

## 【表紙】

|                                          |                                                                       |
|------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|
| 【提出書類】                                   | 訂正有価証券届出書                                                             |
| 【提出先】                                    | 関東財務局長殿                                                               |
| 【提出日】                                    | 2022年9月26日提出                                                          |
| 【発行者名】                                   | 三菱ＵＦＪ国際投信株式会社                                                         |
| 【代表者の役職氏名】                               | 取締役社長 横川 直                                                            |
| 【本店の所在の場所】                               | 東京都千代田区有楽町一丁目１２番１号                                                    |
| 【事務連絡者氏名】                                | 伊藤 晃                                                                  |
| 【電話番号】                                   | 03-6250-4740                                                          |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券に係るファンドの名称】 | ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン（ラップ向け）                                           |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券の金額】        | (1)当初自己設定額<br>100万円を上限とします。<br>(2)継続申込額<br>1兆円を上限とします。<br>該当事項はありません。 |
| 【縦覧に供する場所】                               |                                                                       |

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2022年1月11日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について有価証券報告書の提出に伴う関係情報の更新等を行うため、本訂正届出書を提出します。

## 2【訂正の内容】

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

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

## 第二部【ファンド情報】

## 第１【ファンドの状況】

## １【ファンドの性格】

## （１）【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;更新後&gt;

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

信託金の限度額は、5,000億円です。

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

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

## 商品分類表

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

## 属性区分表

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

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容に

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

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

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

#### 商品分類の定義

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

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

#### 属性区分の定義

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

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

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

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

## [ ファンドの目的・特色 ]

## ファンドの目的

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ヘッジ・円ベース)に連動する投資成果をめざします。

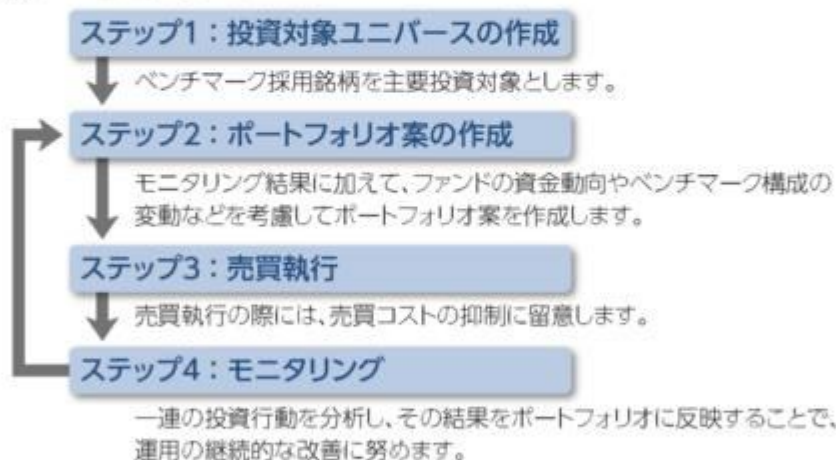
## ファンドの特色

特色 **1**

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ヘッジ・円ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。

- MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ヘッジ・円ベース)をベンチマーク(以下「対象インデックス」という場合があります。)とします。

＜運用プロセスのイメージ＞



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

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

## 特色2

主として日本を除く先進国の株式に投資を行います。

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

※実際の運用はヘッジ付外国株式インデックスマザーファンドを通じて行います。

## 特色3

原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をはかります。

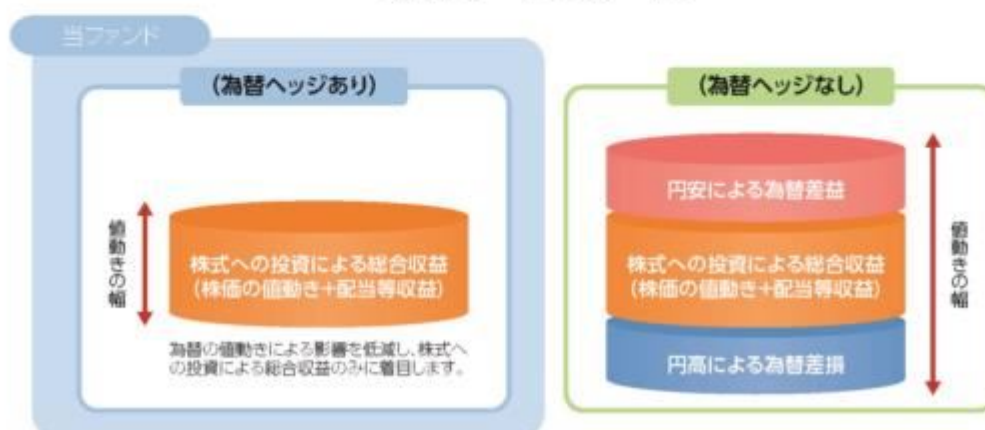
- 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をはかります。

#### 為替ヘッジの活用

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

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

#### <投資リターンのイメージ>



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



年1回の決算時(6月25日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。

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

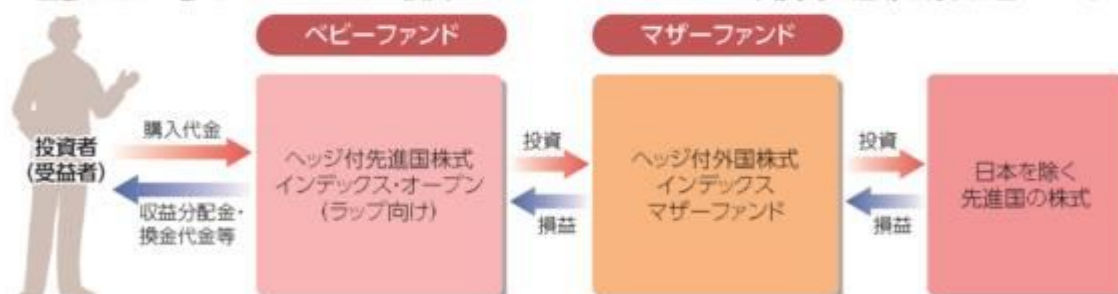
分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## ■ファンドの仕組み

ファミリーファンド方式により運用を行います。

ファミリーファンド方式とは、受益者から投資された資金をまとめた投資信託をベビーファンドとし、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資して、マザーファンドにおいて実質的な運用を行う仕組みです。



## ■主な投資制限

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

 MSCIロクサイ・インデックス(配当込み、円ヘッジ・円ベース)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く先進国で構成されています。

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

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

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

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

## （２）【ファンドの沿革】

### < 訂正前 >

2022年 1 月27日

設定日、信託契約締結、運用開始（予定）

### < 訂正後 >

2022年 1 月27日

設定日、信託契約締結、運用開始

## （３）【ファンドの仕組み】

## &lt; 訂正前 &gt;

## 委託会社と関係法人との契約の概要

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

## 委託会社の概況（2021年10月末現在）

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

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

## &lt; 訂正後 &gt;

## 委託会社と関係法人との契約の概要

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

## 委託会社の概況（2022年6月末現在）

- 金融商品取引業者登録番号  
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- 設立年月日  
1985年8月1日

- ・ 資本金  
2,000百万円
- ・ 沿革
  - 1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
  - 2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
  - 2005年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ投信株式会社に変更
  - 2015年7月 三菱ＵＦＪ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社に変更

・ 大株主の状況

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

### 3【投資リスク】

< 更新後 >

#### ( 1 ) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

( 主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。 )

|                     |                                                                                                                                                                               |
|---------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>価格変動<br/>リスク</b> | 株式の価格は、株式市場全体の動向のほか、発行企業の業績や業績に対する市場の見通しなどの影響を受けて変動します。組入株式の価格の下落は、基準価額の下落要因となります。                                                                                            |
| <b>為替変動<br/>リスク</b> | 組入外貨建資産については、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図りますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨の金利より低いときには、これらの金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。 |
| <b>信用リスク</b>        | 株式の発行企業の経営、財務状況が悪化したり、市場においてその懸念が高まった場合には、株式の価格が下落すること、配当金が減額あるいは支払いが停止されること、倒産等によりその価値がなくなること等があります。                                                                         |
| <b>流動性<br/>リスク</b>  | 株式を売買しようとする際に、その株式の取引量が十分でない場合や規制等により取引が制限されている場合には、売買が成立しなかったり、十分な数量の売買が出来なかったり、ファンドの売買自体によって市場価格が動き、結果として不利な価格での取引となる場合があります。                                               |

#### 留意事項

- ・ ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・ ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や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。

- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。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。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・ファンドは、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動することをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、株価指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因により乖離を生じることがあります。

## （２）投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行い、運用管理委員会において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。

また、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策を策定し流動性リスクの評価と管理プロセスの検証などを行います。運用管理委員会は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

