

## 【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8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】	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】

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（１）に追加設定時信託財産留保額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額の0.1%）（２）を加えた価額（販売基準価額）とします。

- 1「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。
- 2「信託財産留保額」とは、当初設定日以降の買付又は信託期間終了前の解約に際し、取得申込者又は解約者にご負担いただいて投資信託財産に繰り入れる金額のことをいいます。追加設定又は解約に対応して投資信託財産で有益証券等の取引を行う場合には、売買委託手数料等のコストが発生するほか、組入有益証券等の市場価格が変動するリスクを負うことになります。信託財産留保額は、こうしたコストの負担について、受益権を継続して保有される受益者との公平性を図る目的で導入されています。

### （５）【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の販売基準価額に、1.1%（税抜 1.0%）（ ）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

申込手数料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「（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。

「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。

**（ 6 ） 【 申込単位 】**

販売会社が定める単位とします。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「(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。

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に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）で再投資する場合は1口単位です。

**（ 7 ） 【 申込期間 】**

2022年 8月31日から2023年 2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ます。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ます。

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 >

「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に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）の2つの申込方法があります。

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、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。

< 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なら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の休業日

ロンドンの銀行の休業日

## 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】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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。

## &lt;信託金限度額&gt;

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。

## &lt;基本的性格&gt;

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
一般		(日本を除く)	ファンド	( )		型
大型株	年2回				TOPIX	
中小型株			ファンド・	なし		条件付運用
	年4回	日本	オブ・ファンズ		その他	型
債券					(MSCIコクサ	
一般	年6回	北米			イ・インデッ	ロング・
公債	(隔月)				クス(円ベー	ショート型/
社債		欧州			ス))	絶対収益追
その他債券	年12回					求型
クレジット属性	(毎月)	アジア				
( )						その他
	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))						
		中近東				
資産複合		(中東)				
( )						
資産配分		エマージン				
固定型		グ				
資産配分						
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。

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 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

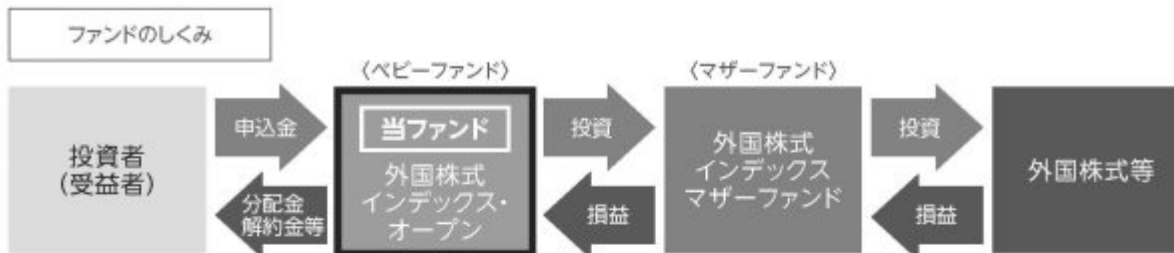
投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。

- (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ペピーファンドとし、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。

### マザーファンドの投資プロセス



※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

インデックスの概要 (2022年6月末現在)		地域別構成比		
国・地域	22ヵ国・地域		北米(77.0%)	米国/カナダ
構成銘柄数	1,275銘柄		欧州(19.0%)	英国/スイス/スウェーデン/デンマーク ノルウェー/ドイツ/フランス/オランダ ベルギー/オーストリア/イタリア/ポルトガル スペイン/フィンランド/アイルランド
時価総額	約6,299兆円		アジア・オセアニア (3.8%)	オーストラリア/香港/ニュージーランド シンガポール
			中東(0.2%)	イスラエル

(出所) MSCI社のデータをもとに三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※時価総額は当該日の為替データをもとに三井住友トラスト・アセットマネジメントが円換算しています。

※地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。

※「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。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5月29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及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。

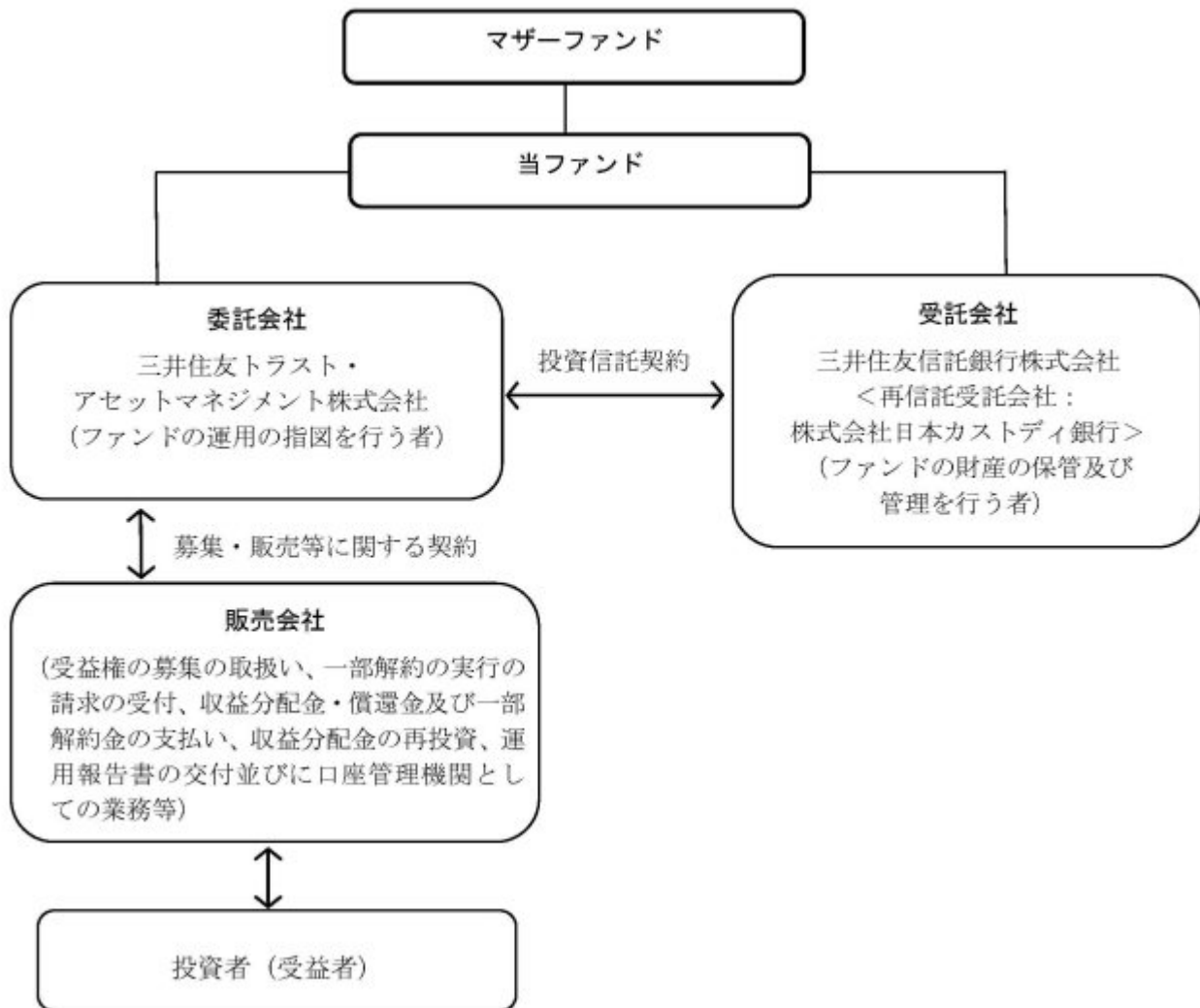
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

### (2) 【ファンドの沿革】

2000年5月30日	当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	当ファンドの名称を「すみしん 外国株式インデックス・オープン」から「外国株式インデックス・オープン」に変更 当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 6月30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】

### 基本方針

当ファンドは、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。

### 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。）受益証券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、外国株式インデックス 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)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及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、及び通貨に係る選択権取引並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、及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並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並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】

### 有価証券の指図範囲

委託会社は、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外国株式インデックス マザーファンドの受益証券並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.株券又は新株引受権証書
- 2.国債証券
- 3.地方債証券
- 4.特別の法律により法人の発行する債券
- 5.社債券（新株引受権証券と社債券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又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。）及び新株予約権証券
12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの
13. 証券投資信託又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. 投資証券又は外国投資証券（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又は証書（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号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又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号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券及び第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

イ. 委託会社は、信託金を、上記 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

ロ. 上記 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ. 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（円ベース）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及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、及び通貨に係る選択権取引並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、及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並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。

新株引受権証券及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、並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号及び第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及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及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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしがた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、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及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】

年1回の毎決算時（決算日は毎年5月29日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。

##### ・分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益（繰越分及びマザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち、投資信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）及び売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。

##### ・分配対象額についての分配方針

委託会社が、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額

が少額の場合は、分配を行わないことがあります。

・ 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、委託会社の判断に基づき、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。

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券及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。

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。

同一銘柄の転換社債並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。

同一銘柄の新株引受権証券及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。

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及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号ロ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て、ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及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、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

委託会社は、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、株券の引渡し又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。

1. 投資信託財産に属する株券及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及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及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及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

委託会社は、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、並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。）及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。）並びに外国の取引所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、委託会社は、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、並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及びオプション取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及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。

委託会社は、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、並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、原則として当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。

委託会社は、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、並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当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。

委託会社は、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及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。

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。

委託会社は、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。

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、並びに運用の安定性を図るため、投資信託財産において一部解約の支払資金に不足額が生じるときは、資金借入れの指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。当該資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とし、当該借入期間は、有価証券等の売却代金の入金日までに限るものとします。また、借入金の利息は、投資信託財産中より支弁します。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定してい

る資金の額の範囲内

2. 一部解約支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

3. 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%以内

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及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、委託会社は、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、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及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。

< 関連法令に基づく投資制限 >

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、投資者の皆様の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、全て投資者の皆様に帰属します。

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。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が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。

## (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】

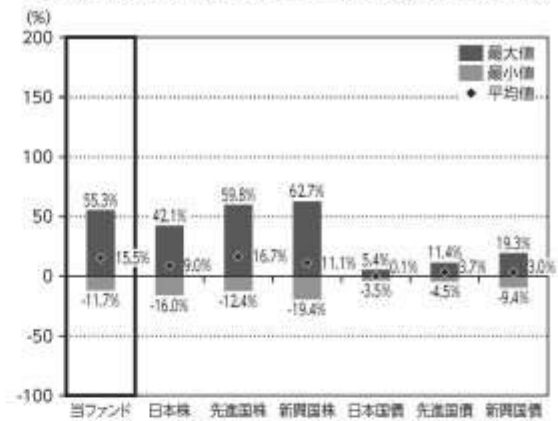
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



\*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7月～2022年6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研究所が算出、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、投資対象としての機能性を有するマーケットベンチマークで、浮動株ベースの時価総額重み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増減額に係る権利又は義務は、株式会社JPX研究所又は株式会社JPX研究所の関連会社(以下「JPX」といふ)の知的財産であり、増減の算出、増減額の公表、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義務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.が算出した日本を除く世界の主要国の株式市場の動向を表す株価指数で、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.が算出した世界の新興国株式市場の動向を表す株価指数で、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国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が発行する、国内で発行された公募固定利率国債の市場主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投資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該の損害活動「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、本ファンドの複製、販売等を行う権利を行使していません。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、遅延又は中断につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産権の他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 J.P. Morganグローバル・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・デベロップメント	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されています。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】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に追加設定時信託財産留保額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額の0.1%）（1）を加えた価額（販売基準価額）に、1.1%（税抜 1.0%）（2）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

1：「信託財産留保額」とは、当初設定日以降の買付又は信託期間終了前の解約に際し、取得申込者又は解約者

にご負担いただき投資信託財産に繰り入れる金額のことをいいます。追加設定又は解約に対応して投資信託財産で有価証券等の取引を行う場合には、売買委託手数料等のコストが発生するほか、組入る有価証券等の市場価格が変動するリスクを負うこととなります。信託財産留保額は、こうしたコストの負担について、受益権を継続して保有される受益者との公平性を図る目的で導入されています。

2：「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（以下同じ）。

「分配金再投資コース」（3）において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

3：収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に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）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

上記及び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、下記に記載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）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を解約時信託財産留保額として当該基準価額から控除します。

## （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 0.396% (税抜 0.36%)	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 0.407% (税抜 0.37%)	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 0.077% (税抜 0.07%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

	税 率（内 訳）
2037年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
2038年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離

課税を選択したものに限り、)及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

## 二．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率（所得税のみ）
2037年12月31日まで	15.315%
2038年1月1日以降	15%

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

### 個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」について」をご参照ください。）

### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2022年6月30日現在のもので、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6月30日現在の状況について記載してあります。

## 【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	3,670,051,756	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,835,273	0.05
合計(純資産総額)		3,671,887,029	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	885,288,440	4.1944	3,713,288,123	4.1456	3,670,051,756	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。

## ロ. 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13期計算期間末	(2013年 5月29日)	1,667,566,942	1,697,012,386	11,326	11,526
第14期計算期間末	(2014年 5月29日)	1,758,035,378	1,791,997,838	12,941	13,191
第15期計算期間末	(2015年 5月29日)	2,169,191,366	2,209,024,362	16,337	16,637
第16期計算期間末	(2016年 5月30日)	2,064,365,337	2,109,754,246	13,645	13,945
第17期計算期間末	(2017年 5月29日)	2,021,006,899	2,059,869,891	15,601	15,901
第18期計算期間末	(2018年 5月29日)	2,026,474,675	2,062,781,536	16,745	17,045
第19期計算期間末	(2019年 5月29日)	2,186,852,209	2,232,882,123	16,628	16,978
第20期計算期間末	(2020年 5月29日)	2,094,261,976	2,131,755,466	16,757	17,057
第21期計算期間末	(2021年 5月31日)	3,070,040,178	3,108,660,697	23,848	24,148
第22期計算期間末	(2022年 5月30日)	3,622,048,520	3,670,757,953	26,026	26,376
	2021年 6月末日	3,195,262,367		24,428	
	7月末日	3,240,422,940		24,754	
	8月末日	3,339,052,201		25,345	
	9月末日	3,288,423,561		24,741	
	10月末日	3,461,291,130		26,532	
	11月末日	3,460,445,268		26,405	
	12月末日	3,647,947,777		27,465	
	2022年 1月末日	3,426,797,751		25,526	
	2月末日	3,409,565,378		25,340	
	3月末日	3,849,865,978		28,014	
	4月末日	3,695,804,744		26,799	
	5月末日	3,722,174,097		26,336	
	6月末日	3,671,887,029		25,703	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第13期計算期間	2012年 5月30日～2013年 5月29日	200
第14期計算期間	2013年 5月30日～2014年 5月29日	250
第15期計算期間	2014年 5月30日～2015年 5月29日	300
第16期計算期間	2015年 5月30日～2016年 5月30日	300
第17期計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	300
第18期計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月29日	300
第19期計算期間	2018年 5月30日～2019年 5月29日	350

