	人民元		6	-	0	
	買建					
	米ドル		38	-	0	
	香港ドル		3	-	0	
	人民元		1	-	0	
	合計		7,431	-	73	

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(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退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。当社が有する退職一時金制度は簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

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

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	537	600
退職給付費用	74	77
転籍者受入	-	18
退職給付の支払額	11	69
退職給付債務の期末残高	600	626

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

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626
退職給付引当金	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度74百万円 当事業年度77百万円

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44百万円、当事業年度92百万円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

（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

	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	168	百万円	107	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	99	"	170	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	183	"	191	"
税務上の収益認識差額	-	"	71	"
有価証券評価差額	259	"	-	"
繰延ヘッジ損益	-	"	28	"
その他	151	"	123	"
繰延税金資産 合計	862	"	693	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	-	"	349	"
繰延ヘッジ損益	125	"	-	"
その他	35	"	32	"
繰延税金負債 合計	161	"	382	"
繰延税金資産の純額	700	"	311	"

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

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間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は資産運用に関する事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]

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

内国籍投資信託又は本邦顧客から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) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,649百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*1)	6,372百万円

(*1)当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載してあります。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	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（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容又は職業	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 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,365	未収運用受託報酬	5,402
							投信販売代行手数料等	9,124	未払手数料	1,888

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2020年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2021年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	18,821,541円72銭	20,274,967円09銭
1株当たり当期純利益金額	3,052,463円23銭	2,331,221円85銭

(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。

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第36期中間会計期間末

(2021年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金	18,523
金銭の信託	15,986
未収委託者報酬	9,080
未収運用受託報酬	6,066

その他		5,520
流動資産合計		55,177
固定資産		
有形固定資産	1	1,024
無形固定資産		5,276
投資その他の資産		
投資有価証券		6,629
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		208
その他		37
投資その他の資産合計		12,511
固定資産合計		18,813
資産合計		73,990
負債の部		
流動負債		
未払金		8,383
未払法人税等		474
賞与引当金		302
その他	2	1,946
流動負債合計		11,106
固定負債		
退職給付引当金		781
資産除去債務		153
その他		10
固定負債合計		945
負債合計		12,051

(単位：百万円)

第36期中間会計期間末

(2021年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		17,239
資本剰余金合計		17,239
利益剰余金		
利益準備金		500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100
繰越利益剰余金		39,182
利益剰余金合計		41,782
株主資本合計		61,022
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		995
繰延ヘッジ損益		78

評価・換算差額等合計	916
純資産合計	61,938
負債・純資産合計	73,990

中間損益計算書

(単位：百万円)

第36期中間会計期間		
(自 2021年4月1日		
至 2021年9月30日)		
営業収益		
委託者報酬		20,978
運用受託報酬		5,746
その他営業収益		201
営業収益合計		26,925
営業費用		15,801
一般管理費	1	5,504
営業利益		5,620
営業外収益	2	971
営業外費用	3	1,067
経常利益		5,525
特別損失		120
税引前中間純利益		5,404
法人税、住民税及び事業税		1,663
法人税等調整額		19
法人税等合計		1,683
中間純利益		3,721

中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 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	500	2,100	38,258	40,858	60,098

当中間期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
中間純利益			3,721	3,721	3,721
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	923	923	923
当中間期末残高	500	2,100	39,182	41,782	61,022

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	791	65	726	60,824
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,797
中間純利益				3,721
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	203	13	190	190
当中間期変動額合計	203	13	190	1,114
当中間期末残高	995	78	916	61,938

重要な会計方針

第36期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
<p>1. 資産の評価基準及び評価方法</p> <p>有価証券</p> <p> 子会社株式 移動平均法による原価法によっております。</p> <p> その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法によっております。 （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しております。）</p> <p> 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法によっております。</p> <p>2. デリバティブの評価基準及び評価方法 時価法によっております。</p> <p>3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 時価法によっております。</p> <p>4. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産 定額法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 ただし、ソフトウェア（自社利用分）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</p>

によっております。

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間会計期間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計上しております。

6. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

数理計算上の差異 : 各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当中間会計期末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

7. 収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(2) 投資一任業務

当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(3) 投資助言業務

当社は、投資顧問（助言）契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(4) 成功報酬

当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

8. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は子会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 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

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「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」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

（会計方針の変更）

第36期中間会計期間

（自 2021年4月1日

至 2021年9月30日）

1. 「収益認識に関する会計基準」の適用

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。この変更が中間財務諸表に与える影響はありません。

2. 「時価の算定に関する会計基準」の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。この変更が中間財務諸表に与える影響はありません。