トレーディング担当部署

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

コンプライアンス担当部署

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

リスク管理担当部署

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

内部監査担当部署

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

\* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

## ■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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

### ● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

ファンドの年間騰落率はありません。

ベンチマークの年間騰落率は、2017年7月～2022年6月です。

基準価額(分配金再投資)は、2022年1月末～2022年6月末です。



### ● 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月末～2022年6月末)

ファンドの年間騰落率にはベンチマークを用いています。



ファンド：日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

(注) 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

●基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。

●年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。

ベンチマークの年間騰落率は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

## 代表的な資産クラスの指数について

| 資産クラス | 指数名                           | 注記等                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-------|-------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 日本株   | 東証株価指数(TOPIX)<br>(配当込み)       | 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、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加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標準又は商標は、株式会社JPMリサーチ又は株式会社JPMリサーチの関連会社(以下「JPM」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標準又は商標に関するすべての権利はJPMが有します。                                                                           |
| 先進国株  | MSCIコクサイ・インデックス<br>(配当込み)     | MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。                                                                                                                                                                                                               |
| 新興国株  | MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み) | MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。                                                                                                                                                                                                    |
| 日本国債  | NOMURA-BPI(国債)                | NOMURA-BPI(国債)とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な国債パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(総合)のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。                                                                                                                          |
| 先進国債  | FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本)      | FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 |
| 新興国債  | JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド   | JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セクレティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当該指数の著作権はJ.P.モルガン・セクレティーズ・エルエルシーに帰属します。                                                                                                                                        |

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

## 4【手数料等及び税金】

## （５）【課税上の取扱い】

### <訂正前>

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

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

##### １．収益分配金の課税

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

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

##### ２．解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

#### 個別元本について

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

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

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

#### 収益分配金について

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

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

ます。

上記は2021年10月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

#### < 訂正後 >

課税上は、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

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

##### 1. 収益分配金の課税

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

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

##### 2. 解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

#### 個別元本について

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

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

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

#### 収益分配金について

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

当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

上記は2022年6月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## 5【運用状況】

### 【ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン（ラップ向け）】

#### （１）【投資状況】

令和 4年 6月30日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計        | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券                | 日本   | 290,579,928 | 100.00  |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 13,750      | 0.00    |
| 純資産総額                    |      | 290,593,678 | 100.00  |

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

#### （２）【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### a 評価額上位 30 銘柄

令和 4年 6月30日現在

| 国／地域 | 種類        | 銘柄名                       | 数量          | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|-----------|---------------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本   | 親投資信託受益証券 | ヘッジ付外国株式インデックス<br>マザーファンド | 126,979,518 | 2.3315          | 296,062,298     | 2.2884          | 290,579,928     | 100.00          |

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

##### b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4年 6月30日現在

| 種類        | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 100.00  |
| 合計        | 100.00  |

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## ( 3 ) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和4年6月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

( 単位 : 円 )

|                        | 純資産総額       |             | 基準価額<br>( 1万口当たりの純資産価額 ) |         |
|------------------------|-------------|-------------|--------------------------|---------|
|                        | ( 分配落 )     | ( 分配付 )     | ( 分配落 )                  | ( 分配付 ) |
| 第1計算期間末日 (令和 4年 6月27日) | 271,694,777 | 271,694,777 | 8,970                    | 8,970   |
| 令和 4年 1月末日             | 1,014,065   | —           | 10,141                   | —       |
| 2月末日                   | 1,005,048   | —           | 10,050                   | —       |
| 3月末日                   | 1,049,975   | —           | 10,500                   | —       |
| 4月末日                   | 14,887,958  | —           | 9,621                    | —       |
| 5月末日                   | 107,919,305 | —           | 9,599                    | —       |
| 6月末日                   | 290,593,678 | —           | 8,802                    | —       |

## 【分配の推移】

|        | 1万口当たりの分配金 |
|--------|------------|
| 第1計算期間 | 0円         |

## 【収益率の推移】

|        | 収益率 ( % ) |
|--------|-----------|
| 第1計算期間 | 10.30     |

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

## ( 4 ) 【設定及び解約の実績】

|  | 設定口数 | 解約口数 | 発行済口数 |
|--|------|------|-------|
|--|------|------|-------|

|        |             |   |             |
|--------|-------------|---|-------------|
| 第1計算期間 | 302,884,425 | — | 302,884,425 |
|--------|-------------|---|-------------|

（参考）

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

令和 4年 6月30日現在

（単位：円）

| 資産の種類 | 国／地域     | 時価合計           | 投資比率（％） |
|-------|----------|----------------|---------|
| 株式    | アメリカ     | 11,578,445,411 | 69.94   |
|       | イギリス     | 761,733,749    | 4.60    |
|       | カナダ      | 622,223,076    | 3.76    |
|       | スイス      | 501,519,039    | 3.03    |
|       | フランス     | 495,094,824    | 2.99    |
|       | ドイツ      | 371,546,194    | 2.24    |
|       | オーストラリア  | 358,815,096    | 2.17    |
|       | オランダ     | 257,036,320    | 1.55    |
|       | スウェーデン   | 162,875,580    | 0.98    |
|       | 香港       | 145,321,274    | 0.88    |
|       | デンマーク    | 131,698,564    | 0.80    |
|       | スペイン     | 121,729,145    | 0.74    |
|       | イタリア     | 82,780,173     | 0.50    |
|       | シンガポール   | 53,045,122     | 0.32    |
|       | フィンランド   | 47,869,566     | 0.29    |
|       | ノルウェー    | 41,028,885     | 0.25    |
|       | ベルギー     | 40,920,326     | 0.25    |
|       | アイルランド   | 26,375,558     | 0.16    |
|       | イスラエル    | 24,155,072     | 0.15    |
|       | ルクセンブルグ  | 11,889,138     | 0.07    |
|       | ポルトガル    | 9,316,558      | 0.06    |
|       | オーストリア   | 9,030,753      | 0.05    |
|       | ニュージーランド | 8,402,596      | 0.05    |
|       | 小計       | 15,862,852,019 | 95.81   |
| 投資証券  | アメリカ     | 345,787,676    | 2.09    |
|       | オーストラリア  | 20,634,374     | 0.12    |
|       | イギリス     | 8,779,232      | 0.05    |
|       | シンガポール   | 7,745,758      | 0.05    |
|       | 香港       | 6,115,610      | 0.04    |
|       | フランス     | 5,752,696      | 0.03    |
|       | ベルギー     | 1,760,251      | 0.01    |
|       | カナダ      | 1,355,740      | 0.01    |

|                          |    |                |        |
|--------------------------|----|----------------|--------|
|                          | 小計 | 397,931,337    | 2.40   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —  | 295,098,849    | 1.79   |
| 純資産総額                    |    | 16,555,882,205 | 100.00 |

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

## その他の資産の投資状況

令和 4年 6月30日現在

（単位：円）

| 資産の種類    | 建別 | 国／地域    | 時価合計        | 投資比率（％） |
|----------|----|---------|-------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ    | 966,233,632 | 5.84    |
|          | 買建 | カナダ     | 49,022,880  | 0.30    |
|          | 買建 | ドイツ     | 154,752,722 | 0.93    |
|          | 買建 | オーストラリア | 46,452,330  | 0.28    |
|          | 買建 | イギリス    | 60,148,587  | 0.36    |
|          | 買建 | スイス     | 46,340,952  | 0.28    |

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### a 評価額上位 30 銘柄

令和 4年 6月30日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名                    | 業種                     | 数量     | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|----|------------------------|------------------------|--------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 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     | 41,695 | 20,025.29       | 834,954,648     | 19,029.95       | 793,454,032     | 4.79            |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP         | ソフトウェア・サービス            | 18,200 | 35,626.43       | 648,401,080     | 35,572.33       | 647,416,530     | 3.91            |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC         | 小売                     | 23,400 | 14,429.98       | 337,661,594     | 14,887.18       | 348,360,143     | 2.10            |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A      | メディア・娯楽                | 768    | 310,548.39      | 238,501,171     | 305,347.22      | 234,506,665     | 1.42            |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C      | メディア・娯楽                | 726    | 311,524.69      | 226,166,930     | 306,864.36      | 222,783,531     | 1.35            |
| アメリカ | 株式 | TESLA INC              | 自動車・自動車部品              | 2,245  | 100,451.69      | 225,514,064     | 93,690.03       | 210,334,139     | 1.27            |
| アメリカ | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP INC | ヘルスケア機器・サービス           | 2,407  | 66,462.08       | 159,974,242     | 70,487.24       | 169,662,793     | 1.02            |
| 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 | 6,717  | 24,077.88       | 161,731,126     | 24,190.99       | 162,490,901     | 0.98            |
| アメリカ | 株式 | NVIDIA CORP            | 半導体・半導体製造装置            | 6,384  | 22,757.43       | 145,283,446     | 21,242.80       | 135,614,071     | 0.82            |