第20期計算期間	2019年 5月30日～2020年 5月29日	300
第21期計算期間	2020年 5月30日～2021年 5月31日	300
第22期計算期間	2021年 6月 1日～2022年 5月30日	350

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第13期計算期間	2012年 5月30日～2013年 5月29日	64.4
第14期計算期間	2013年 5月30日～2014年 5月29日	16.5
第15期計算期間	2014年 5月30日～2015年 5月29日	28.6
第16期計算期間	2015年 5月30日～2016年 5月30日	14.6
第17期計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	16.5
第18期計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月29日	9.3
第19期計算期間	2018年 5月30日～2019年 5月29日	1.4
第20期計算期間	2019年 5月30日～2020年 5月29日	2.6
第21期計算期間	2020年 5月30日～2021年 5月31日	44.1
第22期計算期間	2021年 6月 1日～2022年 5月30日	10.6

(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13期計算期間	2012年 5月30日～2013年 5月29日	356,957,503	567,586,301	1,472,272,230
第14期計算期間	2013年 5月30日～2014年 5月29日	629,763,336	743,537,133	1,358,498,433
第15期計算期間	2014年 5月30日～2015年 5月29日	499,130,409	529,862,277	1,327,766,565
第16期計算期間	2015年 5月30日～2016年 5月30日	402,682,221	217,485,148	1,512,963,638
第17期計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	185,293,328	402,823,878	1,295,433,088
第18期計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月29日	134,008,067	219,212,433	1,210,228,722
第19期計算期間	2018年 5月30日～2019年 5月29日	745,961,689	641,050,011	1,315,140,400
第20期計算期間	2019年 5月30日～2020年 5月29日	729,811,741	795,169,139	1,249,783,002
第21期計算期間	2020年 5月30日～2021年 5月31日	403,458,266	365,890,627	1,287,350,641
第22期計算期間	2021年 6月 1日～2022年 5月30日	216,844,179	112,496,708	1,391,698,112

(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	347,110,690,194	66.43
	イギリス	23,005,077,740	4.40
	カナダ	19,761,102,037	3.78
	スイス	17,169,973,329	3.29
	フランス	15,404,212,378	2.95
	ドイツ	11,596,022,423	2.22
	オーストラリア	10,872,280,228	2.08
	アイルランド	8,904,220,916	1.70
	オランダ	8,806,150,074	1.69
	スウェーデン	4,779,428,683	0.91
	デンマーク	4,109,588,931	0.79
	スペイン	3,776,800,866	0.72
	香港	3,623,537,803	0.69
	イタリア	2,586,828,291	0.50
	フィンランド	1,779,789,769	0.34
	シンガポール	1,657,532,743	0.32
	ジャージー	1,576,074,014	0.30
	ノルウェー	1,275,657,587	0.24
	ベルギー	1,241,720,665	0.24
	ケイマン	1,155,757,632	0.22
	イスラエル	1,147,148,622	0.22
	バミューダ	764,205,018	0.15
	キュラソー	556,450,342	0.11
	ニュージーランド	370,089,738	0.07
	ルクセンブルク	367,522,633	0.07
	ポルトガル	285,744,872	0.05
	オーストリア	276,106,087	0.05
	マン島	104,035,969	0.02
	リベリア	82,547,522	0.02
	パナマ	75,289,459	0.01
	小計	494,221,586,565	94.59
投資信託受益証券	オーストラリア	147,002,807	0.03
	香港	65,340,078	0.01
	小計	212,342,885	0.04
投資証券	アメリカ	10,541,893,460	2.02
	オーストラリア	662,036,628	0.13
	イギリス	271,071,188	0.05
	シンガポール	241,507,459	0.05
	フランス	203,203,739	0.04
	香港	193,094,745	0.04

	カナダ	55,808,172	0.01
	ベルギー	55,715,397	0.01
	小計	12,224,330,788	2.34
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		15,831,655,703	3.03
合計(純資産総額)		522,489,915,941	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	12,038,748,772	2.30
	買建	カナダ	955,946,160	0.18
	買建	ドイツ	2,511,174,082	0.48
	買建	イギリス	300,742,936	0.06
	買建	オーストラリア	510,975,630	0.10

(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		1,734,056,518	0.33

(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	1,298,829	20,451.62	26,563,157,177	19,029.95	24,716,659,241	4.73
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	567,129	37,343.76	21,178,733,613	35,572.33	20,174,103,797	3.86
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	728,980	15,751.86	11,482,795,142	14,887.18	10,852,460,559	2.08

アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	23,937	307,100.20	7,351,057,606	305,347.22	7,309,096,415	1.40
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	22,610	308,382.75	6,972,534,189	306,864.36	6,938,203,370	1.33
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	69,919	103,818.55	7,258,889,655	93,690.03	6,550,713,879	1.25
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	74,889	69,286.97	5,188,832,321	70,487.24	5,278,719,126	1.01
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	209,270	24,747.47	5,178,904,338	24,190.99	5,062,449,147	0.97
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	199,119	25,708.07	5,118,965,207	21,242.80	4,229,846,208	0.81
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	183,787	26,670.36	4,901,666,997	22,407.31	4,118,173,974	0.79
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	336,966	13,334.22	4,493,179,063	12,044.24	4,058,499,915	0.78
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	102,772	43,612.72	4,482,167,320	37,380.61	3,841,680,380	0.74
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	190,793	20,326.22	3,878,102,060	19,435.89	3,708,232,906	0.71
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	235,026	17,944.14	4,217,341,547	15,759.20	3,703,822,679	0.71
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	132,437	29,095.17	3,853,278,165	27,267.65	3,611,247,087	0.69
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	224,341	16,695.64	3,745,518,556	16,095.68	3,610,920,947	0.69
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	447,595	7,365.62	3,296,819,066	6,962.47	3,116,370,878	0.60
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	155,015	24,353.67	3,775,184,493	20,089.22	3,114,131,430	0.60
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	83,117	42,145.70	3,503,024,717	37,432.55	3,111,281,391	0.60
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	69,486	48,901.59	3,397,976,334	44,091.60	3,063,749,001	0.59
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	140,788	20,494.15	2,885,331,660	21,067.85	2,966,101,198	0.57
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	64,434	44,189.12	2,847,281,991	44,147.64	2,844,609,036	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	327,837	8,836.11	2,896,804,779	8,573.93	2,810,853,588	0.54
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	56,019	47,215.96	2,644,991,255	45,773.88	2,564,206,984	0.49



アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	201,204	12,719.26	2,559,166,324	12,644.26	2,544,077,057	0.49
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲 料・タバ コ	110,121	23,465.34	2,584,027,365	22,788.65	2,509,509,631	0.48
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	576,261	5,059.89	2,915,819,346	4,354.62	2,509,400,442	0.48
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信 サービス	334,145	7,024.86	2,347,322,738	6,962.47	2,326,477,612	0.45
アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	31,139	78,218.57	2,435,648,261	73,249.54	2,280,917,600	0.44
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生 活必需品 小売り	35,297	64,328.52	2,270,603,823	64,217.73	2,266,693,258	0.43

(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	5.14
		素材	4.18
		資本財	5.68
		商業・専門サービス	1.15
		運輸	1.91
		自動車・自動車部品	2.03
		耐久消費財・アパレル	1.56
		消費者サービス	1.66
		メディア・娯楽	5.64
		小売	4.51
		食品・生活必需品小売り	1.50
		食品・飲料・タバコ	4.34
		家庭用品・パーソナル用品	1.76
		ヘルスケア機器・サービス	4.78
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.15
		銀行	5.69
		各種金融	4.48
		保険	3.15
		不動産	0.41
		ソフトウェア・サービス	10.75
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.13		
電気通信サービス	1.67		
公益事業	3.18		

		半導体・半導体製造装置	4.15
		小計	94.59
投資信託受益証券			0.04
投資証券			2.34
合計			96.97

(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	461	アメリカドル	87,067,439.5	11,900,377,630	88,079,812.5	12,038,748,772	2.30
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	39	カナダドル	9,190,935.5	974,239,163	9,018,360	955,946,160	0.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	64	スイスフラン	6,856,158	981,801,826	6,903,680	988,606,976	0.19
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	305	ユーロ	10,597,887.5	1,512,000,609	10,671,950	1,522,567,106	0.29
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	33	オーストラリアドル	5,429,381	509,818,876	5,441,700	510,975,630	0.10
	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	25	イギリスポンド	1,788,858.75	296,431,783	1,814,875	300,742,936	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。


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	9,700,000.00	1,322,302,000	1,325,589,710	0.25
	カナダドル	買建	900,000.00	95,122,800	95,370,480	0.02
	ユーロ	買建	930,000.00	133,175,070	132,683,379	0.03
	イギリスポンド	買建	800,000.00	132,520,800	132,536,240	0.03
	オーストラリアドル	買建	510,000.00	47,878,290	47,876,709	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：2000年5月30日  
作成基準日：2022年6月30日

**基準価額・純資産の推移**

基準価額 25,703円

純資産総額 36.72億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年5月	300円
2019年5月	350円
2020年5月	300円
2021年5月	300円
2022年5月	350円
設定来 分配金合計額	4,150円

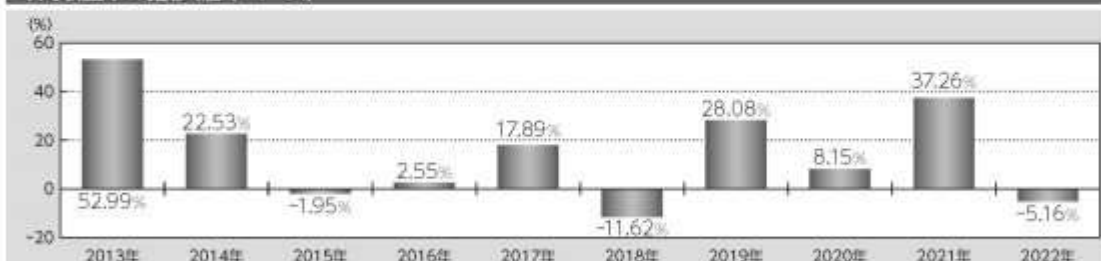
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

※基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。  
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

**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	4.7%
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	2.1%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	メディア・娯楽	1.4%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	メディア・娯楽	1.3%
TESLA INC	アメリカ	株式	自動車・自動車部品	1.3%
UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア機器・サービス	1.0%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	医薬品・ヘルスケア・デバイス	1.0%
NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	0.8%
META PLATFORMS INC-CLASS A	アメリカ	株式	メディア・娯楽	0.8%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移(暦年ベース)**

※収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。  
※2022年は年初から作成基準日までの収益率です。

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 >

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 >

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」（ ）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

「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 >

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に追加設定時信託財産留保額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額の0.1%）を加えた価額（販売基準価額）とします。

販売基準価額 = 取得申込受付日の翌営業日の基準価額 + 追加設定時信託財産留保額  
= 取得申込受付日の翌営業日の基準価額 + （取得申込受付日の翌営業日の基準価額  
× 0.1%）

（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販売基準価額とします。

### < 申込手数料 >

前記 第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (1)申込手数料をご覧ください。

### < 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の休業日

ロンドンの銀行の休業日

#### < 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、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 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 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から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時信託財産留保額を控除した価額（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。

#### <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の休業日

ロンドンの銀行の休業日

#### <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、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>

###### イ．マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

###### ロ．マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

外国上場株式、外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みません。）

原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

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計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

##### <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。（2000年5月30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5月30日から翌年5月29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ち、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。受託会社は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、販売会社を経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れ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、毎計算期間終了日（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）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

上記 の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者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。

上記 に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が収益分配金について支払開始日から5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。

### (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）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22期計算期間(2021年6月1日から2022年5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】

## 【外国株式インデックス・オープン】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第21期 ( 2021年 5月31日現在 )	第22期 ( 2022年 5月30日現在 )
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	14,551,581	17,331,441
親投資信託受益証券	3,068,505,676	3,620,276,785
未収入金	38,365,813	52,301,718
流動資産合計	3,121,423,070	3,689,909,944
<b>資産合計</b>	3,121,423,070	3,689,909,944
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払収益分配金	38,620,519	48,709,433
未払解約金	399,409	3,397,047
未払受託者報酬	1,069,718	1,362,112
未払委託者報酬	11,155,615	14,204,802
未払利息	26	15
その他未払費用	137,605	188,015
流動負債合計	51,382,892	67,861,424
<b>負債合計</b>	51,382,892	67,861,424
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	1,287,350,641	1,391,698,112
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	1,782,689,537	2,230,350,408
( 分配準備積立金 )	897,409,417	1,090,512,730
元本等合計	3,070,040,178	3,622,048,520
<b>純資産合計</b>	3,070,040,178	3,622,048,520
<b>負債純資産合計</b>	3,121,423,070	3,689,909,944

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第21期		第22期	
	自	2020年 5月30日	自	2021年 6月 1日
	至	2021年 5月31日	至	2022年 5月30日
営業収益				
受取利息		30		49
有価証券売買等損益		956,588,670		361,624,895
営業収益合計		956,588,700		361,624,944
営業費用				
支払利息		2,759		3,730
受託者報酬		1,928,188		2,633,870
委託者報酬		20,108,166		27,467,335
その他費用		137,626		188,015
営業費用合計		22,176,739		30,292,950
営業利益又は営業損失（ ）		934,411,961		331,331,994
経常利益又は経常損失（ ）		934,411,961		331,331,994
当期純利益又は当期純損失（ ）		934,411,961		331,331,994
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（ ）		88,383,593		16,383,423
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		844,478,974		1,782,689,537
剰余金増加額又は欠損金減少額		385,854,741		337,707,715
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		385,854,741		337,707,715
剰余金減少額又は欠損金増加額		255,052,027		156,285,982
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		255,052,027		156,285,982
分配金		38,620,519		48,709,433
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,782,689,537		2,230,350,408