（追加情報）

第36期中間会計期間

（自 2021年4月1日

至 2021年9月30日）

退職給付債務及び費用の算定方法の変更

従来、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末の自己都合要支給額を退職給付とする方法を用いた簡便法を適用しておりましたが、対象となる従業員数の増加に伴い、当中間会計期間より原則法による計算を併用しております。これにより、退職給付引当金が120百万円増加し、同額を退職給付費用として特別損失に計上しております。

なお、退職給付見込額の各期間への帰属方法などについては、重要な会計方針 6. 引当金の計上基準（2）退職給付引当金をご参照ください。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第36期中間会計期間末

（2021年9月30日）

1 有形固定資産の減価償却累計額 591百万円

2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

第36期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	90百万円
無形固定資産	376百万円
2 営業外収益の主要項目	
金銭の信託運用益	738百万円
投資有価証券償還益	219百万円
3 営業外費用の主要項目	
デリバティブ費用	1,012百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第36期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	3,000	-	-	3,000

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

(金融商品関係)

第36期中間会計期間末(2021年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市場価格のない非上場株式及び「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 2019年7月4日)第26項に従い経過措置を適用した投資信託は、次表には含まれておりません。

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

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先度が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

区分	中間貸借対照表計上額(百万円)(*1、*2)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計

金銭の信託(*3)	1,051	1,296	-	2,347
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	242	(103)	-	138
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(79)	-	(79)
デリバティブ取引計	242	(183)	-	58

(*1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2)投資有価証券は当社が直接保有する投資信託であり、上記に含めておりません。当該投資有価証券の中間貸借対照表計上額は6,629百万円であります。

(*3)金銭の信託の信託財産のうち、投資信託は上記に含めておりません。投資信託（中間貸借対照表計上額13,639百万円）も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は15,986百万円であります。

(*4)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場有価証券は市場価格を用いて評価しております。当該有価証券は活発な市場で取引されているため、その時価をレベル1の時価に分類しております。また、金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない非上場株式の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
子会社株式	5,636

(有価証券関係)

第36期中間会計期間末（2021年9月30日）

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額

貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	5,034	3,583	1,451
小計	5,034	3,583	1,451
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,595	1,611	16
小計	1,595	1,611	16
合計	6,629	5,195	1,434

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額0百万円）は、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	4,614	-	98	98
	英ポンド	260	-	1	1
	カナダドル	81	-	1	1
	スイスフラン	98	-	0	0
	香港ドル	177	-	3	3
	ユーロ	497	-	1	1
合計		5,729	-	103	103

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	19,350	-	242	242
合計		19,350	-	242	242

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		4,438	-	94
	英ポンド		3,125	-	17
	カナダドル		4	-	0
	スイスフラン		78	-	0
	香港ドル		120	-	2
	ユーロ		115	-	0
	人民元		16	-	0
合計		7,900	-	79	

（収益認識関係）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針7．収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末にお

いて存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

当社は資産運用に関する事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36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,205百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド（*）	3,454百万円

（*）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載して
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）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第36期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）	
1株当たり純資産額	20,646,304円65銭
1株当たり中間純利益	1,240,458円75銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第36期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）
中間純利益	3,721百万円
普通株式に係る中間純利益	3,721百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

自己又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、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2)運用財産相互間の取引

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、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3)通常取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)又は子法人等(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又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又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、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2022年6月30日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

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：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円(2021年3月末日現在)

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額(百万円) (2021年3月末日現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社北海道銀行	93,524	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社三井住友銀行	1,770,996	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社福岡銀行	82,329	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

株式会社みずほ銀行	1,404,065	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
-----------	-----------	--------------------

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2021年3月末日現在）

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、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。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。また、これらの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を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2021年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 藤 澤 孝 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 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、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第35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、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021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及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じ

て、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記は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、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年11月30日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC外国株式インデックス・オープンの2020年10月1日から2021年9月30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、DC外国株式インデックス・オープンの2021年9月30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、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

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、継続企業的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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は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、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 藤 澤 孝

中間監査意見

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井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間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中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた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中間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、継続企業的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。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。
- ・中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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

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

以 上

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年6月13日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

中間監査意見

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DC外国株式インデックス・オープンの2021年10月1日から2022年3月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DC外国株式インデックス・オープンの2022年3月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年10月1日から2022年3月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間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中間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中間財務諸表の作成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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた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中間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、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。
- ・ 中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を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、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。