|      |    |                              |                        |        |           |             |           |             |      |
|------|----|------------------------------|------------------------|--------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| アメリカ | 株式 | META PLATFORMS INC-CLASS A   | メディア・娯楽                | 5,900  | 25,796.98 | 152,202,201 | 22,407.31 | 132,203,183 | 0.80 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP             | エネルギー                  | 10,802 | 11,873.99 | 128,262,912 | 12,044.24 | 130,101,898 | 0.79 |
| アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 各種金融                   | 3,295  | 42,581.28 | 140,305,342 | 37,380.61 | 123,169,121 | 0.74 |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO          | 銀行                     | 7,551  | 16,169.05 | 122,092,555 | 15,759.20 | 118,997,749 | 0.72 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 家庭用品・パーソナル用品           | 6,117  | 20,858.73 | 127,592,881 | 19,435.89 | 118,889,376 | 0.72 |
| スイス  | 株式 | NESTLE SA-REG                | 食品・飲料・タバコ              | 7,203  | 17,431.29 | 125,557,635 | 16,095.67 | 115,937,183 | 0.70 |
| アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES      | ソフトウェア・サービス            | 4,251  | 26,903.09 | 114,365,049 | 27,267.66 | 115,914,823 | 0.70 |
| アメリカ | 株式 | PFIZER INC                   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 14,366 | 6,764.97  | 97,185,643  | 6,962.47  | 100,022,976 | 0.60 |
| アメリカ | 株式 | HOME DEPOT INC               | 小売                     | 2,670  | 38,705.37 | 103,343,349 | 37,432.55 | 99,944,913  | 0.60 |
| アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP                 | エネルギー                  | 4,967  | 22,330.14 | 110,913,844 | 20,089.22 | 99,783,188  | 0.60 |
| アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC - A           | ソフトウェア・サービス            | 2,235  | 44,575.14 | 99,625,448  | 44,091.60 | 98,544,729  | 0.60 |
| 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 | 4,528  | 20,761.86 | 94,009,711  | 21,067.85 | 95,395,248  | 0.58 |
| アメリカ | 株式 | ELI LILLY & CO               | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 2,076  | 39,221.78 | 81,424,420  | 44,147.64 | 91,650,501  | 0.55 |
| アメリカ | 株式 | COCA-COLA CO/THE             | 食品・飲料・タバコ              | 10,532 | 8,787.98  | 92,555,073  | 8,573.93  | 90,300,698  | 0.55 |
| スイス  | 株式 | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 1,802  | 46,966.56 | 84,633,744  | 45,773.88 | 82,484,532  | 0.50 |
| アメリカ | 株式 | MERCK & CO. INC.             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 6,456  | 12,194.88 | 78,730,152  | 12,644.26 | 81,631,386  | 0.49 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP         | 銀行                     | 18,610 | 4,861.70  | 90,476,379  | 4,354.62  | 81,039,568  | 0.49 |
| アメリカ | 株式 | PEPSICO INC                  | 食品・飲料・タバコ              | 3,537  | 23,320.97 | 82,486,302  | 22,788.65 | 80,603,478  | 0.49 |
| アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 電気通信サービス               | 10,701 | 6,554.69  | 70,141,788  | 6,962.47  | 74,505,490  | 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 | 996    | 71,073.59 | 70,789,305  | 73,249.54 | 72,956,547  | 0.44 |
| アメリカ | 株式 | COSTCO WHOLESALE CORP        | 食品・生活必需品小売り            | 1,134  | 66,800.63 | 75,751,918  | 64,217.73 | 72,822,907  | 0.44 |

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

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 4年 6月30日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率（％） |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|      |                        |       |
|------|------------------------|-------|
| 株式   | エネルギー                  | 5.21  |
|      | 素材                     | 4.23  |
|      | 資本財                    | 5.77  |
|      | 商業・専門サービス              | 1.16  |
|      | 運輸                     | 1.93  |
|      | 自動車・自動車部品              | 2.06  |
|      | 耐久消費財・アパレル             | 1.57  |
|      | 消費者サービス                | 1.69  |
|      | メディア・娯楽                | 5.71  |
|      | 小売                     | 4.55  |
|      | 食品・生活必需品小売り            | 1.51  |
|      | 食品・飲料・タバコ              | 4.39  |
|      | 家庭用品・パーソナル用品           | 1.78  |
|      | ヘルスケア機器・サービス           | 4.85  |
|      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 9.26  |
|      | 銀行                     | 5.79  |
|      | 各種金融                   | 4.55  |
|      | 保険                     | 3.18  |
|      | 不動産                    | 0.37  |
|      | ソフトウェア・サービス            | 10.90 |
|      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 6.20  |
|      | 電気通信サービス               | 1.70  |
|      | 公益事業                   | 3.25  |
|      | 半導体・半導体製造装置            | 4.21  |
|      | 小計                     | 95.81 |
| 投資証券 | —                      | 2.40  |
| 合計   |                        | 98.22 |

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

令和 4年 6月30日現在

| 資産の種類    | 地域   | 取引所名       | 資産の名称        | 建別 | 数量 | 通貨     | 簿価金額         | 簿価金額（円）     | 評価金額        | 評価金額（円）     | 投資比率（％） |
|----------|------|------------|--------------|----|----|--------|--------------|-------------|-------------|-------------|---------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | シカゴ商業取引所   | SP EMINI2209 | 買建 | 37 | アメリカドル | 6,934,887.61 | 947,860,438 | 7,069,312.5 | 966,233,632 | 5.84    |
|          | カナダ  | モントリオール取引所 | SP/TSE602209 | 買建 | 2  | カナダドル  | 473,127.5    | 50,151,515  | 462,480     | 49,022,880  | 0.30    |

|  |         |                       |              |    |    |           |             |             |           |             |      |
|--|---------|-----------------------|--------------|----|----|-----------|-------------|-------------|-----------|-------------|------|
|  | ドイツ     | ユーレックス・ドイツ<br>金融先物取引所 | EURO ST 2209 | 買建 | 31 | ユーロ       | 1,074,445.9 | 153,291,196 | 1,084,690 | 154,752,722 | 0.93 |
|  | オーストラリア | シドニー先物取引所             | SPI 200 2209 | 買建 | 3  | オーストラリアドル | 484,833.25  | 45,525,842  | 494,700   | 46,452,330  | 0.28 |
|  | イギリス    | インターコンチネンタル取引所        | FTSE100 2209 | 買建 | 5  | イギリスポンド   | 353,516.25  | 58,581,178  | 362,975   | 60,148,587  | 0.36 |
|  | スイス     | ユーレックス・チューリッヒ取引所      | SWISS IX2209 | 買建 | 3  | スイスフラン    | 319,935.55  | 45,814,771  | 323,610   | 46,340,952  | 0.28 |