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年5月30日から翌年5月29日までとなっておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第22期計算期間は2021年 6月 1日から2022年 5月30日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第21期 (2021年 5月31日現在)	第22期 (2022年 5月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,287,350,641口	1,391,698,112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) 2.3848円 (23,848円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.6026円 (26,026円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第21期 自 2020年 5月30日 至 2021年 5月31日			第22期 自 2021年 6月 1日 至 2022年 5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	41,892,726円	費用控除後の配当等収益額	A	51,470,944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	802,643,896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	263,477,627円
収益調整金額	C	1,272,372,276円	収益調整金額	C	1,522,334,714円
分配準備積立金額	D	91,493,314円	分配準備積立金額	D	824,273,592円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,208,402,212円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,661,556,877円
当ファンドの期末残存口数	F	1,287,350,641口	当ファンドの期末残存口数	F	1,391,698,112口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	17,154円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	19,124円
1万口当たり分配金額	H	300円	1万口当たり分配金額	H	350円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	38,620,519円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	48,709,433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22期 自 2021年 6月 1日 至 2022年 5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（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。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第22期 (2022年 5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21期	第22期
	自 2020年 5月30日 至 2021年 5月31日	自 2021年 6月 1日 至 2022年 5月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,249,783,002円	1,287,350,641円
期中追加設定元本額	403,458,266円	216,844,179円
期中一部解約元本額	365,890,627円	112,496,708円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第21期 (2021年 5月31日現在)	第22期 (2022年 5月30日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	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	873,479,569	346,769,144
合計	873,479,569	346,769,144

## （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	863,039,188	3,620,276,785	
合計		863,039,188	3,620,276,785	

(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

	2022年 5月30日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	13,842,493,634
コール・ローン	1,518,951,888
株式	492,430,194,549
投資信託受益証券	213,635,587
投資証券	12,049,149,251
派生商品評価勘定	358,331,772
未収入金	18,139,108
未収配当金	778,482,292
差入委託証拠金	2,639,676,370
流動資産合計	523,849,054,451
資産合計	523,849,054,451
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	250,964,809
前受金	106,155,804
未払解約金	66,967,258
未払利息	1,328
流動負債合計	424,089,199
負債合計	424,089,199
純資産の部	
元本等	
元本	124,778,059,850
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	398,646,905,402
元本等合計	523,424,965,252
純資産合計	523,424,965,252
負債純資産合計	523,849,054,451

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 5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</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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</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>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<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>

	2022年 5月30日現在
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(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。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 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 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 5月30日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	124,778,059,850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 4,1948円 (1万口当たり純資産額) (41,948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

	2022年 5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。
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	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。

	2022年 5月30日現在

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 5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	2022年 5月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 6月 1日
期首元本額	137,722,653,603円
期中追加設定元本額	15,718,352,796円
期中一部解約元本額	28,662,946,549円
期末元本額	124,778,059,850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）	1,890,361,169円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,439,733円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	31,891,617,739円
世界経済インデックスファンド	10,429,835,021円
外国株式インデックス・オープン	863,039,188円
D C マイセレクション 2 5	803,273,450円
D C マイセレクション 5 0	3,623,631,364円
D C マイセレクション 7 5	4,395,959,459円
D C 外国株式インデックス・オープン	11,770,844,166円
D C マイセレクション S 2 5	397,007,177円
D C マイセレクション S 5 0	1,817,107,210円
D C マイセレクション S 7 5	1,519,066,014円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	45,940,393円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	163,822,551円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	119,915,396円
D C 世界経済インデックスファンド	9,650,097,206円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,505,554,380円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	3,828,753円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	4,732,946円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	29,915,264円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	15,432,161円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	52,688,817円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	11,319,798円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	32,345,308円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	282,297,126円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	175,323,922円
バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用）	1,285,687,705円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	118,695,108円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	33,352,178円
バランス D（35）V A 1（適格機関投資家専用）	164,818,430円
バランス E（25）V A 1（適格機関投資家専用）	56,281,250円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	1,070,221,107円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,127,752,855円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,136,804,848円
コア投資戦略ファンド（安定型）	581,693,447円

区分	2022年 5月30日現在
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,345,785,667円
分散投資コア戦略ファンドA	1,421,677,202円
分散投資コア戦略ファンドS	8,037,948,513円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,286,512,288円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,082,356,527円
コア投資戦略ファンド（切替型）	530,929,433円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	594,961,570円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,330,368円
SMT インデックスバランス・オープン	156,533,319円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	383,790,568円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	15,863,198,047円
SMT 世界経済インデックス・オープン	191,550,308円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	729,877,138円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	137,094,789円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,692,539円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	168,188,946円
グローバル経済コア	643,200,142円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	13,209,075円
DCターゲット・イヤーフンド2055	5,903,238円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	404,580,459円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	72,625,573円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	33,521,145円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	28,835,745円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	11,496,228円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	14,319,329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）	265,963,687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）	195,495,469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）	1,062,514,562円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,240,448,028円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	206,181,058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）	99,941,540円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	56,668,260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）	87,519,316円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	232,787,423円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	241,405,184円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	240,174,152円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	225,480,922円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	221,972,924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）	132,686,530円

（有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 5月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		14,006,501,868
投資信託受益証券		8,085,918
投資証券		270,576,717
合計		13,727,839,233

(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

(2022年 5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 買建	19,445,100,560	-		19,551,256,364	106,155,804
	合計	19,445,100,560	-		19,551,256,364	106,155,804

(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はありません。

## 通貨関連

(2022年 5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)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	2,384,992,939	-		2,386,204,098	1,211,159
	アメリカドル	1,717,667,819	-		1,716,689,680	978,139
	カナダドル	69,586,440	-		69,903,120	316,680
	ユーロ	137,669,060	-		137,656,132	12,928
	イギリスポンド	137,887,600	-		137,927,058	39,458
	スイスフラン	66,294,500	-		66,296,600	2,100
	デンマーククローネ	23,822,500	-		23,816,780	5,720



	オーストラリアドル	232,065,020	-	233,914,728	1,849,708
	合計	2,384,992,939	-	2,386,204,098	1,211,159

## (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	62,788	37.18	2,334,457.84	
	CHENIERE ENERGY INC	19,034	138.33	2,632,973.22	
	CHEVRON CORP	150,711	178.28	26,868,757.08	
	CONOCOPHILLIPS	104,031	114.60	11,921,952.60	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	35.52	2,273,280.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	51,677	75.80	3,917,116.60	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	152.66	2,025,340.22	
	EOG RESOURCES INC	46,119	136.85	6,311,385.15	
	EXXON MOBIL	330,112	97.59	32,215,630.08	
	HALLIBURTON CO	68,269	41.36	2,823,605.84	
	HESS CORP	22,781	123.28	2,808,441.68	
	KINDER MORGAN INC	159,310	19.94	3,176,641.40	
	MARATHON PETROLEUM CORP	48,069	102.10	4,907,844.90	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	69,966	70.86	4,957,790.76	
	ONEOK INC	33,279	67.05	2,231,356.95	
	PHILLIPS 66	35,503	101.73	3,611,720.19	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	18,224	280.00	5,102,720.00	
	SCHLUMBERGER	107,126	48.21	5,164,544.46	
	VALERO ENERGY CORP	30,763	131.81	4,054,871.03	
	WILLIAMS COS	98,553	37.46	3,691,795.38	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,541	250.65	4,396,651.65		
ALBEMARLE CORP	9,440	270.92	2,557,484.80		
AMCOR PLC	111,485	13.31	1,483,865.35		
AVERY DENNISON CORP	6,638	173.61	1,152,423.18		
BALL CORP	25,605	73.73	1,887,856.65		

CELANESE CORP-SERIES A	8,582	159.21	1,366,340.22
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	14,951	95.72	1,431,109.72
CORTEVA INC	58,500	62.91	3,680,235.00
CROWN HOLDINGS INC	9,940	106.93	1,062,884.20
DOW INC	57,346	69.06	3,960,314.76
DUPONT DE NEMOURS INC	40,980	68.36	2,801,392.80
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	109.63	1,214,152.25
ECOLAB INC	19,895	166.03	3,303,166.85
FMC CORP	10,507	126.01	1,323,987.07
FREEMONT-MCMORAN INC	113,194	39.65	4,488,142.10
INT'L PAPER CO	30,800	49.31	1,518,748.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,494	132.96	2,591,922.24
LINDE PLC	40,161	329.63	13,238,270.43
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,803	117.08	2,318,535.24
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,631	349.45	1,618,302.95
MOSAIC CO/THE	27,732	59.85	1,659,760.20
NEWMONT CORPORATION	61,555	68.71	4,229,444.05
NUCOR CORP	22,299	137.74	3,071,464.26
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	159.90	1,229,151.30
PPG INDUSTRIES INC	19,278	130.03	2,506,718.34
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	90.89	950,345.84
SEALED AIR CORP	11,690	63.78	745,588.20
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,719	276.35	5,449,345.65
STEEL DYNAMICS INC	15,552	87.79	1,365,310.08
VULCAN MATERIALS CO	10,247	169.71	1,739,018.37
WESTROCK CO	21,356	49.04	1,047,298.24
3 M COMPANY	44,860	149.51	6,707,018.60
AERCAP HOLDINGS NV	11,005	49.00	539,245.00
ALLEGION PLC	7,601	113.54	863,017.54
AMETEK INC	18,006	122.46	2,205,014.76
BOEING CO	43,246	132.23	5,718,418.58
CARRIER GLOBAL CORP	63,164	40.23	2,541,087.72
CATERPILLAR	42,499	217.14	9,228,232.86
CUMMINS INC	11,214	207.97	2,332,175.58
DEERE&CO	23,252	360.73	8,387,693.96
DOVER CORP	10,672	134.55	1,435,917.60
EATON CORP	31,624	139.82	4,421,667.68
EMERSON ELECTRIC CO	46,305	88.40	4,093,362.00
FASTENAL CO	44,846	54.12	2,427,065.52
FORTIVE CORP	25,722	62.00	1,594,764.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	70.45	726,339.50
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	256.17	1,334,901.87

GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	226.51	4,296,894.70
GENERAL ELECTRIC CO	85,187	78.76	6,709,328.12
GRAINGER (WW) INC	3,236	490.39	1,586,902.04
HEICO CORP	3,640	144.24	525,033.60
HEICO CORP-CLASS A	6,449	118.50	764,206.50
HONEYWELL INTL INC	53,646	196.35	10,533,392.10
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	36.03	1,138,331.82
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	214.40	755,116.80
IDEX CORP	5,916	192.14	1,136,700.24
ILLINOIS TOOL WORKS	24,227	206.74	5,008,689.98
INGERSOLL-RAND INC	31,562	48.49	1,530,441.38
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	57.76	1,022,352.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	56,689	54.71	3,101,455.19
KORNIT DIGITAL LTD	2,776	43.33	120,284.08
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,684	240.92	3,778,589.28
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	211.51	534,274.26
LOCKHEED MARTIN CORP	19,332	450.56	8,710,225.92
MASCO CORP	19,462	57.84	1,125,682.08
NORDSON CORP	4,121	219.83	905,919.43
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,737	470.76	5,525,310.12
OTIS WORLDWIDE CORP	30,653	76.30	2,338,823.90
OWENS CORNING	8,642	97.39	841,644.38
PACCAR INC	28,106	85.67	2,407,841.02
PARKER HANNIFIN CORP	9,900	272.72	2,699,928.00
PENTAIR PLC	14,533	50.36	731,881.88
PLUG POWER INC	41,884	19.06	798,309.04
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	117,233	96.71	11,337,603.43
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,098	211.02	1,919,859.96
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,314	443.88	3,690,418.32
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	47.34	654,617.52
SMITH (A.O.) CORP	9,016	61.22	551,959.52
SNAP-ON INC	4,000	222.90	891,600.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	119.68	1,507,728.64
SUNRUN INC	13,917	26.44	367,965.48
TEXTRON	16,934	66.04	1,118,321.36
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	140.50	2,618,639.00
TRANSDIGM GROUP INC	4,075	612.27	2,495,000.25
UNITED RENTALS INC	5,393	297.46	1,604,201.78
WABTEC CORP	15,024	94.93	1,426,228.32
XYLEM INC	13,269	85.91	1,139,939.79
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	86.86	987,077.04
CINTAS CORP	7,423	396.91	2,946,262.93

CLARIVATE PLC	27,357	14.90	407,619.30
COPART INC	16,617	116.69	1,939,037.73
COSTAR GROUP INC	32,116	61.50	1,975,134.00
EQUIFAX INC	9,509	206.29	1,961,611.61
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,661	140.06	1,493,179.66
LEIDOS HOLDINGS	11,220	105.36	1,182,139.20
REPUBLIC SERVICES INC	16,942	136.87	2,318,851.54
ROBERT HALF INTL INC	9,566	89.37	854,913.42
ROLLINS INC	17,468	36.61	639,503.48
TRANSUNION	15,741	88.24	1,388,985.84
VERISK ANALYTICS INC	12,503	178.65	2,233,660.95
WASTE CONNECTIONS INC	21,275	128.49	2,733,624.75
WASTE MANAGEMENT INC	32,770	161.00	5,275,970.00
AMERCO	734	501.96	368,438.64
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,292	107.45	1,213,325.40
CSX CORP	173,146	32.05	5,549,329.30
DELTA AIR LINES INC	14,609	42.23	616,938.07
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	110.65	1,579,196.80
FEDEX CORP	19,524	219.67	4,288,837.08
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	83,011	2.41	200,056.51
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	174.86	1,233,112.72
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	48.84	522,588.00
LYFT INC-A	21,288	17.77	378,287.76
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,087	241.03	4,600,539.61
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	264.14	2,113,912.42
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	45.80	619,811.40
UBER TECHNOLOGIES INC	113,645	23.67	2,689,977.15
UNION PACIFIC CORP	50,721	222.50	11,285,422.50
UNITED PARCEL SERVICE B	56,644	182.53	10,339,229.32
APTIV PLC	20,714	104.35	2,161,505.90
BORGWARNER INC	19,781	39.73	785,899.13
FORD MOTOR COMPANY	305,209	13.63	4,159,998.67
GENERAL MOTORS CO	103,796	38.57	4,003,411.72
LEAR CORP	5,287	136.56	721,992.72
LUCID GROUP INC	31,234	19.83	619,370.22
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	13,363	30.96	413,718.48
TESLA INC	66,795	759.63	50,739,485.85
DR HORTON INC	27,764	74.78	2,076,191.92
GARMIN LTD	12,854	105.54	1,356,611.16
HASBRO INC	10,572	87.08	920,609.76
LENNAR CORP-CL A	20,844	81.17	1,691,907.48
LULULEMON ATHLETICA INC	9,305	293.65	2,732,413.25

MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	141.77	717,639.74
NEWELL BRANDS INC	31,461	21.88	688,366.68
NIKE B	99,467	115.99	11,537,177.33
NVR INC	247	4,467.76	1,103,536.72
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	14.51	315,389.36
PULTE GROUP INC	21,609	45.69	987,315.21
VF CORP	25,718	50.18	1,290,529.24
WHIRLPOOL CORP	5,220	182.81	954,268.20
AIRBNB INC-CLASS A	23,026	120.50	2,774,633.00
ARAMARK	20,955	34.43	721,480.65
BOOKING HOLDINGS INC	3,187	2,265.98	7,221,678.26
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	51.60	906,096.00
CARNIVAL CORPORATION	62,102	13.97	867,564.94
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,164	1,402.42	3,034,836.88
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	126.04	1,350,140.48
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	365.91	1,042,111.68
DRAFTKINGS INC	27,674	14.72	407,361.28
EXPEDIA GROUP INC	11,638	130.97	1,524,228.86
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,878	142.25	3,112,145.50
LAS VEGAS SANDS CORP	24,370	34.62	843,689.40
MARRIOTT INTL A	21,139	172.56	3,647,745.84
MCDONALD'S CORP	58,134	251.87	14,642,210.58
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	5.30	93,608.60
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,874	34.89	1,007,413.86
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,767	58.19	975,671.73
STARBUCKS CORP	91,531	76.71	7,021,343.01
VAIL RESORTS INC	3,014	252.94	762,361.16
WYNN RESORTS LTD	9,302	65.26	607,048.52
YUM BRANDS INC	22,637	119.77	2,711,233.49
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,643	78.20	4,820,482.60
ALPHABET INC-CL A	23,507	2,246.33	52,804,479.31
ALPHABET INC-CL C	22,377	2,255.98	50,482,064.46
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	38,290	14.43	552,524.70
CABLE ONE INC	445	1,285.04	571,842.80
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	9,809	509.94	5,002,001.46
COMCAST CORP-CL A	356,721	44.16	15,752,799.36
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	22.30	448,943.60
ELECTRONIC ARTS INC	21,814	138.53	3,021,893.42
FOX CORP - CLASS A	27,658	35.46	980,752.68
FOX CORP- CLASS B	10,345	32.69	338,178.05
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	86.62	582,173.02
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	32.28	1,092,161.52

LIBERTY BROADBAND-A	2,579	121.46	313,245.34
LIBERTY BROADBAND-C	11,268	125.66	1,415,936.88
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	63.42	975,336.18
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	41.53	564,143.52
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	41.61	265,638.24
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,343	95.49	1,178,633.07
MATCH GROUP INC	20,191	79.84	1,612,049.44
META PLATFORMS INC-CLASS A	185,146	195.13	36,127,538.98
NETFLIX INC	34,441	195.19	6,722,538.79
NEWS CORP-CLASS A	33,479	17.68	591,908.72
OMNICOM GROUP	16,538	75.00	1,240,350.00
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	48,586	33.91	1,647,551.26
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	20.45	935,935.15
ROKU INC	9,122	96.47	879,999.34
SEA LTD-ADR	25,116	82.86	2,081,111.76
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	6.38	385,785.84
SNAP INC - A	83,375	15.58	1,298,982.50
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,973	125.78	1,128,623.94
THE WALT DISNEY CO	141,614	109.32	15,481,242.48
TWITTER INC	63,066	40.17	2,533,361.22
WARNER BROS DISCOVERY INC	175,398	18.76	3,290,466.48
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	41.08	901,089.80
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	193.05	1,027,798.20
AMAZON.COM	35,733	2,302.93	82,290,597.69
AUTOZONE INC	1,639	2,055.39	3,368,784.21
BATH & BODY WORKS INC	19,806	42.45	840,764.70
BEST BUY COMPANY INC	18,175	83.99	1,526,518.25
BURLINGTON STORES INC	5,108	171.63	876,686.04
CARMAX INC	12,051	100.29	1,208,594.79
CARVANA CO	5,700	33.85	192,945.00
CHEWY INC - CLASS A	6,878	27.11	186,462.58
DOLLAR GENERAL CORP	18,686	228.38	4,267,508.68
DOLLAR TREE INC	17,931	165.00	2,958,615.00
DOORDASH INC - A	8,334	78.09	650,802.06
EBAY	51,021	48.82	2,490,845.22
ETSY INC	10,294	82.15	845,652.10
FIVERR INTERNATIONAL LTD	1,486	42.95	63,823.70
GENUINE PARTS CO	10,119	139.18	1,408,362.42
HOME DEPOT	81,549	308.46	25,154,604.54
LKQ CORP	22,779	52.34	1,192,252.86
LOWES COMPANIES	52,191	199.63	10,418,889.33
MERCADOLIBRE INC	3,567	811.44	2,894,406.48

O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,407	647.34	3,500,167.38
POOL CORP	3,304	406.00	1,341,424.00
ROSS STORES INC	28,076	87.31	2,451,315.56
TARGET (DAYTON HUDSON)	37,156	167.14	6,210,253.84
TJX COMPANIES INC	93,142	64.59	6,016,041.78
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	192.43	1,716,860.46
ULTA BEAUTY INC	3,990	425.08	1,696,069.20
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	59.04	354,240.00
COSTCO WHOLESALE CORP	34,433	470.76	16,209,679.08
KROGER CO	56,126	52.96	2,972,432.96
SYSCO CORP	40,288	84.48	3,403,530.24
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	43.71	2,612,415.57
WALMART INC	120,012	128.48	15,419,141.76
ALTRIA GROUP INC	142,972	54.43	7,781,965.96
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,967	88.93	3,821,055.31
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	66.56	1,597,839.36
BUNGE LIMITED	11,604	114.72	1,331,210.88
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	48.21	765,044.49
COCA-COLA CO	319,753	64.68	20,681,624.04
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	53.88	829,428.72
CONAGRA BRANDS INC	35,941	33.15	1,191,444.15
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	246.31	3,187,251.40
GENERAL MILLS INC	46,541	69.89	3,252,750.49
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,352	212.61	2,413,548.72
HORMEL FOODS CORP	23,338	48.63	1,134,926.94
JM SMUCKER CO	9,145	125.55	1,148,154.75
KELLOGG CO	21,630	69.81	1,509,990.30
KEURIG DR PEPPER INC	52,526	35.18	1,847,864.68
KRAFT HEINZ CO/THE	52,188	37.83	1,974,272.04
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,909	92.94	1,757,402.46
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	55.15	808,995.35
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	108,376	63.76	6,910,053.76
MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	89.67	2,893,381.89
PEPSICO INC	107,665	171.77	18,493,617.05
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	121,262	106.97	12,971,396.14
TYSON FOODS INC	21,804	91.04	1,985,036.16
CHURCH & DWIGHT CO INC	17,995	90.33	1,625,488.35
CLOROX COMPANY	9,570	148.71	1,423,154.70
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,788	78.86	5,030,321.68
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,438	251.86	4,643,794.68
KIMBERLY-CLARK CORP	25,886	133.43	3,453,968.98
PROCTER & GAMBLE CO	189,391	148.72	28,166,229.52

ABBOTT LABORATORIES	138,079	116.69	16,112,438.51
ABIOMED INC	3,781	266.34	1,007,031.54
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	284.57	1,691,199.51
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	156.86	2,022,866.56
ANTHEM INC	18,926	520.55	9,851,929.30
BAXTER INTERNATIONAL	38,403	76.16	2,924,772.48
BECTON DICKINSON & CO	22,232	256.46	5,701,618.72
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,802	41.20	4,647,442.40
CARDINAL HEALTH	21,902	57.70	1,263,745.40
CENTENE CORP	44,550	84.41	3,760,465.50
CERNER CORP	22,894	94.68	2,167,603.92
CIGNA CORP	26,327	272.40	7,171,474.80
CVS HEALTH CORP	102,569	98.05	10,056,890.45
DAVITA INC	5,784	97.78	565,559.52
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	39.72	705,983.28
DEXCOM INC	7,647	289.08	2,210,594.76
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	48,336	101.12	4,887,736.32
HCA HEALTHCARE INC	19,440	215.55	4,190,292.00
HENRY SCHEIN INC	11,747	85.96	1,009,772.12
HOLOGIC INC	19,018	77.46	1,473,134.28
HUMANA INC	9,953	461.21	4,590,423.13
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	398.61	2,691,016.11
INMODE LTD	5,500	26.64	146,520.00
INSULET CORP	5,311	235.21	1,249,200.31
INTUITIVE SURGICAL INC	27,694	229.16	6,346,357.04
LABORATORY CRP OF AMER	7,595	257.87	1,958,522.65
MASIMO CORP	4,147	143.50	595,094.50
MCKESSON CORP	12,089	334.96	4,049,331.44
MEDTRONIC PLC	104,586	99.08	10,362,380.88
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	305.08	1,386,588.60
NOVOCURE LTD	7,933	83.98	666,213.34
QUEST DIAGNOSTICS	10,005	145.39	1,454,626.95
RESMED INC	11,440	208.30	2,382,952.00
STERIS PLC	8,018	235.00	1,884,230.00
STRYKER CORP	26,295	236.50	6,218,767.50
TELADOC HEALTH INC	11,375	35.77	406,883.75
TELEFLEX INC	3,934	290.09	1,141,214.06
THE COOPER COS INC	4,134	352.17	1,455,870.78
UNITEDHEALTH GROUP INC	73,563	507.11	37,304,532.93
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,102	124.96	762,505.92
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	172.00	1,935,860.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,281	119.83	1,950,952.23



10X GENOMICS INC-CLASS A	5,655	52.99	299,658.45
ABBVIE INC	137,691	150.00	20,653,650.00
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	130.55	3,105,131.75
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	127.77	1,232,086.11
AMGEN	44,045	255.26	11,242,926.70
AVANTOR INC	42,980	32.98	1,417,480.40
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	547.25	1,014,054.25
BIO-TECHNE CORP	3,245	386.56	1,254,387.20
BIOGEN INC	11,860	206.20	2,445,532.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	80.97	1,196,979.51
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	172,791	76.14	13,156,306.74
CATALENT INC	13,739	105.37	1,447,678.43
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	244.41	1,027,499.64
DANAHER CORP	50,501	266.49	13,458,011.49
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	23.87	860,776.07
EXACT SCIENCES CORP	14,756	53.83	794,315.48
GILEAD SCIENCES INC	97,060	64.80	6,289,488.00
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	94.84	1,700,101.84
ILLUMINA INC	11,258	258.06	2,905,239.48
INCYTE CORP	15,212	77.19	1,174,214.28
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	220.50	3,335,283.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	150.91	750,173.61
JOHNSON & JOHNSON	205,370	181.09	37,190,453.30
LILLY (ELI) & CO	63,296	323.48	20,474,990.08
MERCK & CO	197,066	93.08	18,342,903.28
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,326.52	2,398,348.16
MODERNA INC	27,309	147.66	4,032,446.94
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	93.10	788,929.40
NOVAVAX INC	5,754	55.29	318,138.66
PERKINELMER INC	9,372	156.18	1,463,718.96
PFIZER	437,000	53.91	23,558,670.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,116	692.80	5,622,764.80
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	26,128	41.27	1,078,302.56
SEAGEN INC	10,071	141.39	1,423,938.69
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	9.04	726,825.04
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,643	572.35	17,538,521.05
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,030	273.73	5,482,811.90
VIATRIS INC	90,748	12.25	1,111,663.00
WATERS CORP	4,749	335.06	1,591,199.94
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	321.21	1,852,418.07
ZOETIS INC	36,750	172.10	6,324,675.00
BANK OF AMERICA CORP	576,261	37.02	21,333,182.22

CITIGROUP	155,162	53.62	8,319,786.44
CITIZENS FINANCIAL GROUP	32,251	40.87	1,318,098.37
FIFTH THIRD BANCORP	52,803	39.11	2,065,125.33
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	693.83	659,138.50
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,787	157.41	2,170,211.67
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	13.93	1,589,580.16
JPMORGAN CHASE & CO	231,226	131.27	30,353,037.02
KEY CORP	71,472	19.82	1,416,575.04
M & T BANK CORP	14,037	180.80	2,537,889.60
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,936	175.05	5,765,446.80
REGIONS FINL CORP	70,814	21.88	1,549,410.32
SIGNATURE BANK	4,686	211.49	991,042.14
SVB FINANCIAL GROUP	4,545	492.02	2,236,230.90
TRUIST FINANCIAL CORP	103,413	49.13	5,080,680.69
US BANCORP	109,092	52.50	5,727,330.00
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	48.76	695,951.48
WELLS FARGO & CO	311,895	45.89	14,312,861.55
ALLY FINANCIAL INC	27,761	43.16	1,198,164.76
AMERICAN EXPRESS	51,483	169.60	8,731,516.80
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	278.49	2,423,419.98
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	26,880	60.32	1,621,401.60
BANK NEW YORK CO	61,254	46.48	2,847,085.92
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	101,985	319.11	32,544,433.35
BLACKROCK INC	11,820	666.53	7,878,384.60
BLACKSTONE INC	54,507	121.04	6,597,527.28
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,256	126.46	4,205,553.76
CARLYLE GROUP INC/THE	12,595	39.60	498,762.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	111.85	992,668.75
CME GROUP INC	27,828	199.93	5,563,652.04
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	2,868	75.32	216,017.76
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,403	112.20	2,625,816.60
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,355	30.89	844,995.95
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	388.01	1,221,455.48
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	27.55	718,228.50
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	36.18	156,152.88
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,636	328.58	8,752,056.88
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,703	102.70	4,590,998.10
INVESCO LTD	26,420	19.54	516,246.80
KKR & CO INC	39,913	56.04	2,236,724.52
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	287.89	923,263.23
MOODY'S CORP	13,365	307.49	4,109,603.85
MORGAN STANLEY	106,388	86.45	9,197,242.60