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

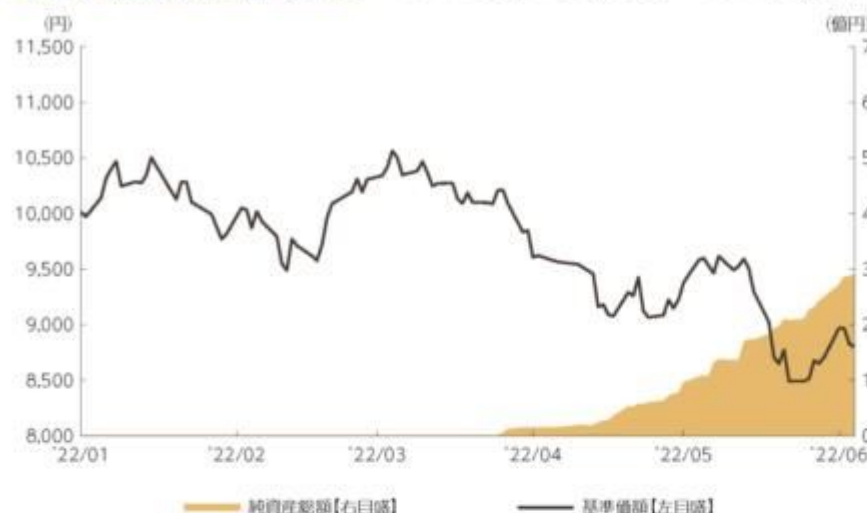
## 参考情報



## 運用実績

2022年6月30日現在

### ■基準価額・純資産の推移 2022年1月27日(設定日)～2022年6月30日



### ■基準価額・純資産

|       |        |
|-------|--------|
| 基準価額  | 8,802円 |
| 純資産総額 | 2.9億円  |

●純資産総額は表示桁未満切捨て

### ■分配の推移

|          |    |
|----------|----|
| 2022年 6月 | 0円 |
| 設定来累計    | 0円 |

●分配金は1万口当たり、税引前

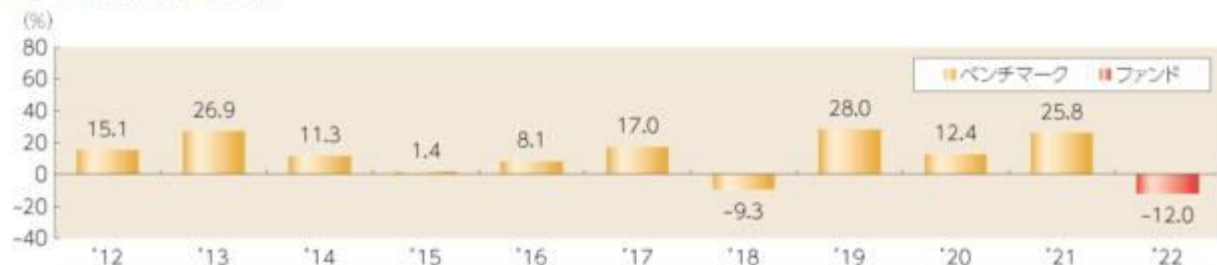
### ■主要な資産の状況

| 組入通貨 | 比率    | 組入上位銘柄                        | 業種                     | 国・地域 | 比率   |
|------|-------|-------------------------------|------------------------|------|------|
| 1 円  | 99.3% | 1 APPLE INC                   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | アメリカ | 4.8% |
| その他  | 0.7%  | 2 MICROSOFT CORP              | ソフトウェア・サービス            | アメリカ | 3.9% |
|      |       | 3 AMAZON.COM INC              | 小売                     | アメリカ | 2.1% |
|      |       | 4 ALPHABET INC-CL A           | メディア・娯楽                | アメリカ | 1.4% |
|      |       | 5 ALPHABET INC-CL C           | メディア・娯楽                | アメリカ | 1.3% |
|      |       | 6 TESLA INC                   | 自動車・自動車部品              | アメリカ | 1.3% |
|      |       | 7 UNITEDHEALTH GROUP INC      | ヘルスケア機器・サービス           | アメリカ | 1.0% |
|      |       | 8 JOHNSON & JOHNSON           | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | アメリカ | 1.0% |
|      |       | 9 NVIDIA CORP                 | 半導体・半導体製造装置            | アメリカ | 0.8% |
|      |       | 10 META PLATFORMS INC-CLASS A | メディア・娯楽                | アメリカ | 0.8% |

| その他資産の状況     | 比率   |
|--------------|------|
| 株価指数先物取引（買建） | 8.0% |

- 各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- 外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。
- 「国・地域」は原則、発行通貨ベースで分類しています。(ただし、発行通貨がユーロの場合は発行地)

### ■年間収益率の推移



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

## 第３【ファンドの経理状況】

- １ 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第２条の２の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- ２ 当ファンドの第１計算期間は、約款の規定に従い、令和４年１月27日から令和４年６月27日までとしております。

- ３ 当ファンドは、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づき、当期（令和４年１月27日から令和４年６月27日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

## １【財務諸表】

## 【ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン（ラップ向け）】

## （１）【貸借対照表】

| （単位：円）                 |             |
|------------------------|-------------|
| 第1期<br>[ 令和４年６月27日現在 ] |             |
| 資産の部                   |             |
| 流動資産                   |             |
| コール・ローン                | 58,761      |
| 親投資信託受益証券              | 271,674,141 |
| 流動資産合計                 | 271,732,902 |
| 資産合計                   | 271,732,902 |
| 負債の部                   |             |
| 流動負債                   |             |
| 未払受託者報酬                | 5,956       |
| 未払委託者報酬                | 12,423      |
| その他未払費用                | 19,746      |
| 流動負債合計                 | 38,125      |
| 負債合計                   | 38,125      |
| 純資産の部                  |             |
| 元本等                    |             |
| 元本                     | 302,884,425 |
| 剰余金                    |             |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）        | 31,189,648  |
| （分配準備積立金）              | 469,282     |
| 元本等合計                  | 271,694,777 |
| 純資産合計                  | 271,694,777 |
| 負債純資産合計                | 271,732,902 |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

| （単位：円）                            |           |
|-----------------------------------|-----------|
| 第1期<br>自 令和４年１月27日<br>至 令和４年６月27日 |           |
| 営業収益                              |           |
| 有価証券売買等損益                         | 6,116,201 |

|                                           | 第1期<br>自 令和 4年 1月27日<br>至 令和 4年 6月27日 |
|-------------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益合計                                    | 6,116,201                             |
| 営業費用                                      |                                       |
| 受託者報酬                                     | 5,956                                 |
| 委託者報酬                                     | 12,423                                |
| その他費用                                     | 19,746                                |
| 営業費用合計                                    | 38,125                                |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             | 6,154,326                             |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             | 6,154,326                             |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           | 6,154,326                             |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） | -                                     |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           | -                                     |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 25,035,322                            |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 25,035,322                            |
| 分配金                                       | -                                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           | 31,189,648                            |

### （３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

|                             | 第1期<br>[令和 4年 6月27日現在] |
|-----------------------------|------------------------|
| 1. 期首元本額                    | 1,000,000円             |
| 期中追加設定元本額                   | 301,884,425円           |
| 期中一部解約元本額                   | —円                     |
| 2. 元本の欠損                    |                        |
| 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。 | 31,189,648円            |
| 3. 受益権の総数                   | 302,884,425口           |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

|                                       |
|---------------------------------------|
| 第1期<br>自 令和 4年 1月27日<br>至 令和 4年 6月27日 |
|---------------------------------------|

## １．分配金の計算過程

| 項目                        |              |              |
|---------------------------|--------------|--------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A            | 469,282円     |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B            | —円           |
| 収益調整金額                    | C            | 281,217円     |
| 分配準備積立金額                  | D            | —円           |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D    | 750,499円     |
| 当ファンドの期末残存口数              | F            | 302,884,425口 |
| 1万口当たり収益分配対象額             | G=E/F*10,000 | 24円          |
| 1万口当たり分配金額                | H            | —円           |
| 収益分配金金額                   | I=F*H/10,000 | —円           |

## （金融商品に関する注記）

## １ 金融商品の状況に関する事項

| 区分                      | 第1期<br>自 令和 4年 1月27日<br>至 令和 4年 6月27日                                                                                                                                                         |
|-------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| １．金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。                                                                                       |
| ２．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。                                                                                                                     |
| ３．金融商品に係るリスク管理体制        | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。<br>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。 |

## ２ 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                  | 第1期<br>[ 令和 4年 6月27日現在 ]                                                                                    |
|---------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| １．貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                      |
| ２．時価の算定方法           | （１）有価証券<br>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。<br>（２）デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、該当事項はありません。<br>（３）上記以外の金融商品 |

|                           |                                                                                                                                                       |
|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> |
|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種類        | 第1期<br>[ 令和 4年 6月27日現在 ] |
|-----------|--------------------------|
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）     |
| 親投資信託受益証券 | 6,105,853                |
| 合計        | 6,105,853                |

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （１口当たり情報）

|              | 第1期<br>[ 令和 4年 6月27日現在 ] |
|--------------|--------------------------|
| 1口当たり純資産額    | 0.8970円                  |
| (1万口当たり純資産額) | (8,970円)                 |

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

| 種 類       | 銘 柄                   | 口数          | 評価額         | 備考 |
|-----------|-----------------------|-------------|-------------|----|
| 親投資信託受益証券 | ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド | 116,488,355 | 271,674,141 |    |
| 合計        |                       | 116,488,355 | 271,674,141 |    |

## 第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）

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

## ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

[ 令和 4年 6月27日現在 ]

|          |                |
|----------|----------------|
| 資産の部     |                |
| 流動資産     |                |
| 預金       | 190,891,709    |
| コール・ローン  | 938,093,816    |
| 株式       | 15,919,866,995 |
| 投資証券     | 400,969,143    |
| 派生商品評価勘定 | 46,774,638     |
| 未収入金     | 159,209        |
| 未収配当金    | 16,419,251     |
| 差入委託証拠金  | 145,799,759    |
| 流動資産合計   | 17,658,974,520 |
| 資産合計     | 17,658,974,520 |
| 負債の部     |                |
| 流動負債     |                |
| 派生商品評価勘定 | 767,087,436    |
| 未払解約金    | 219,087        |

[ 令和 4年 6月27日現在 ]

|             |                |
|-------------|----------------|
| 未払利息        | 1,160          |
| 流動負債合計      | 767,307,683    |
| 負債合計        | 767,307,683    |
| 純資産の部       |                |
| 元本等         |                |
| 元本          | 7,242,821,151  |
| 剰余金         |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 9,648,845,686  |
| 元本等合計       | 16,891,666,837 |
| 純資産合計       | 16,891,666,837 |
| 負債純資産合計     | 17,658,974,520 |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

|                              | [ 令和 4年 6月27日現在 ] |
|------------------------------|-------------------|
| 1. 期首                        | 令和 4年 1月27日       |
| 期首元本額                        | 6,798,484,217円    |
| 期中追加設定元本額                    | 915,559,933円      |
| 期中一部解約元本額                    | 471,222,999円      |
| 元本の内訳                        |                   |
| つみたて先進国株式（為替ヘッジあり）           | 416,839,303円      |
| ラップ向けインデックス f 先進国株式（為替ヘッジあり） | 352,353円          |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド        | 3,308,373円        |
| ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン（ラップ向け）  | 116,488,355円      |
| ヘッジ付先進国株式インデックスオープン          | 216,583,926円      |

|                                         | [令和 4年 6月27日現在] |
|-----------------------------------------|-----------------|
| 三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）         | 1,087,070,725円  |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）           | 9,709,931円      |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）           | 1,113,070,717円  |
| 三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）           | 1,630,102,400円  |
| MUKAM ヘッジ付外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）     | 1,013,182,841円  |
| MUKAM ヘッジ付外国株式インデックスファンド２（適格機関投資家限定）    | 1,371,947,761円  |
| MUKAM アセットアロケーションファンド２０２０－０７（適格機関投資家限定） | 22,000,341円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定） | 21,619,842円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド２０２０－１１（適格機関投資家限定） | 21,436,099円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド２０２１－０１（適格機関投資家限定） | 21,465,912円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定） | 21,629,071円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド２０２１－０５（適格機関投資家限定） | 21,706,862円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド２０２１－０７（適格機関投資家限定） | 21,477,507円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定） | 21,314,355円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド２０２１－１１（適格機関投資家限定） | 21,313,817円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド２０２２－０１（適格機関投資家限定） | 21,935,627円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド２０２２－０３（適格機関投資家限定） | 23,459,282円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド２０２２－０５（適格機関投資家限定） | 24,805,751円     |
| 合計                                      | 7,242,821,151円  |
| ２．受益権の総数                                | 7,242,821,151口  |

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

# １ 金融商品の状況に関する事項

| 区分             | 自 令和 4年 1月27日<br>至 令和 4年 6月27日                                                                          |
|----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| １．金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第２条第４項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 |

| 区分                       | 自 令和 4年 1月27日<br>至 令和 4年 6月27日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                         | [ 令和 4年 6月27日現在 ]                                                                                                                                                                                                                        |
|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                                                                   |
| 2. 時価の算定方法                 | <p>( 1 ) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>( 2 ) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>( 3 ) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 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。                                                                                                                                                                         |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類   | [ 令和 4年 6月27日現在 ]  |
|------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 株式   | 211,307,361        |
| 投資証券 | 455,532            |
| 合計   | 210,851,829        |

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

[ 令和 4年 6月27日現在 ]

| 区分   | 種類             | 契約額等（円）       |       | 時価（円）         | 評価損益（円）    |
|------|----------------|---------------|-------|---------------|------------|
|      |                |               | うち1年超 |               |            |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 1,288,077,521 | —     | 1,333,435,047 | 45,357,526 |
| 合計   |                | 1,288,077,521 | —     | 1,333,435,047 | 45,357,526 |

（注）時価の算定方法

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

通貨関連

[ 令和 4年 6月27日現在 ]

| 区分            | 種類           | 契約額等（円）        |       | 時価（円）          | 評価損益（円）     |
|---------------|--------------|----------------|-------|----------------|-------------|
|               |              |                | うち1年超 |                |             |
| 市場取引以外<br>の取引 | 為替予約取引<br>売建 |                |       |                |             |
|               | アメリカドル       | 12,307,773,461 | —     | 12,933,311,088 | 625,537,627 |
|               | カナダドル        | 666,649,992    | —     | 688,056,060    | 21,406,068  |
|               | オーストラリアドル    | 417,588,457    | —     | 422,345,532    | 4,757,075   |
|               | イギリスポンド      | 813,014,809    | —     | 830,845,423    | 17,830,614  |
|               | スイスフラン       | 524,943,214    | —     | 552,723,500    | 27,780,286  |
|               | 香港ドル         | 152,439,074    | —     | 160,152,980    | 7,713,906   |
|               | シンガポールドル     | 67,642,596     | —     | 70,285,196     | 2,642,600   |
|               | ニュージーランドドル   | 20,398,448     | —     | 20,667,288     | 268,840     |
|               | スウェーデンクローネ   | 191,851,896    | —     | 194,136,294    | 2,284,398   |

|  |           |                |   |                |             |
|--|-----------|----------------|---|----------------|-------------|
|  | ノルウェークローネ | 46,956,490     | — | 47,097,048     | 140,558     |
|  | デンマーククロネ  | 140,170,351    | — | 144,454,030    | 4,283,679   |
|  | イスラエルシェケル | 29,331,717     | — | 30,196,336     | 864,619     |
|  | ユーロ       | 1,630,516,386  | — | 1,680,676,440  | 50,160,054  |
|  | 合計        | 17,009,276,891 | — | 17,774,947,215 | 765,670,324 |

## （注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （１口当たり情報）

|              | [ 令和 4年 6月27日現在 ] |
|--------------|-------------------|
| 1口当たり純資産額    | 2.3322円           |
| (1万口当たり純資産額) | (23,322円)         |

## 附属明細表

## 第１ 有価証券明細表

## (1) 株式

（単位：円）

| 通貨     | 銘柄                  | 株式数   | 評価額    |            | 備考 |
|--------|---------------------|-------|--------|------------|----|
|        |                     |       | 単価     | 金額         |    |
| アメリカドル | APA CORP            | 876   | 36.45  | 31,930.20  |    |
|        | BAKER HUGHES CO     | 2,441 | 28.47  | 69,495.27  |    |
|        | CHENIERE ENERGY INC | 611   | 126.58 | 77,340.38  |    |
|        | CHEVRON CORP        | 4,967 | 144.77 | 719,072.59 |    |
|        | CONOCOPHILLIPS      | 3,333 | 90.91  | 303,003.03 |    |

|                              |        |        |            |
|------------------------------|--------|--------|------------|
| COTERRA ENERGY INC           | 2,157  | 26.35  | 56,836.95  |
| DEVON ENERGY CORP            | 1,626  | 53.77  | 87,430.02  |
| DIAMONDBACK ENERGY INC       | 435    | 119.70 | 52,069.50  |
| EOG RESOURCES INC            | 1,479  | 110.59 | 163,562.61 |
| EQT CORP                     | 870    | 35.09  | 30,528.30  |
| EXXON MOBIL CORP             | 10,802 | 86.90  | 938,693.80 |
| HALLIBURTON CO               | 2,270  | 30.95  | 70,256.50  |
| HESS CORP                    | 712    | 101.69 | 72,403.28  |
| KINDER MORGAN INC            | 5,159  | 16.48  | 85,020.32  |
| MARATHON OIL CORP            | 1,827  | 22.05  | 40,285.35  |
| MARATHON PETROLEUM CORP      | 1,450  | 85.68  | 124,236.00 |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 2,363  | 57.52  | 135,919.76 |
| ONEOK INC                    | 1,130  | 54.57  | 61,664.10  |
| PHILLIPS 66                  | 1,213  | 84.20  | 102,134.60 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 586    | 223.48 | 130,959.28 |
| SCHLUMBERGER LTD             | 3,698  | 35.06  | 129,651.88 |
| TARGA RESOURCES CORP         | 569    | 58.14  | 33,081.66  |
| VALERO ENERGY CORP           | 1,034  | 103.93 | 107,463.62 |
| WILLIAMS COS INC             | 3,076  | 30.05  | 92,433.80  |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 559    | 252.08 | 140,912.72 |
| ALBEMARLE CORP               | 296    | 224.79 | 66,537.84  |
| ALCOA CORP                   | 471    | 49.36  | 23,248.56  |
| AMCOR PLC                    | 3,872  | 12.41  | 48,051.52  |
| AVERY DENNISON CORP          | 208    | 165.35 | 34,392.80  |
| BALL CORP                    | 817    | 71.59  | 58,489.03  |
| CELANESE CORP                | 275    | 127.57 | 35,081.75  |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   | 544    | 83.32  | 45,326.08  |
| CLEVELAND-CLIFFS INC         | 1,353  | 16.48  | 22,297.44  |
| CORTEVA INC                  | 1,843  | 53.56  | 98,711.08  |
| CROWN HOLDINGS INC           | 317    | 95.43  | 30,251.31  |
| DOW INC                      | 1,862  | 53.14  | 98,946.68  |
| DUPONT DE NEMOURS INC        | 1,310  | 58.55  | 76,700.50  |
| EASTMAN CHEMICAL CO          | 341    | 92.45  | 31,525.45  |
| ECOLAB INC                   | 652    | 159.65 | 104,091.80 |
| FMC CORP                     | 336    | 108.23 | 36,365.28  |
| FREEPORT-MCMORAN INC         | 3,714  | 30.99  | 115,096.86 |
| INTERNATIONAL PAPER CO       | 966    | 42.84  | 41,383.44  |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 645    | 121.41 | 78,309.45  |
| LINDE PLC                    | 1,314  | 303.23 | 398,444.22 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 670    | 89.24  | 59,790.80  |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 157    | 309.68 | 48,619.76  |
| MOSAIC CO/THE                | 940    | 46.61  | 43,813.40  |