MSCI INC	6,518	448.17	2,921,172.06
NASDAQ INC	9,657	155.64	1,503,015.48
NORTHERN TRUST CORP	15,902	112.60	1,790,565.20
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	129.89	2,325,940.23
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	99.19	1,536,056.34
ROBINHOOD MARKETS INC - A	13,050	10.38	135,459.00
S&P GLOBAL INC	27,736	360.64	10,002,711.04
SCHWAB (CHARLES) CORP	112,432	70.59	7,936,574.88
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	58.45	558,197.50
SOFI TECHNOLOGIES INC	38,996	7.55	294,419.80
STATE STREET CORP	27,998	73.04	2,044,973.92
SYNCHRONY FINANCIAL	45,369	36.14	1,639,635.66
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	68.90	624,302.90
UPSTART HOLDINGS INC	3,148	50.33	158,438.84
AFLAC	50,591	60.41	3,056,202.31
ALLEGHANY CORP	906	834.00	755,604.00
ALLSTATE CORP	23,095	136.89	3,161,474.55
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	138.23	873,475.37
AMERICAN INT'L GROUP	65,898	59.00	3,887,982.00
AON PLC	17,508	281.68	4,931,653.44
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	47.46	1,410,795.96
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	165.64	2,709,704.76
ASSURANT INC	4,726	181.41	857,343.66
BROWN & BROWN INC	19,873	59.95	1,191,386.35
CHUBB LTD	33,670	210.89	7,100,666.30
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	128.42	1,642,620.22
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	167.20	362,155.20
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	284.79	936,389.52
FNF GROUP	20,461	42.29	865,295.69
GLOBE LIFE INC	8,106	98.10	795,198.60
HARTFORD FINANCIAL SVCS	27,721	72.70	2,015,316.70
LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	58.32	786,386.88
LOEWS CORP	16,741	65.93	1,103,734.13
MARKEL CORP	1,156	1,403.91	1,622,919.96
MARSH & MCLENNAN COS	39,216	161.19	6,321,227.04
METLIFE INC	57,127	67.72	3,868,640.44
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,719	72.94	1,511,243.86
PROGRESSIVE CORP	45,110	120.34	5,428,537.40
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,511	106.27	3,136,133.97
TRAVELERS COS INC/THE	19,772	177.83	3,516,054.76
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,061	214.84	2,161,505.24
WR BERKLEY CORP	17,572	70.80	1,244,097.60

CBRE GROUP INC-A	25,382	84.05	2,133,357.10
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.65	458,955.00
WEYERHAEUSER CO	58,295	40.34	2,351,620.30
ZILLOW GROUP INC-A	5,497	41.04	225,596.88
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	41.29	554,400.83
ACCENTURE PLC-CL A	49,381	304.15	15,019,231.15
ADOBE INC	37,107	428.22	15,889,959.54
AFFIRM HOLDINGS INC	12,816	30.35	388,965.60
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	102.73	1,404,627.29
ANSYS INC	6,794	264.62	1,797,828.28
ASANA INC - CL A	4,986	22.80	113,680.80
AUTODESK INC	17,467	211.38	3,692,174.46
AUTOMATIC DATA PROCESS	32,782	224.66	7,364,804.12
AVALARA INC	6,847	86.17	590,005.99
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	33.96	475,304.16
BILL.COM HOLDINGS INC	5,794	125.30	725,988.20
BLACK KNIGHT INC	11,543	68.68	792,773.24
BLOCK INC	39,674	90.52	3,591,290.48
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	146.80	1,430,125.60
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,922	156.24	3,425,093.28
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	57.92	617,890.56
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	126.18	1,025,086.32
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	100.95	1,054,321.80
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	58.91	1,194,871.53
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	40,421	74.73	3,020,661.33
COUPA SOFTWARE INC	6,059	72.58	439,762.22
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	14,479	166.82	2,415,386.78
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	146.16	453,096.00
DATADOG INC - CLASS A	17,059	98.07	1,672,976.13
DOCUSIGN INC	14,969	86.24	1,290,926.56
DROPBOX INC-CLASS A	28,845	21.13	609,494.85
DYNATRACE INC	14,790	38.19	564,830.10
EPAM SYSTEMS INC	4,403	340.35	1,498,561.05
FAIR ISAAC CORP	2,125	410.92	873,205.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	48,175	105.16	5,066,083.00
FISERV INC	46,421	101.37	4,705,696.77
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	249.48	1,497,378.96
FORTINET INC	10,645	297.87	3,170,826.15
GARTNER INC	6,340	266.59	1,690,180.60
GLOBAL PAYMENTS INC	22,567	132.25	2,984,485.75
GODADDY INC - CLASS A	13,798	75.20	1,037,609.60
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	82.58	521,740.44

HUBSPOT INC	3,646	352.44	1,284,996.24
INTL BUSINESS MACHINES CORP	69,612	139.27	9,694,863.24
INTUIT INC	21,247	422.48	8,976,432.56
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	188.09	1,183,274.19
MASTERCARD INC-CLASS A	68,686	357.78	24,574,477.08
MICROSOFT CORP	558,777	273.24	152,680,227.48
MONGODB INC	4,623	250.06	1,156,027.38
NORTONLIFELOCK INC	43,549	25.08	1,092,208.92
OKTA INC	11,505	86.06	990,120.30
ORACLE CORP	128,255	72.78	9,334,398.90
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	8.85	1,108,409.40
PALO ALTO NETWORKS INC	7,648	506.80	3,876,006.40
PAYCHEX INC	25,433	124.08	3,155,726.64
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	294.28	1,246,275.80
PAYPAL HOLDINGS INC	88,224	85.21	7,517,567.04
PTC INC	8,304	118.65	985,269.60
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	65.84	420,915.12
SALESFORCE INC	76,228	165.10	12,585,242.80
SERVICENOW INC	15,383	476.29	7,326,769.07
SNOWFLAKE INC-CLASS A	16,606	129.91	2,157,285.46
SPLUNK INC	13,355	108.50	1,449,017.50
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	64.76	1,252,134.60
SYNOPSYS INC	12,038	322.96	3,887,792.48
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,090	52.49	1,736,894.10
TWILIO INC - A	12,842	108.37	1,391,687.54
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	362.48	1,210,320.72
UNITY SOFTWARE INC	4,329	41.32	178,874.28
VERISIGN INC	7,790	176.32	1,373,532.80
VISA INC-CLASS A SHARES	130,637	212.88	27,810,004.56
VMWARE INC-CLASS A	16,717	129.26	2,160,839.42
WESTERN UNION CO	29,297	17.99	527,053.03
WIX.COM LTD	5,010	66.81	334,718.10
WORKDAY INC-CLASS A	14,681	158.79	2,331,195.99
ZENDESK INC	8,890	99.03	880,376.70
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,028	110.42	1,880,231.76
ZSCALER INC	6,234	160.00	997,440.00
AMPHENOL CORPORATION	45,988	71.33	3,280,324.04
APPLE INC	1,284,469	149.64	192,207,941.16
ARISTA NETWORKS INC	18,880	105.87	1,998,825.60
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	121.33	740,113.00
CDW CORP/DE	10,882	171.10	1,861,910.20
CISCO SYSTEMS	328,253	45.62	14,974,901.86

COGNEX CORP	14,352	49.30	707,553.60
CORNING	64,989	35.65	2,316,857.85
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	49.58	1,114,607.98
F5 INC	4,150	167.29	694,253.50
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	98,742	15.79	1,559,136.18
HP INC	92,346	38.75	3,578,407.50
IPG PHOTONICS CORP	3,207	102.50	328,717.50
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	31.22	790,521.62
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,989	145.23	2,176,852.47
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,961	223.01	2,890,432.61
NETAPP INC	18,303	73.05	1,337,034.15
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	15,060	88.17	1,327,840.20
TE CONNECTIVITY LTD	26,068	129.49	3,375,545.32
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	398.21	1,552,620.79
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	69.23	1,466,014.48
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	62.25	1,605,427.50
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	343.53	1,429,771.86
AT&T INC	555,579	21.29	11,828,276.91
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	25.02	388,210.32
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	26.08	716,860.96
LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	12.50	922,112.50
T-MOBILE US INC	49,657	134.11	6,659,500.27
VERIZON COMMUNICATIONS	322,452	51.40	16,574,032.80
AES CORP	54,375	22.43	1,219,631.25
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	63.78	1,325,220.84
AMEREN CORPORATION	20,898	96.55	2,017,701.90
AMERICAN ELECTRIC POWER	38,104	103.57	3,946,431.28
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,174	151.76	2,151,046.24
ATMOS ENERGY CORP	9,688	117.64	1,139,696.32
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	32.42	1,561,412.04
CMS ENERGY CORP	23,697	71.47	1,693,624.59
CONSOLIDATED EDISON INC	27,507	100.58	2,766,654.06
CONSTELLATION ENERGY	25,732	66.60	1,713,751.20
DOMINION ENERGY INC	62,375	85.16	5,311,855.00
DTE ENERGY COMPANY	14,651	134.30	1,967,629.30
DUKE ENERGY CORP	59,845	114.40	6,846,268.00
EDISON INTL	28,027	70.06	1,963,571.62
ENTERGY CORP	15,166	121.08	1,836,299.28
ESSENTIAL UTILITIES INC	17,002	46.41	789,062.82
EVERGY INC	18,475	70.57	1,303,780.75
EVERSOURCE ENERGY	26,753	93.30	2,496,054.90
EXELON CORP	77,196	49.85	3,848,220.60

	FIRSTENERGY CORP	41,156	43.43	1,787,405.08	
	NEXTERA ENERGY INC	152,538	77.43	11,811,017.34	
	NISOURCE INC	28,687	31.76	911,099.12	
	NRG ENERGY INC	19,068	46.45	885,708.60	
	PG&E CORP	118,132	12.35	1,458,930.20	
	PPL CORPORATION	58,459	30.36	1,774,815.24	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	69.04	2,724,870.72	
	SEMPRA ENERGY	24,535	166.65	4,088,757.75	
	SOUTHERN CO	84,113	76.07	6,398,475.91	
	UGI CORP	18,019	42.76	770,492.44	
	VISTRA CORP	37,797	26.31	994,439.07	
	WEC ENERGY GROUP INC	24,561	106.53	2,616,483.33	
	XCEL ENERGY INC	43,741	76.34	3,339,187.94	
	ADVANCED MICRO DEVICES	127,867	102.26	13,075,679.42	
	ANALOG DEVICES	41,625	167.55	6,974,268.75	
	APPLIED MATERIALS	71,368	119.48	8,527,048.64	
	BROADCOM INC	32,460	583.28	18,933,268.80	
	ENPHASE ENERGY INC	10,113	188.95	1,910,851.35	
	ENTEGRIS INC	10,491	112.86	1,184,014.26	
	INTEL CORP	318,822	44.55	14,203,520.10	
	KLA CORP	12,119	371.27	4,499,421.13	
	LAM RESEARCH CORP	10,992	531.02	5,836,971.84	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	63,360	60.82	3,853,555.20	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	42,031	72.79	3,059,436.49	
	MICRON TECHNOLOGY	87,336	73.32	6,403,475.52	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	455.85	1,609,606.35	
	NVIDIA CORP	196,119	188.11	36,891,945.09	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	20,848	195.93	4,084,748.64	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	31,766	61.14	1,942,173.24	
	QORVO INC	8,556	112.19	959,897.64	
	QUALCOMM	87,800	139.76	12,270,928.00	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	108.71	1,453,670.12	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	3,750	280.36	1,051,350.00	
	TERADYNE INC	12,318	109.40	1,347,589.20	
	TEXAS INSTRUMENTS	71,796	177.97	12,777,534.12	
	アメリカドル 小計	25,007,719		2,826,337,064.59 (359,001,333,944)	
カナダドル	CAMECO CORP	26,880	32.11	863,116.80	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,194	84.99	7,920,558.06	
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	28.80	2,783,980.80	
	ENBRIDGE	156,497	58.78	9,198,893.66	
	IMPERIAL OIL	16,573	71.05	1,177,511.65	

KEYERA CORP	18,607	33.72	627,428.04
PARKLAND CORP	14,075	36.60	515,145.00
PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	51.27	2,341,295.82
SUNCOR ENERGY	116,208	51.66	6,003,305.28
TC ENERGY CORP	77,328	73.13	5,654,996.64
TOURMALINE OIL CORP	22,173	77.86	1,726,389.78
AGNICO EAGLE MINES	36,354	68.75	2,499,337.50
BARRICK GOLD CORP	139,009	26.18	3,639,255.62
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	60.48	794,646.72
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	36.34	1,562,620.00
FRANCO-NEVADA CORP	15,363	181.16	2,783,161.08
IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	9.95	515,877.65
KINROSS GOLD CORP	108,451	5.79	627,931.29
LUNDIN MINING CORP	62,243	11.05	687,785.15
NUTRIEN LTD	44,786	121.57	5,444,634.02
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	28.89	531,893.79
TECK RESOURCES LTD-CL B	34,747	54.99	1,910,737.53
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,800	115.62	901,836.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,238	53.97	1,847,824.86
BALLARD POWER SYSTEMS INC	19,724	9.96	196,451.04
CAE INC	25,999	31.73	824,948.27
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,585	110.52	617,254.20
WSP GLOBAL INC	8,602	138.30	1,189,656.60
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	39.06	527,505.30
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	76.31	781,795.95
THOMSON REUTERS CORP	13,293	125.59	1,669,467.87
AIR CANADA	13,805	22.25	307,161.25
CANADIAN NATL RAILWAY CO	55,489	145.11	8,052,008.79
CP RAILWAY LIMITED	73,737	90.63	6,682,784.31
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	103.46	603,896.02
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	81.38	1,894,689.16
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	39.30	671,204.70
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	65.05	1,500,898.65
QUEBECOR INC -CL B	15,200	28.93	439,736.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	35.98	1,274,483.56
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,579	170.37	609,754.23
DOLLARAMA INC	22,000	71.41	1,571,020.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	67,467	57.03	3,847,643.01
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	40.97	624,915.41
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	116.07	1,498,811.91
METRO INC	18,840	69.87	1,316,350.80
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	154.60	807,939.60