|                              |       |        |            |
|------------------------------|-------|--------|------------|
| NEWMONT CORP                 | 2,009 | 64.18  | 128,937.62 |
| NUCOR CORP                   | 670   | 111.06 | 74,410.20  |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | 239   | 140.60 | 33,603.40  |
| PPG INDUSTRIES INC           | 600   | 121.01 | 72,606.00  |
| RPM INTERNATIONAL INC        | 331   | 81.61  | 27,012.91  |
| SEALED AIR CORP              | 377   | 59.65  | 22,488.05  |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE      | 629   | 231.25 | 145,456.25 |
| STEEL DYNAMICS INC           | 519   | 68.89  | 35,753.91  |
| VULCAN MATERIALS CO          | 335   | 145.82 | 48,849.70  |
| WESTLAKE CORP                | 104   | 99.60  | 10,358.40  |
| WESTROCK CO                  | 664   | 40.64  | 26,984.96  |
| 3M CO                        | 1,455 | 134.33 | 195,450.15 |
| AERCAP HOLDINGS NV           | 355   | 40.99  | 14,551.45  |
| ALLEGION PLC                 | 226   | 99.60  | 22,509.60  |
| AMETEK INC                   | 587   | 113.50 | 66,624.50  |
| BOEING CO/THE                | 1,412 | 141.53 | 199,840.36 |
| CARRIER GLOBAL CORP          | 2,256 | 36.30  | 81,892.80  |
| CATERPILLAR INC              | 1,367 | 185.49 | 253,564.83 |
| CUMMINS INC                  | 361   | 195.02 | 70,402.22  |
| DEERE & CO                   | 744   | 310.87 | 231,287.28 |
| DOVER CORP                   | 366   | 123.22 | 45,098.52  |
| EATON CORP PLC               | 1,053 | 131.83 | 138,816.99 |
| EMERSON ELECTRIC CO          | 1,504 | 82.03  | 123,373.12 |
| FASTENAL CO                  | 1,459 | 51.90  | 75,722.10  |
| FORTIVE CORP                 | 865   | 56.28  | 48,682.20  |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI | 365   | 63.24  | 23,082.60  |
| GENERAC HOLDINGS INC         | 182   | 224.55 | 40,868.10  |
| GENERAL DYNAMICS CORP        | 600   | 222.33 | 133,398.00 |
| GENERAL ELECTRIC CO          | 2,776 | 67.08  | 186,214.08 |
| HEICO CORP                   | 118   | 132.00 | 15,576.00  |
| HEICO CORP-CLASS A           | 191   | 106.34 | 20,310.94  |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | 1,770 | 180.02 | 318,635.40 |
| HOWMET AEROSPACE INC         | 977   | 32.18  | 31,439.86  |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 100   | 215.34 | 21,534.00  |
| IDEX CORP                    | 201   | 185.56 | 37,297.56  |
| ILLINOIS TOOL WORKS          | 794   | 187.92 | 149,208.48 |
| INGERSOLL-RAND INC           | 1,038 | 43.33  | 44,976.54  |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   | 500   | 52.07  | 26,035.00  |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 1,775 | 48.95  | 86,886.25  |
| KORNIT DIGITAL LTD           | 100   | 36.40  | 3,640.00   |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC    | 497   | 233.55 | 116,074.35 |
| LENNOX INTERNATIONAL INC     | 83    | 203.64 | 16,902.12  |

|                              |       |        |            |
|------------------------------|-------|--------|------------|
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 627   | 419.04 | 262,738.08 |
| MASCO CORP                   | 600   | 51.80  | 31,080.00  |
| NORDSON CORP                 | 133   | 204.94 | 27,257.02  |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 381   | 463.70 | 176,669.70 |
| OTIS WORLDWIDE CORP          | 1,137 | 70.86  | 80,567.82  |
| OWENS CORNING                | 259   | 75.60  | 19,580.40  |
| PACCAR INC                   | 879   | 84.21  | 74,020.59  |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 325   | 253.10 | 82,257.50  |
| PENTAIR PLC                  | 414   | 47.03  | 19,470.42  |
| PLUG POWER INC               | 1,284 | 18.23  | 23,407.32  |
| QUANTA SERVICES INC          | 374   | 125.98 | 47,116.52  |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP   | 3,853 | 94.20  | 362,952.60 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 293   | 201.06 | 58,910.58  |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 406   | 43.19  | 17,535.14  |
| SMITH (A.O.) CORP            | 363   | 55.82  | 20,262.66  |
| SNAP-ON INC                  | 135   | 201.87 | 27,252.45  |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   | 413   | 111.16 | 45,909.08  |
| TEXTRON INC                  | 549   | 60.62  | 33,280.38  |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC       | 598   | 131.49 | 78,631.02  |
| TRANSDIGM GROUP INC          | 133   | 538.75 | 71,653.75  |
| UNITED RENTALS INC           | 182   | 248.29 | 45,188.78  |
| WABTEC CORP                  | 452   | 85.05  | 38,442.60  |
| MW GRAINGER INC              | 115   | 460.95 | 53,009.25  |
| XYLEM INC                    | 450   | 79.61  | 35,824.50  |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 340   | 89.54  | 30,443.60  |
| CINTAS CORP                  | 235   | 379.18 | 89,107.30  |
| CLARIVATE PLC                | 891   | 14.65  | 13,053.15  |
| COPART INC                   | 540   | 112.88 | 60,955.20  |
| COSTAR GROUP INC             | 1,000 | 62.85  | 62,850.00  |
| EQUIFAX INC                  | 309   | 184.83 | 57,112.47  |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 326   | 125.42 | 40,886.92  |
| LEIDOS HOLDINGS INC          | 349   | 101.57 | 35,447.93  |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 563   | 129.90 | 73,133.70  |
| ROBERT HALF INTL INC         | 284   | 77.90  | 22,123.60  |
| ROLLINS INC                  | 525   | 35.11  | 18,432.75  |
| TRANSUNION                   | 466   | 81.83  | 38,132.78  |
| VERISK ANALYTICS INC         | 423   | 172.99 | 73,174.77  |
| WASTE CONNECTIONS INC        | 661   | 122.73 | 81,124.53  |
| WASTE MANAGEMENT INC         | 1,057 | 150.31 | 158,877.67 |
| AMERCO                       | 23    | 481.86 | 11,082.78  |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC  | 346   | 103.86 | 35,935.56  |
| CSX CORP                     | 5,598 | 29.57  | 165,532.86 |

|                              |       |          |              |
|------------------------------|-------|----------|--------------|
| DELTA AIR LINES INC          | 476   | 31.20    | 14,851.20    |
| EXPEDITORS INTL WASH INC     | 429   | 100.49   | 43,110.21    |
| FEDEX CORP                   | 637   | 243.24   | 154,943.88   |
| GRAB HOLDINGS LTD - CL A     | 3,000 | 2.89     | 8,670.00     |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC  | 212   | 162.15   | 34,375.80    |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION  | 390   | 47.07    | 18,357.30    |
| LYFT INC-A                   | 679   | 16.34    | 11,094.86    |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 614   | 230.43   | 141,484.02   |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE    | 247   | 257.72   | 63,656.84    |
| SOUTHWEST AIRLINES CO        | 370   | 37.73    | 13,960.10    |
| UBER TECHNOLOGIES INC        | 3,679 | 23.03    | 84,727.37    |
| UNION PACIFIC CORP           | 1,624 | 215.78   | 350,426.72   |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B   | 1,879 | 183.30   | 344,420.70   |
| ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV | 200   | 46.35    | 9,270.00     |
| APTIV PLC                    | 686   | 97.09    | 66,603.74    |
| BORGWARNER INC               | 574   | 35.69    | 20,486.06    |
| FORD MOTOR CO                | 9,921 | 12.01    | 119,151.21   |
| GENERAL MOTORS CO            | 3,533 | 34.82    | 123,019.06   |
| LEAR CORP                    | 153   | 134.21   | 20,534.13    |
| LUCID GROUP INC              | 1,100 | 19.21    | 21,131.00    |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A      | 400   | 29.50    | 11,800.00    |
| TESLA INC                    | 2,245 | 737.12   | 1,654,834.40 |
| DR HORTON INC                | 856   | 67.69    | 57,942.64    |
| GARMIN LTD                   | 382   | 100.13   | 38,249.66    |
| HASBRO INC                   | 333   | 85.74    | 28,551.42    |
| LENNAR CORP-A                | 687   | 71.93    | 49,415.91    |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 299   | 293.36   | 87,714.64    |
| MOHAWK INDUSTRIES INC        | 145   | 127.95   | 18,552.75    |
| NEWELL BRANDS INC            | 926   | 20.03    | 18,547.78    |
| NIKE INC -CL B               | 3,287 | 112.91   | 371,135.17   |
| NVR INC                      | 8     | 4,049.72 | 32,397.76    |
| PELOTON INTERACTIVE INC-A    | 682   | 11.01    | 7,508.82     |
| PULTEGROUP INC               | 686   | 40.39    | 27,707.54    |
| VF CORP                      | 832   | 48.01    | 39,944.32    |
| WHIRLPOOL CORP               | 161   | 166.35   | 26,782.35    |
| AIRBNB INC-CLASS A           | 839   | 103.51   | 86,844.89    |
| ARAMARK                      | 599   | 31.16    | 18,664.84    |
| BOOKING HOLDINGS INC         | 104   | 1,931.05 | 200,829.20   |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC    | 544   | 44.47    | 24,191.68    |
| CARNIVAL CORP                | 2,088 | 10.85    | 22,654.80    |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 71    | 1,329.02 | 94,360.42    |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 337   | 119.81   | 40,375.97    |
| DOMINO'S PIZZA INC           | 92    | 396.54   | 36,481.68    |

|                               |        |          |              |
|-------------------------------|--------|----------|--------------|
| EXPEDIA GROUP INC             | 370    | 102.34   | 37,865.80    |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN  | 708    | 116.71   | 82,630.68    |
| LAS VEGAS SANDS CORP          | 930    | 33.43    | 31,089.90    |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A  | 703    | 139.39   | 97,991.17    |
| MCDONALD'S CORP               | 1,890  | 247.90   | 468,531.00   |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL     | 942    | 30.24    | 28,486.08    |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD   | 583    | 41.76    | 24,346.08    |
| STARBUCKS CORP                | 2,964  | 78.11    | 231,518.04   |
| VAIL RESORTS INC              | 105    | 232.34   | 24,395.70    |
| WYNN RESORTS LTD              | 267    | 58.29    | 15,563.43    |
| YUM! BRANDS INC               | 740    | 114.42   | 84,670.80    |
| ACTIVISION BLIZZARD INC       | 1,967  | 77.94    | 153,307.98   |
| ALPHABET INC-CL A             | 768    | 2,359.50 | 1,812,096.00 |
| ALPHABET INC-CL C             | 726    | 2,370.76 | 1,721,171.76 |
| AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A   | 1,400  | 12.47    | 17,458.00    |
| CABLE ONE INC                 | 14     | 1,266.56 | 17,731.84    |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A  | 303    | 463.12   | 140,325.36   |
| COMCAST CORP-CLASS A          | 11,510 | 39.57    | 455,450.70   |
| DISH NETWORK CORP-A           | 644    | 18.85    | 12,139.40    |
| ELECTRONIC ARTS INC           | 713    | 130.20   | 92,832.60    |
| FOX CORP - CLASS A            | 846    | 32.80    | 27,748.80    |
| FOX CORP - CLASS B            | 328    | 30.35    | 9,954.80     |
| IAC/INTERACTIVECORP           | 202    | 83.90    | 16,947.80    |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC  | 993    | 27.98    | 27,784.14    |
| LIBERTY BROADBAND-C           | 351    | 115.27   | 40,459.77    |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A  | 172    | 36.07    | 6,204.04     |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C  | 495    | 36.09    | 17,864.55    |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C  | 492    | 63.87    | 31,424.04    |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN  | 438    | 86.80    | 38,018.40    |
| MATCH GROUP INC               | 759    | 78.45    | 59,543.55    |
| META PLATFORMS INC-CLASS A    | 5,900  | 170.16   | 1,003,944.00 |
| NETFLIX INC                   | 1,152  | 190.85   | 219,859.20   |
| NEWS CORP - CLASS A           | 968    | 15.78    | 15,275.04    |
| OMNICOM GROUP                 | 532    | 64.60    | 34,367.20    |
| PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B      | 1,531  | 25.76    | 39,438.56    |
| PINTEREST INC- CLASS A        | 1,457  | 21.47    | 31,281.79    |
| ROBLOX CORP -CLASS A          | 900    | 36.42    | 32,778.00    |
| ROKU INC                      | 297    | 98.77    | 29,334.69    |
| SEA LTD-ADR                   | 922    | 80.47    | 74,193.34    |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC        | 2,407  | 6.19     | 14,899.33    |
| SNAP INC - A                  | 2,742  | 14.70    | 40,307.40    |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 408    | 133.62   | 54,516.96    |

|                              |        |          |              |
|------------------------------|--------|----------|--------------|
| TWITTER INC                  | 2,021  | 39.41    | 79,647.61    |
| WALT DISNEY CO/THE           | 4,654  | 97.78    | 455,068.12   |
| WARNER BROS DISCOVERY INC    | 5,595  | 14.28    | 79,896.60    |
| ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC    | 700    | 37.71    | 26,397.00    |
| ADVANCE AUTO PARTS INC       | 149    | 183.10   | 27,281.90    |
| AMAZON.COM INC               | 23,400 | 116.46   | 2,725,164.00 |
| AUTOZONE INC                 | 53     | 2,158.91 | 114,422.23   |
| BATH & BODY WORKS INC        | 641    | 30.95    | 19,838.95    |
| BEST BUY CO INC              | 559    | 74.69    | 41,751.71    |
| BURLINGTON STORES INC        | 177    | 159.98   | 28,316.46    |
| CARMAX INC                   | 410    | 98.36    | 40,327.60    |
| CARVANA CO                   | 188    | 31.52    | 5,925.76     |
| CHEWY INC - CLASS A          | 222    | 38.16    | 8,471.52     |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 590    | 247.90   | 146,261.00   |
| DOLLAR TREE INC              | 569    | 157.21   | 89,452.49    |
| DOORDASH INC - A             | 500    | 74.11    | 37,055.00    |
| EBAY INC                     | 1,580  | 45.67    | 72,158.60    |
| ETSY INC                     | 320    | 83.62    | 26,758.40    |
| GENUINE PARTS CO             | 357    | 136.75   | 48,819.75    |
| HOME DEPOT INC               | 2,670  | 283.00   | 755,610.00   |
| LKQ CORP                     | 669    | 49.92    | 33,396.48    |
| LOWE'S COS INC               | 1,703  | 182.84   | 311,376.52   |
| MERCADOLIBRE INC             | 115    | 739.46   | 85,037.90    |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 170    | 639.06   | 108,640.20   |
| POOL CORP                    | 106    | 356.94   | 37,835.64    |
| ROSS STORES INC              | 898    | 77.53    | 69,621.94    |
| TARGET CORP                  | 1,210  | 150.42   | 182,008.20   |
| TJX COMPANIES INC            | 3,041  | 60.24    | 183,189.84   |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY       | 288    | 202.97   | 58,455.36    |
| ULTA BEAUTY INC              | 149    | 410.54   | 61,170.46    |
| WAYFAIR INC- CLASS A         | 202    | 59.35    | 11,988.70    |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 1,134  | 484.37   | 549,275.58   |
| KROGER CO                    | 1,785  | 48.45    | 86,483.25    |
| SYSCO CORP                   | 1,297  | 85.57    | 110,984.29   |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 1,857  | 41.65    | 77,344.05    |
| WALMART INC                  | 3,927  | 123.72   | 485,848.44   |
| ALTRIA GROUP INC             | 4,643  | 43.40    | 201,506.20   |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    | 1,415  | 74.52    | 105,445.80   |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    | 773    | 71.51    | 55,277.23    |
| BUNGE LTD                    | 356    | 88.39    | 31,466.84    |
| CAMPBELL SOUP CO             | 612    | 48.44    | 29,645.28    |
| COCA-COLA CO/THE             | 10,532 | 63.04    | 663,937.28   |