	SAPUTO INC	20,898	25.39	530,600.22
	BAUSCH HEALTH COS INC	20,800	12.56	261,248.00
	CANOPY GROWTH CORP	20,989	6.15	129,082.35
	BANK MONTREAL	51,389	136.52	7,015,626.28
	BANK NOVA SCOTIA	96,500	85.30	8,231,450.00
	CANADIAN IMPERIAL BANK	68,988	69.18	4,772,589.84
	NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	97.10	2,649,761.90
	ROYAL BANK OF CANADA	110,677	130.95	14,493,153.15
	TORONTO-DOMINION BANK	141,487	95.99	13,581,337.13
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	110,505	64.29	7,104,366.45
	IGM FINANCIAL INC	7,685	38.28	294,181.80
	ONEX CORP	6,603	75.29	497,139.87
	TMX GROUP LTD	4,685	137.81	645,639.85
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	696.00	1,484,568.00
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	34.47	819,972.36
	IA FINANCIAL CORP INC	10,099	64.79	654,314.21
	INTACT FINANCIAL CORP	13,312	180.22	2,399,088.64
	MANULIFE FINANCIAL CORP	147,886	23.16	3,425,039.76
	POWER CORP OF CANADA	43,577	36.73	1,600,583.21
	SUN LIFE FINANCIAL INC	45,702	63.38	2,896,592.76
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	160.03	430,480.70
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	8.34	328,596.00
	CGI INC - CL A	16,178	108.54	1,755,960.12
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,527	1,969.07	3,006,769.89
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	32.96	273,436.16
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	65.39	281,242.39
	OPEN TEXT CORP	20,463	50.44	1,032,153.72
	SHOPIFY INC - CLASS A	8,756	469.32	4,109,365.92
	BCE INC	6,203	68.82	426,890.46
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	26,167	65.63	1,717,340.21
	TELUS CORP	32,908	31.49	1,036,272.92
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	18.47	957,078.46
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	30.47	743,315.65
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	47.98	541,934.10
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	39.86	411,514.64
	EMERA INC	18,723	63.32	1,185,540.36
	FORTIS INC	36,823	63.79	2,348,939.17
	HYDRO ONE LTD	23,269	35.32	821,861.08
	NORTHLAND POWER INC	17,854	38.83	693,270.82
	カナダドル 小計	3,134,792		195,658,837.92 (19,540,448,143)
ユーロ	ENI	197,669	14.19	2,805,318.44

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	27,945	12.16	339,811.20
NESTE OIL OYJ	32,126	43.53	1,398,444.78
OMV AG	12,549	53.86	675,889.14
REPSOL SA	111,112	14.99	1,665,568.88
TENARIS SA	40,648	16.03	651,587.44
TOTALENERGIES SE	194,564	54.88	10,677,672.32
AIR LIQUIDE	36,913	165.66	6,115,007.58
AKZO NOBEL	15,301	82.46	1,261,720.46
ARCELORMITTAL	55,231	30.44	1,681,507.79
ARKEMA	4,369	113.30	495,007.70
BASF SE	71,168	51.11	3,637,396.48
COVESTRO AG	14,454	42.18	609,669.72
CRH PLC	59,653	38.74	2,311,255.48
EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	24.97	400,443.89
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	28.30	163,064.60
HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	54.20	706,822.20
KONINKLIJKE DSM NV	13,707	141.90	1,945,023.30
LANXESS	7,293	38.21	278,665.53
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	38.28	746,613.12
SOLVAY SA	5,356	91.48	489,966.88
STORA ENSO OYJ R	42,169	18.78	792,144.66
SYMRISE AG	9,776	104.25	1,019,148.00
UMICORE	17,605	42.16	742,226.80
UPM KYMMENE OYJ	42,324	33.57	1,420,816.68
VOESTALPINE AG	7,152	27.90	199,540.80
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	21,143	26.60	562,403.80
AIRBUS SE	45,872	111.86	5,131,241.92
ALSTOM	24,388	26.01	634,331.88
BOUYGUES ORD	16,606	32.76	544,012.56
BRENTAG SE	12,514	73.18	915,774.52
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	13.90	1,126,261.40
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,388	29.05	969,921.40
DASSAULT AVIATION SA	2,130	158.00	336,540.00
EIFFAGE	5,924	94.62	560,528.88
FERROVIAL SA	33,914	24.21	821,057.94
FERROVIAL SA-RTS	33,914	0.27	9,183.91
GEA GROUP AG	13,382	37.77	505,438.14
IMCD NV	4,641	140.20	650,668.20
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	76.24	945,223.52
KION GROUP AG	5,887	45.34	266,916.58
KNORR-BREMSE AG	5,022	64.30	322,914.60
KONE OYJ-B	26,311	47.96	1,261,875.56

LEGRAND SA	21,768	82.18	1,788,894.24
MTU AERO ENGINES AG	3,962	189.00	748,818.00
PRYSMIAN SPA	21,155	30.40	643,112.00
RATIONAL AG	483	589.50	284,728.50
SAFRAN SA	26,190	99.54	2,606,952.60
SAINT-GOBAIN	40,093	55.16	2,211,529.88
SCHNEIDER ELECTRIC SE	41,726	127.80	5,332,582.80
SIEMENS	59,486	121.86	7,248,963.96
SIEMENS ENERGY AG	26,851	17.62	473,114.62
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	17.94	402,483.90
THALES SA	7,437	117.65	874,963.05
VINCI S.A.	41,084	92.73	3,809,719.32
WARTSILA OYJ	41,917	7.90	331,228.13
BUREAU VERITAS SA	25,073	26.90	674,463.70
RANDSTAD NV	7,558	52.56	397,248.48
TELEPERFORMANCE	4,734	311.20	1,473,220.80
WOLTERS KLUWER	20,839	93.16	1,941,361.24
ADP	2,382	139.00	331,098.00
AENA SME SA	5,508	142.75	786,267.00
ATLANTIA SPA	35,937	22.62	812,894.94
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	6.88	312,005.18
DEUTSCHE POST AG-REG	78,714	38.10	2,999,003.40
GETLINK	29,362	18.45	541,875.71
INPOST SA	12,480	6.34	79,223.04
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,107	80.77	2,108,662.39
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	73.75	368,086.25
CONTINENTAL AG	8,168	70.40	575,027.20
FAURECIA	10,948	25.37	277,750.76
FERRARI NV	10,170	187.20	1,903,824.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	66,777	66.02	4,408,617.54
MICHELIN	13,839	120.30	1,664,831.70
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	73.42	862,317.90
RENAULT SA	17,362	25.18	437,261.97
STELLANTIS NV	159,744	13.74	2,196,160.51
VALEO SA	21,538	19.87	428,067.75
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,282	152.24	2,174,291.68
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	197.10	489,990.60
ADIDAS AG	14,703	179.96	2,645,951.88
ESSILORLUXOTTICA	22,072	152.70	3,370,394.40
HERMES INTERNATIONAL	2,539	1,092.00	2,772,588.00
KERING	5,855	489.00	2,863,095.00
LVMH	21,584	593.40	12,807,945.60

MONCLER SPA	14,361	43.09	618,815.49
PUMA SE	9,220	66.56	613,683.20
SEB SA	2,282	100.90	230,253.80
ACCOR	14,436	30.68	442,896.48
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,048	112.65	1,469,857.20
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	35.01	283,861.08
SODEXO	6,027	71.82	432,859.14
BOLLORE SE	83,646	5.00	418,648.23
PUBLICIS GROUPE	17,077	51.76	883,905.52
SCOUT24 SE	7,492	57.86	433,487.12
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	48.43	342,448.53
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	61,243	20.86	1,277,528.98
VIVENDI SE	61,243	11.03	675,510.29
DELIVERY HERO SE	13,414	34.13	457,819.82
INDITEX	87,326	22.29	1,946,496.54
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	20.13	313,464.36
PROSUS	72,497	45.87	3,325,437.39
ZALANDO SE	17,664	37.48	662,046.72
CARREFOUR	52,544	19.10	1,003,853.12
COLRUYT SA	5,424	30.40	164,889.60
HELLOFRESH SE	13,805	34.81	480,552.05
JERONIMO MARTINS	24,901	19.33	481,336.33
KESKO OYJ-B SHS	20,083	23.05	462,913.15
KONINKLIJKE AHOLD NV	79,170	25.74	2,038,231.65
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	68,711	52.87	3,632,750.57
DANONE (GROUPE)	51,543	54.76	2,822,494.68
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	9.89	485,371.53
HEINEKEN HOLDING NV	9,251	72.80	673,472.80
HEINEKEN NV	20,157	92.68	1,868,150.76
JDE PEET'S BV	7,000	27.38	191,660.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	97.90	1,277,595.00
PERNOD-RICARD	15,976	183.45	2,930,797.20
REMY COINTREAU	1,382	170.10	235,078.20
BEIERSDORF AG	7,430	95.32	708,227.60
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	60.70	532,946.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	61.66	890,308.74
LOREAL	19,839	324.80	6,443,707.20
AMPLIFON SPA	11,650	32.37	377,110.50
BIOMERIEUX	3,044	98.14	298,738.16
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	125.00	428,750.00
DIASORIN SPA	2,070	121.45	251,401.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	14,472	56.58	818,825.76

FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	32.51	1,095,229.39
KONINKLIJKE PHILIPS	71,755	23.68	1,699,517.17
ORPEA	4,336	26.68	115,684.48
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	362.90	661,929.60
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	56.28	1,213,790.76
ARGENX SE	3,428	300.30	1,029,428.40
BAYER	76,002	66.58	5,060,213.16
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	87.78	897,111.60
GRIFOLS SA	27,685	19.85	549,547.25
IPSEN	3,532	95.40	336,952.80
MERCK KGAA	10,555	178.20	1,880,901.00
ORION OYJ-CLASS B	9,854	37.76	372,087.04
QIAGEN N.V.	17,038	44.05	750,523.90
RECORDATI SPA	9,859	42.09	414,965.31
SANOFI	88,048	102.38	9,014,354.24
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,939	321.50	623,388.50
UCB (GROUPE)	9,389	82.82	777,596.98
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	10.74	428,951.14
BANCO BILBAO VIZCAYA	534,866	5.04	2,696,259.50
BANCO SANTANDER SA	1,339,491	3.04	4,072,052.64
BNP PARIBAS	86,730	53.55	4,644,391.50
CAIXABANK	330,447	3.36	1,111,623.70
COMMERZBANK AG	81,889	8.08	661,663.12
CREDIT AGRICOLE SA	89,515	11.25	1,007,401.81
ERSTE GROUP BANK AG	23,905	29.11	695,874.55
FINECOBANK SPA	53,120	13.06	694,012.80
ING GROEP NV-CVA	301,618	10.19	3,073,487.42
INTESA SANPAOLO	1,251,055	2.04	2,560,909.58
KBC GROEP NV	18,608	58.28	1,084,474.24
MEDIOBANCA	53,990	9.52	514,416.72
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	12.33	154,001.70
SOCIETE GENERALE	63,329	24.88	1,575,625.52
UNICREDIT SPA	168,352	10.81	1,821,231.93
AMUNDI SA	4,626	53.50	247,491.00
DEUTSCHE BANK NAMEN	160,613	10.39	1,669,090.29
DEUTSCHE BOERSE	14,999	163.75	2,456,086.25
EURAZEO SA	3,357	72.70	244,053.90
EURONEXT NV	6,480	79.36	514,252.80
EXOR NV	7,825	70.00	547,750.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	86.92	740,123.80
SOFINA	1,238	221.40	274,093.20
WENDEL	2,023	95.50	193,196.50

AEGON	114,647	5.07	581,948.17
AGEAS	11,086	46.62	516,829.32
ALLIANZ SE-REG	32,037	200.20	6,413,807.40
ASSICURAZIONI GENERALI	85,637	17.08	1,462,679.96
AXA SA	148,584	24.27	3,606,133.68
CNP ASSURANCES	16,287	20.92	340,724.04
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	143.80	623,085.40
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,795	228.30	2,464,498.50
NN GROUP NV	22,611	46.94	1,061,360.34
POSTE ITALIANE SPA	46,035	9.93	457,219.62
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	43.08	1,665,257.40
AROUNDTOWN SA	64,068	4.32	277,350.37
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	94.24	497,116.00
VONOVIA SE	59,080	35.57	2,101,475.60
ADYEN NV	1,566	1,517.20	2,375,935.20
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,584	60.34	2,147,138.56
BECHTLE AG	7,659	41.69	319,303.71
CAPGEMINI SA	12,715	186.60	2,372,619.00
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	39.42	2,080,338.97
EDENRED	18,664	46.18	861,903.52
NEMETSCHKE SE	5,455	67.66	369,085.30
NEXI SPA	31,458	9.70	305,142.60
SAP SE	81,213	93.99	7,633,209.87
WORLDLINE SA	20,332	39.85	810,230.20
NOKIA OYJ	427,600	4.81	2,059,321.60
CELLNEX TELECOM SA	41,435	43.29	1,793,721.15
DEUTSCHE TELEKOM	258,113	19.08	4,924,796.04
ELISA A	10,227	54.04	552,667.08
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	10.43	316,963.12
KPN (KON.)	282,927	3.37	955,727.40
ORANGE	153,815	11.70	1,800,250.76
PROXIMUS	13,141	16.45	216,169.45
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.28	239,055.58
TELEFONICA	417,939	4.94	2,067,544.23
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.89	286,174.78
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	30.88	293,761.44
E.ON SE	170,377	9.65	1,644,138.05
EDP RENOVAVEIS SA	21,466	22.75	488,351.50
ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	8.44	333,794.36
ELIA GROUP SA/NV	2,925	153.40	448,695.00
ENAGAS	15,690	21.72	340,786.80
ENDESA	25,972	20.86	541,775.92

	ENEL	617,915	6.18	3,822,422.19
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.71	1,065,102.65
	ENGIE	141,564	12.70	1,797,862.80
	FORTUM OYJ	32,550	17.55	571,252.50
	IBERDROLA SA	449,446	11.30	5,080,987.03
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	28.38	284,083.80
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	19.42	595,766.76
	RWE STAMM	49,680	40.46	2,010,052.80
	SNAM SPA	147,559	5.47	808,033.08
	TERNA SPA	102,810	8.02	824,741.82
	UNIPER SE	7,335	24.22	177,653.70
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	51,027	26.56	1,355,277.12
	VERBUND AG	6,430	90.35	580,950.50
	ASM INTERNATIONAL NV	3,483	286.80	998,924.40
	ASML HOLDING NV	32,248	541.30	17,455,842.40
	INFINEON TECHNOLOGIES	101,861	29.00	2,954,478.30
	STMICROELECTRONICS	55,076	37.27	2,052,957.90
	ユーロ 小計	14,462,263		345,843,642.22 (47,135,029,998)
イギリスポンド	BP PLC	1,555,608	4.30	6,699,225.85
	SHELL PLC-NEW	598,230	23.80	14,237,874.00
	ANGLO AMERICAN PLC	102,156	38.03	3,884,992.68
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	14.70	527,083.20
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	68.82	751,789.68
	GLENCORE PLC	767,331	5.26	4,037,695.72
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	21.13	355,998.24
	MONDI PLC	36,710	15.60	572,859.55
	RIO TINTO PLC REG	87,100	57.02	4,966,442.00
	ASHTREAD GROUP PLC	34,104	41.20	1,405,084.80
	BAE SYSTEMS PLC	260,104	7.66	1,994,477.47
	BUNZL PLC	24,880	28.58	711,070.40
	DCC PLC	6,622	56.16	371,891.52
	FERGUSON PLC	17,761	95.44	1,695,109.84
	MELROSE INDUSTRIES PLC	319,777	1.29	412,512.33
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	0.86	552,668.51
	SMITHS GROUP PLC	26,476	15.54	411,569.42
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	105.65	582,554.10
	EXPERIAN PLC	74,115	26.95	1,997,399.25
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	46.75	649,357.50
	RELX PLC	149,517	22.83	3,413,473.11
	RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	5.09	715,324.16
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	5.03	368,645.27

BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7,688	42.35	325,586.80
BURBERRY GROUP PLC	29,776	16.70	497,408.08
PERSIMMON PLC	25,686	22.37	574,595.82
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.30	343,995.46
COMPASS GROUP PLC	142,427	17.99	2,562,973.86
ENTAIN PLC	49,630	14.33	711,197.90
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,541	49.36	619,023.76
WHITBREAD PLC	17,434	27.30	475,948.20
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	5.76	417,960.81
INFORMA PLC	110,598	5.48	606,077.04
PEARSON	66,305	7.42	492,513.54
WPP PLC	95,821	9.26	887,685.74
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.19	248,086.58
KINGFISHER PLC	153,717	2.65	408,426.06
NEXT PLC	11,468	65.40	750,007.20
OCADO GROUP PLC	35,862	9.01	323,260.06
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.31	342,802.18
TESCO PLC	601,050	2.58	1,553,714.25
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	17.36	446,846.40
BRITISH AMERICAN TOBACCO	168,277	35.50	5,974,674.88
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	17.55	315,287.80
DIAGEO	180,509	36.43	6,576,845.41
IMPERIAL BRANDS PLC	76,080	17.97	1,367,157.60
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	54,630	61.18	3,342,263.40
UNILEVER PLC	201,915	34.75	7,017,555.82
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	12.96	888,991.20
ASTRAZENECA	120,234	105.80	12,720,757.20
GSK PLC	388,893	17.33	6,740,293.47
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	16.88	277,825.79
BARCLAYS	1,339,545	1.70	2,282,316.77
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,583,882	5.32	8,432,587.76
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,443,807	0.45	2,462,506.09
NATWEST GROUP PLC	443,701	2.27	1,008,088.67
STANDARD CHARTERED PLC	212,446	6.27	1,332,036.42
3I GROUP PLC	74,757	12.82	958,758.52
ABRDN PLC	153,430	1.96	300,952.94
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	8.52	281,833.08
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	24,732	75.58	1,869,244.56
M&G PLC	229,107	2.17	499,224.15
SCHRODERS PLC	11,794	29.36	346,271.84
ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	12.67	518,838.45
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	22.38	363,786.90



	AVIVA PLC	225,378	4.40	993,691.60	
	LEGAL & GENERAL GROUP	460,759	2.62	1,208,110.09	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.46	329,568.46	
	PRUDENTIAL	210,968	10.30	2,172,970.40	
	AVEVA GROUP PLC	10,917	22.73	248,143.41	
	SAGE GROUP PLC	76,660	6.73	515,921.80	
	HALMA PLC	31,069	22.65	703,712.85	
	BT GROUP PLC	716,738	1.84	1,320,589.76	
	VODAFONE GROUP PLC	2,204,746	1.30	2,869,256.44	
	NATIONAL GRID PLC	286,046	11.64	3,329,575.44	
	SEVERN TRENT PLC	22,468	29.39	660,334.52	
	SSE PLC	81,663	17.52	1,431,144.07	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.44	611,575.20	
	イギリスボンド 小計	22,408,592		146,175,901.10 (23,445,152,777)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	18.50	321,863.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	805.00	462,070.00	
	GIVAUDAN-REG	748	3,569.00	2,669,612.00	
	HOLCIM LTD	40,627	48.00	1,950,096.00	
	SIKA AG-BR	10,926	267.00	2,917,242.00	
	ABB LTD	127,656	29.36	3,747,980.16	
	GEBERIT AG-REG	2,964	531.20	1,574,476.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,375	194.00	266,750.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	196.80	608,505.60	
	VAT GROUP AG	1,956	278.00	543,768.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	10,450	37.15	388,217.50	
	SGS SA	506	2,416.00	1,222,496.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	257.50	1,178,577.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,341	103.85	4,293,262.85	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	235.10	583,753.30	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	44.56	175,477.28	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,152.00	602,560.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	99,900.00	799,200.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	9,540.00	782,280.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	219,354	116.58	25,572,289.32	
	ALCON INC	39,333	71.64	2,817,816.12	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,007	342.00	1,370,394.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	119.70	1,022,238.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	73.70	136,345.00	
	LONZA GROUP AG-REG	5,895	572.80	3,376,656.00	
	NOVARTIS	170,286	87.12	14,835,316.32	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,799	375.20	1,050,184.80	

	ROCHE HOLDING GENUSS	54,689	329.80	18,036,432.20
	VIFOR PHARMA AG/NEW	3,360	166.20	558,432.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	6.96	1,486,147.33
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	49.26	930,866.22
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	1,048.00	1,920,984.00
	UBS GROUP AG	271,096	17.98	4,875,661.56
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,174	166.50	528,471.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	555.60	1,343,996.40
	SWISS RE LTD	22,836	80.36	1,835,100.96
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,660	441.70	5,150,222.00
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	100.10	568,467.90
	TEMENOS AG - REG	5,150	95.36	491,104.00
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	57.06	837,983.16
	SWISSCOM	2,187	574.40	1,256,212.80
	スイスフラン 小計	1,354,054		115,089,509.08 (15,259,718,008)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	459.20	7,908,342.40
	BOLIDEN AB	18,479	407.70	7,533,888.30
	SCA SV CELLULOSA B	43,887	180.95	7,941,352.65
	ALFA LAVAL AB	27,268	253.20	6,904,257.60
	ASSA ABLOY AB-B	78,158	241.60	18,882,972.80
	ATLAS COPCO A	205,280	107.16	21,997,804.80
	ATLAS COPCO B	127,608	93.36	11,913,482.88
	EPIROC AB-A	46,999	191.95	9,021,458.05
	EPIROC AB-B	28,804	168.75	4,860,675.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	89.24	3,454,658.88
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	240.00	3,360,480.00
	LIFCO AB-B SHS	17,970	198.40	3,565,248.00
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	107,624	88.34	9,507,504.16
	SANDVIK AB	87,644	201.60	17,669,030.40
	SKANSKA B	25,507	170.35	4,345,117.45
	SKF AB-B	24,865	174.55	4,340,185.75
	VOLVO AB-A SHS	13,514	183.30	2,477,116.20
	VOLVO B	111,799	173.46	19,392,654.54
	SECURITAS B	29,533	106.95	3,158,554.35
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	151.74	3,227,358.06
	EVOLUTION AB	14,096	1,017.40	14,341,270.40
	EMBRACER GROUP AB	37,510	87.17	3,269,746.70
	HENNES & MAURITZ B	55,229	132.50	7,317,842.50
	SWEDISH MATCH AB	127,270	101.90	12,968,813.00
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	253.90	12,561,448.60
	GETINGE AB-B SHS	17,796	280.00	4,982,880.00

	NORDEA BANK ABP	253,851	103.76	26,339,579.76	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	120,740	111.55	13,468,547.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	110,736	98.46	10,903,066.56	
	SWEDBANK AB-A	72,526	151.15	10,962,304.90	
	EQT AB	23,207	280.50	6,509,563.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	258.70	3,057,316.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	255.30	2,851,190.40	
	INVESTOR AB-A SHS	38,925	200.30	7,796,677.50	
	INVESTOR AB-B SHS	142,777	182.74	26,091,068.98	
	KINNEVIK AB - B	18,792	191.50	3,598,668.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	486.90	3,544,632.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	73.63	4,174,821.00	
	SAGAX AB-B	12,402	278.00	3,447,756.00	
	SINCH AB	44,150	46.84	2,068,206.75	
	ERICSSON (LM) B	225,508	81.40	18,356,351.20	
	HEXAGON AB-B SHS	153,838	120.80	18,583,630.40	
	TELE2 AB-B SHS	32,829	121.65	3,993,647.85	
	TELIA CO AB	230,643	40.61	9,366,412.23	
	スウェーデンクローナ 小計	2,955,409		402,017,584.10 (5,202,107,538)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	6,114	389.20	2,379,568.80	
	EQUINOR ASA	76,370	352.75	26,939,517.50	
	NORSK HYDRO	96,800	74.60	7,221,280.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	483.80	6,046,532.40	
	ADEVINTA ASA	19,117	72.05	1,377,379.85	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,274	166.40	1,543,193.60	
	SCHIBSTED ASA-CL A	7,082	189.70	1,343,455.40	
	MOWI ASA	31,968	243.20	7,774,617.60	
	ORKLA	69,804	73.54	5,133,386.16	
	DNB BANK ASA	71,795	193.85	13,917,460.75	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	208.80	3,878,251.20	
	TELENOR ASA	51,193	130.30	6,670,447.90	
	ノルウェークローネ 小計	470,589		84,225,091.16 (1,128,616,221)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	513.60	4,356,868.80	
	NOVOZYMES A/S	17,111	425.90	7,287,574.90	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,879.00	1,418,645.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	81,654	168.06	13,722,771.24	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	20,160.00	4,415,040.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	20,300.00	8,810,200.00	
	DSV A/S	16,380	1,093.00	17,903,340.00	
	PANDORA A/S	8,163	505.60	4,127,212.80	

	CARLSBERG AS-B	7,077	868.80	6,148,497.60
	AMBU A/S-B	13,555	88.24	1,196,093.20
	COLOPLAST-B	9,208	801.60	7,381,132.80
	DEMANT A/S	8,512	282.00	2,400,384.00
	GN STORE NORD A/S	9,226	256.10	2,362,778.60
	GENMAB A/S	5,250	2,111.00	11,082,750.00
	NOVO NORDISK A/S-B	132,369	738.60	97,767,743.40
	DANSKE BANK A/S	56,132	111.45	6,255,911.40
	TRYG A/S	29,772	159.50	4,748,634.00
	ORSTED A/S	15,439	787.10	12,152,036.90
	デンマーククローネ 小計	419,739		213,537,614.64 (3,912,009,100)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	34.00	701,386.00
	SANTOS	236,159	8.24	1,945,950.16
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	25.67	328,909.71
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	146,194	30.14	4,406,287.16
	BHP GROUP LTD	397,288	43.67	17,349,566.96
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	18.17	631,770.90
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	3.73	455,634.42
	FORTECUE METALS GROUP LTD	127,366	19.59	2,495,099.94
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	35.95	1,328,280.60
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	61.29	883,127.61
	NEWCREST MINING LIMITED	61,178	24.74	1,513,543.72
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	8.72	886,196.16
	ORICA LTD	38,288	16.55	633,666.40
	RIO TINTO LTD	28,818	113.39	3,267,673.02
	SOUTH32 LTD	341,133	4.71	1,606,736.43
	REECE LTD	16,814	15.23	256,077.22
	BRAMBLES LTD	108,007	10.97	1,184,836.79
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.98	475,972.18
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.46	464,100.00
	TRANSURBAN GROUP	233,493	14.39	3,359,964.27
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	34.63	1,600,252.30
	CROWN RESORTS LTD	30,328	12.90	391,231.20
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	68.72	243,337.52
	IDP EDUCATION LTD	17,793	23.20	412,797.60
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.80	873,662.40
	REA GROUP LTD	3,586	112.74	404,285.64
SEEK LTD	28,001	24.65	690,224.65	
WESFARMERS LTD	87,120	46.73	4,071,117.60	
COLES GROUP LTD	108,486	17.50	1,898,505.00	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	7.25	796,782.25	

	WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	34.17	3,413,617.17	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	45,808	11.69	535,495.52	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	218.50	1,045,085.50	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	78.41	1,274,005.68	
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	36.51	1,360,034.01	
	CSL LIMITED	37,659	269.02	10,131,024.18	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	225,511	25.68	5,791,122.48	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	134,082	106.63	14,297,163.66	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	253,530	31.68	8,031,830.40	
	WESTPAC BANKING	283,793	24.09	6,836,573.37	
	ASX LTD	14,549	81.56	1,186,616.44	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	27,074	183.00	4,954,542.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	168,725	4.47	754,200.75	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.19	740,663.77	
	QBE INSURANCE GROUP	111,591	12.40	1,383,728.40	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	12.26	1,163,032.64	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	22.84	1,013,547.84	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	41.67	575,087.67	
	XERO LTD	11,340	87.47	991,909.80	
	TELSTRA CORP	308,467	3.91	1,206,105.97	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	119,082	6.84	814,520.88	
	オーストラリアドル 小計	5,184,277		123,056,883.94 (11,200,637,576)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.26	855,743.46	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	19.50	779,610.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	10.10	366,801.70	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.69	812,789.01	
	MERCURY NZ LTD	64,613	5.60	361,832.80	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.42	488,604.48	
	ニュージーランドドル 小計	542,443		3,665,381.45 (304,593,198)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	193,996	55.95	10,854,076.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	100.10	10,710,700.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	19.44	3,343,680.00	
	MTR CORP	125,000	43.00	5,375,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	30.10	3,612,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	40.90	7,116,600.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	14.20	2,811,600.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	12.62	2,173,164.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	19.84	2,894,656.00	
	WH GROUP LTD	474,801	5.92	2,810,821.92	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	30.85	8,684,275.00	

	HANG SENG BANK	59,400	138.90	8,250,660.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,800	330.80	31,690,640.00	
	AIA GROUP LTD	933,800	79.25	74,003,650.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	52.25	8,594,916.00	
	ESR CAYMAN LTD	157,000	22.85	3,587,450.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	14.68	2,539,640.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	33.10	4,145,046.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	29.85	4,070,793.75	
	SINO LAND CO	315,400	11.26	3,551,404.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	96.90	10,465,200.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	46.50	1,883,250.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	19.16	1,843,192.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	37.95	4,516,050.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	52.55	3,547,125.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	79.50	10,931,250.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	8.76	7,924,795.32	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	52.35	5,863,200.00	
	香港ドル 小計	5,910,253		247,794,835.99 (4,009,320,446)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	137,300	6.80	933,640.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	4.05	596,970.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.50	595,826.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.78	482,775.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.16	742,976.00	
	DBS GROUP	141,500	31.10	4,400,650.00	
	OCBC BANK	257,100	11.70	3,008,070.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	29.38	2,758,782.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	45,100	9.85	444,235.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.90	871,650.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	8.21	351,388.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.45	353,875.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	17.45	448,465.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	584,543	2.70	1,578,266.10	
	シンガポールドル 小計	2,648,275		17,567,568.10 (1,630,621,671)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	42,053	37.31	1,568,997.43	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	644.50	1,383,097.00	
	BANK HAPUALIM BM	98,310	31.50	3,096,765.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,864	33.25	3,619,728.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	19.00	1,890,500.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	110.60	1,382,831.80	
	AZRIELI GROUP	4,323	257.80	1,114,469.40	

	NICE LTD	4,991	673.50	3,361,438.50	
	イスラエルシェケル 小計	372,690		17,417,827.13 (660,605,929)	
	合 計	84,871,095		492,430,194,549 (492,430,194,549)	

## (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	82,693	952,623.36	
		LENLEASE GROUP	64,786	698,393.08	
		オーストラリアドル 小計	147,479	1,651,016.44 (150,275,516)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,697,850.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	205,000	2,218,100.00	
		香港ドル 小計	425,500	3,915,950.00 (63,360,071)	
		投資信託受益証券合計	572,979	213,635,587 (213,635,587)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	564,834.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,971	1,849,600.89	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	35,326	9,218,672.96	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	95,067	631,244.88	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,390,032.12	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	1,268,664.12	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	1,123,450.02	
		CROWN CASTLE INTL CORP	33,199	6,420,354.61	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	22,174	3,137,842.74	
		DUKE REALTY CORP	27,540	1,471,186.80	
		EQUINIX INC	7,120	4,939,001.60	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	1,089,720.60	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	27,140	2,120,448.20	
		ESSEX PROPERTY TRUST	4,770	1,377,051.30	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,956,566.04	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,361,571.20	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	1,175,201.10	
		INVITATION HOMES INC	46,840	1,805,213.60	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,281,530.44	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	1,137,074.78	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	929,668.88			
MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,403	1,544,639.46			

	PROLOGIS INC	57,379	7,302,051.54	
	PUBLIC STORAGE	12,441	4,177,314.57	
	REALTY INCOME CORP	44,162	3,062,634.70	
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	864,510.10	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	2,983,107.48	
	SIMON PROPERTY GROUP	25,518	2,902,162.14	
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,506,331.05	
	UDR INC	24,265	1,179,036.35	
	VENTAS INC	31,565	1,811,831.00	
	VICI PROPERTIES INC	75,321	2,325,159.27	
	VORNADO REALTY TRUST	11,390	404,800.60	
	WELLTOWER INC	32,739	2,952,075.63	
	WP CAREY INC	14,258	1,214,068.70	
	アメリカドル 小計	1,002,602	81,478,654.07 (10,349,418,639)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	238,827.69	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	352,397.50	
	カナダドル 小計	20,377	591,225.19 (59,045,659)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	338,408.40	
	GECINA SA	3,139	340,895.40	
	KLEPIERRE	17,225	371,371.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	690,761.85	
	ユーロ 小計	35,781	1,741,436.65 (237,340,401)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	417,876.46	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	46,289	358,554.59	
	SEGRO PLC	93,383	1,044,488.85	
	イギリスポンド 小計	219,086	1,820,919.90 (292,057,342)	
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	987,945.00	
	GOODMAN GROUP	133,807	2,656,068.95	
	GPT GROUP	167,884	799,127.84	
	MIRVAC GROUP	266,683	594,703.09	
	SCENTRE GROUP	382,183	1,119,796.19	
	STOCKLAND	207,412	810,980.92	
	VICINITY CENTERS	365,149	684,654.37	
	オーストラリアドル 小計	1,617,208	7,653,276.36 (696,601,214)	
香港ドル	LINK REIT	170,500	11,994,675.00	
	香港ドル 小計	170,500	11,994,675.00 (194,073,841)	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	772,855.36	



シンガポールドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	340,429	755,752.38	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	389,400.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	458,766.18	
シンガポールドル 小計		1,127,756	2,376,773.92	(220,612,155)
投資証券合計		4,193,310	12,049,149,251	(12,049,149,251)
合計			12,262,784,838	(12,262,784,838)

(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

- 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。
- 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。
- 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。
- 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 606銘柄	97.2%			71.1%
	投資証券 35銘柄			2.8%	2.1%
カナダドル	株式 86銘柄	99.7%			3.9%
	投資証券 2銘柄			0.3%	0.0%
ユーロ	株式 228銘柄	99.5%			9.3%
	投資証券 4銘柄			0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 78銘柄	98.8%			4.6%
	投資証券 3銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 41銘柄	100.0%			3.0%
スウェーデンクローナ	株式 44銘柄	100.0%			1.0%
ノルウェークローネ	株式 12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 51銘柄	93.0%			2.2%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.2%		0.0%
	投資証券 7銘柄			5.8%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 6銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 28銘柄	94.0%			0.8%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.5%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.5%	0.0%

シンガポールドル	株式	14銘柄	88.1%			0.3%
	投資証券	4銘柄			11.9%	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。

## 2【ファンドの現況】

## 【外国株式インデックス・オープン】

## 【純資産額計算書】

(2022年 6月30日現在)

資産総額	3,674,634,056円
負債総額	2,747,027円
純資産総額（ - ）	3,671,887,029円
発行済口数	1,428,608,531口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5703円
（1万口当たり純資産額）	（25,703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 6月30日現在)

資産総額	522,729,612,613円
負債総額	239,696,672円
純資産総額（ - ）	522,489,915,941円
発行済口数	126,034,519,157口
1口当たり純資産額（ / ）	4.1456円
（1万口当たり純資産額）	（41,456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 6月30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。

#### [ DO（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 - DO - 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 8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6月30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	540	13,694,779
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	71	226,954
単位型公社債投資信託	51	220,516
合計	662	14,142,249

## 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。

なお、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、当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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。

( 1 ) 【貸借対照表】

	( 単位：百万円 )	
	前事業年度 ( 2021年3月31日 )	当事業年度 ( 2022年3月31日 )
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,589	21,675
金銭の信託	10,857	14,913
前払費用	397	166
未収委託者報酬	8,471	9,067
未収運用受託報酬	6,151	6,252
未収収益	177	179
その他	3,428	4,891
流動資産合計	51,072	57,146
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 301	1 289
器具備品	1 692	1 687
その他	1 0	1 -
有形固定資産合計	993	976
無形固定資産		
ソフトウェア	4,104	6,292
その他	41	31
無形固定資産合計	4,145	6,324
投資その他の資産		
投資有価証券	9,950	6,607
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	311	907
その他	39	31
投資その他の資産合計	15,937	13,182
固定資産合計	21,077	20,482
資産合計	72,149	77,629

( 単位：百万円 )

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	44	47
未払金	7,572	8,285
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,154	4,561
その他未払金	3,417	3,723
未払費用	1,046	1,049
未払法人税等	517	504
賞与引当金	556	578
その他	818	1,958
流動負債合計	10,555	12,423
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	626	820
資産除去債務	133	153
その他	8	12
固定負債合計	768	986
負債合計	11,324	13,410
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
<b>資本剰余金</b>		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	500	500
<b>その他利益剰余金</b>		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	38,258	41,948
利益剰余金合計	40,858	44,548
株主資本合計	60,098	63,788
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	791	941
繰延ヘッジ損益	65	509
評価・換算差額等合計	726	431
純資産合計	60,824	64,219
負債・純資産合計	72,149	77,629



	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	37,224	41,730
運用受託報酬	10,982	11,883
その他営業収益	403	390
営業収益合計	48,611	54,004
営業費用		
支払手数料	17,936	20,567
広告宣伝費	203	286
調査費	5,064	5,567
調査費	898	1,062
委託調査費	4,154	4,487
図書費	11	17
営業雑経費	4,492	5,201
通信費	56	68
印刷費	449	454
協会費	58	55
諸会費	18	35
情報機器関連費	3,815	4,473
その他営業雑経費	93	112
営業費用合計	27,696	31,622
一般管理費		
給料	5,976	6,295
役員報酬	214	249
給料・手当	4,861	5,072
賞与	901	972
退職給付費用	170	254
福利費	608	632
交際費	1	3
旅費交通費	13	20
租税公課	315	327
不動産賃借料	276	323
寄付金	3	5
減価償却費	748	989
業務委託費	966	1,081
諸経費	848	1,301
一般管理費合計	9,929	11,234
営業利益	10,984	11,147

（単位：百万円）

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

営業外収益		
受取利息	2	2
収益分配金	101	16
金銭の信託運用益	3,038	-
投資有価証券売却益	1	0
投資有価証券償還益	54	219
その他	45	8
営業外収益合計	3,243	247
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	332
投資有価証券売却損	0	0
投資有価証券償還損	0	-
為替差損	158	291
デリバティブ費用	3,782	1,191
その他	5	33
営業外費用合計	3,946	1,848
経常利益	10,281	9,545
特別損失		
退職給付費用	-	120
システム統合費用	110	-
特別損失合計	110	120
税引前当期純利益	10,170	9,425
法人税、住民税及び事業税	3,242	3,403
法人税等調整額	65	465
法人税等合計	3,177	2,937
当期純利益	6,993	6,487

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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	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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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
当期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	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
当期変動額				
剰余金の配当				2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	444	295	295
当期変動額合計	149	444	295	3,394
当期末残高	941	509	431	64,219

## 注記事項

### （重要な会計方針）

#### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

##### （1）子会社株式

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

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。）

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。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

#### 2．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、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

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

##### （2）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、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事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。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、退職給付に係る当事業年度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」という。）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。

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

当社は、翌事業年度より、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「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。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月21日）を適用する予定であります。

(会計方針の変更)

1. 「収益認識に関する会計基準」等の適用

「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）等を当事業年度の期首から適用し、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」等の適用

「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。）等を当事業年度の期首から適用し、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。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日）第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載していません。

## （未適用の会計基準等）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）

## （1）概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

## （2）適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

## （3）当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であり、

## （追加情報）

## 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、退職給付に係る事業年度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、当事業年度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。

## （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 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
建 物	106	百万円	146	百万円
器具備品	391	"	535	"
そ の 他	4	"	-	"
計	503	"	681	"

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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
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

#### 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

2022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
2022年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,641	利益剰余金	880,447	2022年3月31日	2022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 8 . 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. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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、「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。以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した投資信託、市場価格のない株式等及び、時価算定適用指針第27項に従い経過措置を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）\*2、\*3及び（注2）参照）。

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) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）（*1）
金銭の信託	10,857
投資有価証券 その他有価証券	9,950
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)
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)
デリバティブ取引計	(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。

当事業年度（2022年3月31日）

区 分	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)	-	196	-	196
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	(1,333)	(80)	-	(1,413)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(71)	-	(71)
デリバティブ取引計	(1,333)	(151)	-	(1,485)

(\*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) 投資有価証券のうち、投資信託（貸借対照表計上額6,474百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額133百万円）は上記に含めておりません。

(\*3) 金銭の信託の信託財産のうち、投資信託（貸借対照表計上額13,876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額840百万円）は上記に含めておりません。これらも含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,913百万円であります。

(\*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) 時価をもって貸借対照表計上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、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) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

(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（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

当事業年度（2022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	21,675	-	-	-
未収委託者報酬	9,067	-	-	-
未収運用受託報酬	6,252	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	108	1,712	0

（有価証券関係）

## 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）

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
子会社株式	5,636	5,636

## 2．その他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（2022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	4,888	3,403	1,485
小計	4,888	3,403	1,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,585	1,711	126
小計	1,585	1,711	126
合計	6,474	5,115	1,358

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりません。

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
非上場株式	0	0
組合出資金等		133

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	109	1	0

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（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）上記取引の評価損益は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	13,711	-	315	315
合計		13,711	-	315	315

（注）上記取引の評価損益は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	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 関係会社株式				
	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	

当事業年度（2022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	5,498	-	54	
	英ポンド	277	-	1	
	カナダドル	111	-	1	
	スイスフラン	139	-	2	
	香港ドル	190	-	1	
	ユーロ	676	-	18	
	買建				
	ユーロ	21	-	0	
	合計	6,915	-	80	80

(注) 上記取引の評価損益は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	17,197	-	1,333	1,333
合計	17,197	-	1,333	1,333

(注) 上記取引の評価損益は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	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 関係会社株式			
	米ドル		4,422	-	43
	英ポンド		3,297	-	21
	スイスフラン		79	-	1
	香港ドル		119	-	1
	ユーロ		125	-	3
	人民元		13	-	0
合計			8,057	-	71

## (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従来簡便法により、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したが、当事業年度より原則法と簡便法の併用により、これら計算を行っておりません。

## 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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
退職給付債務の期首残高	600		626	
勤務費用	-		124	
利息費用	-		2	
転籍者受入	18		-	
退職給付の支払額	69		81	
簡便法で計算した退職給付費用	77		8	
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-		120	
その他	-		18	
退職給付債務の期末残高	626		820	

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

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

(単位：百万円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
非積立型制度の退職給付債務	626		820	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626		820	
退職給付引当金	626		820	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626		820	

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
勤務費用	-		124	
利息費用	-		2	
簡便法で計算した退職給付費用	77		8	

簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	120
その他	-	18
確定給付制度に係る退職給付費用	77	274

(5) 年金資産に関する事項  
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
割引率	-	0.4%

### 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92百万円、当事業年度100百万円であります。

(税効果会計関係)

#### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	107	百万円	112	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	170	"	177	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	191	"	251	"
税務上の収益認識差額	71	"	74	"
税務上の費用認識差額	-	"	439	"
繰延ヘッジ損益	28	"	224	"
その他	123	"	76	"
繰延税金資産 合計	693	"	1,357	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	349	"	415	"
その他	32	"	34	"
繰延税金負債 合計	382	"	450	"
繰延税金資産の純額	311	"	907	"

#### 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。

(収益認識関係)

#### 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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事業年度末において

存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報  
重要性が乏しいため記載を省略しております。

## （セグメント情報等）

## 〔セグメント情報〕

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 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(*)	6,372百万円

(\*)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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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	10,395百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395百万円

(\*)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〕

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。

## （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 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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

(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（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）

当事業年度（2022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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)



1株当たり純資産額	20,274,967円09銭	21,406,512円22銭
1株当たり当期純利益金額	2,331,221円85銭	2,162,405円20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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	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)通常の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

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）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 8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（2022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） （2022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。
株式会社愛媛銀行	21,367	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	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。
楽天証券株式会社	17,495	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S B I証券	48,323	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。
株式会社きらぼし銀行	43,734	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
きらぼしライフデザイン証券株式会社	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。

## 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（2022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**

2022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  
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

**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2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による

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

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

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

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

#### 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

2022年8月10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 後藤知弘 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」に掲げられている外国株式インデックス・オープンの2021年6月1日から2022年5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、外国株式インデックス・オープンの2022年5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。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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、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드는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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。