|                              |       |        |            |
|------------------------------|-------|--------|------------|
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE | 527   | 53.02  | 27,941.54  |
| CONAGRA BRANDS INC           | 1,224 | 34.10  | 41,738.40  |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 415   | 245.50 | 101,882.50 |
| GENERAL MILLS INC            | 1,532 | 70.63  | 108,205.16 |
| HERSHEY CO/THE               | 368   | 220.96 | 81,313.28  |
| HORMEL FOODS CORP            | 747   | 47.37  | 35,385.39  |
| JM SMUCKER CO/THE            | 275   | 128.88 | 35,442.00  |
| KELLOGG CO                   | 676   | 70.72  | 47,806.72  |
| KEURIG DR PEPPER INC         | 2,036 | 35.76  | 72,807.36  |
| KRAFT HEINZ CO/THE           | 1,896 | 38.40  | 72,806.40  |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 625   | 87.84  | 54,900.00  |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO - B | 471   | 55.77  | 26,267.67  |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 3,523 | 62.65  | 220,715.95 |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 1,004 | 94.58  | 94,958.32  |
| PEPSICO INC                  | 3,537 | 166.13 | 587,601.81 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 3,935 | 103.40 | 406,879.00 |
| TYSON FOODS INC-CL A         | 745   | 85.80  | 63,921.00  |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 619   | 91.61  | 56,706.59  |
| CLOROX COMPANY               | 322   | 140.75 | 45,321.50  |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 2,024 | 80.38  | 162,689.12 |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 585   | 270.20 | 158,067.00 |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 851   | 134.46 | 114,425.46 |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 6,117 | 144.35 | 882,988.95 |
| ABBOTT LABORATORIES          | 4,522 | 109.45 | 494,932.90 |
| ABIOMED INC                  | 110   | 255.32 | 28,085.20  |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | 189   | 258.75 | 48,903.75  |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 389   | 148.46 | 57,750.94  |
| ANTHEM INC                   | 614   | 469.87 | 288,500.18 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     | 1,267 | 66.78  | 84,610.26  |
| BECTON DICKINSON AND CO      | 729   | 250.92 | 182,920.68 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       | 3,605 | 38.02  | 137,062.10 |
| CARDINAL HEALTH INC          | 678   | 54.45  | 36,917.10  |
| CENTENE CORP                 | 1,479 | 82.95  | 122,683.05 |
| CIGNA CORP                   | 814   | 265.13 | 215,815.82 |
| COOPER COS INC/THE           | 122   | 323.49 | 39,465.78  |
| CVS HEALTH CORP              | 3,338 | 94.52  | 315,507.76 |
| DAVITA INC                   | 171   | 77.50  | 13,252.50  |
| DENTSPLY SIRONA INC          | 554   | 36.76  | 20,365.04  |
| DEXCOM INC                   | 980   | 77.67  | 76,116.60  |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP    | 1,581 | 96.98  | 153,325.38 |
| HCA HEALTHCARE INC           | 629   | 182.33 | 114,685.57 |
| HENRY SCHEIN INC             | 353   | 77.29  | 27,283.37  |

|                              |       |        |              |
|------------------------------|-------|--------|--------------|
| HOLOGIC INC                  | 636   | 70.93  | 45,111.48    |
| HUMANA INC                   | 325   | 456.81 | 148,463.25   |
| IDEXX LABORATORIES INC       | 214   | 361.48 | 77,356.72    |
| INSULET CORP                 | 175   | 227.73 | 39,852.75    |
| INTUITIVE SURGICAL INC       | 931   | 209.67 | 195,202.77   |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 242   | 242.56 | 58,699.52    |
| MASIMO CORP                  | 134   | 138.60 | 18,572.40    |
| MCKESSON CORP                | 386   | 321.55 | 124,118.30   |
| MEDTRONIC PLC                | 3,458 | 90.22  | 311,980.76   |
| MOLINA HEALTHCARE INC        | 148   | 267.13 | 39,535.24    |
| NOVOCURE LTD                 | 237   | 75.60  | 17,917.20    |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 310   | 140.31 | 43,496.10    |
| RESMED INC                   | 369   | 211.50 | 78,043.50    |
| STERIS PLC                   | 254   | 207.89 | 52,804.06    |
| STRYKER CORP                 | 884   | 204.43 | 180,716.12   |
| TELADOC HEALTH INC           | 382   | 37.17  | 14,198.94    |
| TELEFLEX INC                 | 117   | 258.05 | 30,191.85    |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 2,407 | 495.64 | 1,193,005.48 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 186   | 108.77 | 20,231.22    |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    | 351   | 207.04 | 72,671.04    |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 529   | 108.87 | 57,592.23    |
| ABBVIE INC                   | 4,528 | 152.34 | 689,795.52   |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 761   | 121.29 | 92,301.69    |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 301   | 147.50 | 44,397.50    |
| AMGEN INC                    | 1,423 | 245.37 | 349,161.51   |
| AVANTOR INC                  | 1,624 | 31.60  | 51,318.40    |
| BIO-RAD LABORATORIES-A       | 60    | 507.84 | 30,470.40    |
| BIO-TECHNE CORP              | 99    | 352.76 | 34,923.24    |
| BIOGEN INC                   | 371   | 211.93 | 78,626.03    |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 488   | 86.85  | 42,382.80    |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 5,524 | 78.96  | 436,175.04   |
| CATALENT INC                 | 453   | 109.61 | 49,653.33    |
| CHARLES RIVER LABORATORIES   | 132   | 226.32 | 29,874.24    |
| DANAHER CORP                 | 1,738 | 256.83 | 446,370.54   |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC     | 1,080 | 20.61  | 22,258.80    |
| ELI LILLY & CO               | 2,076 | 325.62 | 675,987.12   |
| EXACT SCIENCES CORP          | 457   | 45.15  | 20,633.55    |
| GILEAD SCIENCES INC          | 3,168 | 63.08  | 199,837.44   |
| HORIZON THERAPEUTICS PLC     | 533   | 85.13  | 45,374.29    |
| ILLUMINA INC                 | 402   | 193.93 | 77,959.86    |
| INCYTE CORP                  | 479   | 78.19  | 37,453.01    |
| IQVIA HOLDINGS INC           | 482   | 213.80 | 103,051.60   |

|                              |        |          |              |
|------------------------------|--------|----------|--------------|
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC     | 155    | 153.49   | 23,790.95    |
| JOHNSON & JOHNSON            | 6,717  | 182.29   | 1,224,441.93 |
| MERCK & CO. INC.             | 6,456  | 93.13    | 601,247.28   |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 58     | 1,146.90 | 66,520.20    |
| MODERNA INC                  | 871    | 144.27   | 125,659.17   |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC   | 235    | 98.24    | 23,086.40    |
| PERKINELMER INC              | 325    | 145.53   | 47,297.25    |
| PFIZER INC                   | 14,366 | 51.59    | 741,141.94   |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 276    | 612.49   | 169,047.24   |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A     | 948    | 43.20    | 40,953.60    |
| SEAGEN INC                   | 341    | 179.33   | 61,151.53    |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   | 2,786  | 7.74     | 21,563.64    |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 996    | 544.81   | 542,630.76   |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 643    | 292.55   | 188,109.65   |
| VIATRIS INC                  | 3,239  | 10.96    | 35,499.44    |
| WATERS CORP                  | 154    | 328.58   | 50,601.32    |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 187    | 301.18   | 56,320.66    |
| ZOETIS INC                   | 1,195  | 174.61   | 208,658.95   |
| BANK OF AMERICA CORP         | 18,610 | 32.31    | 601,289.10   |
| CITIGROUP INC                | 5,130  | 47.86    | 245,521.80   |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 1,264  | 37.03    | 46,805.92    |
| FIFTH THIRD BANCORP          | 1,726  | 35.22    | 60,789.72    |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A   | 33     | 668.84   | 22,071.72    |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA       | 445    | 146.91   | 65,374.95    |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC    | 3,578  | 12.51    | 44,760.78    |
| JPMORGAN CHASE & CO          | 7,551  | 117.32   | 885,883.32   |
| KEYCORP                      | 2,346  | 17.83    | 41,829.18    |
| M & T BANK CORP              | 453    | 166.64   | 75,487.92    |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 1,067  | 162.84   | 173,750.28   |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 2,396  | 19.49    | 46,698.04    |
| SIGNATURE BANK               | 153    | 192.14   | 29,397.42    |
| SVB FINANCIAL GROUP          | 148    | 415.52   | 61,496.96    |
| TRUIST FINANCIAL CORP        | 3,374  | 49.22    | 166,068.28   |
| US BANCORP                   | 3,682  | 47.52    | 174,968.64   |
| WEBSTER FINANCIAL CORP       | 510    | 44.88    | 22,888.80    |
| WELLS FARGO & CO             | 9,758  | 40.76    | 397,736.08   |
| ALLY FINANCIAL INC           | 812    | 35.15    | 28,541.80    |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 1,666  | 146.15   | 243,485.90   |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 281    | 249.29   | 70,050.49    |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 3,729  | 6.33     | 23,604.57    |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 985    | 52.00    | 51,220.00    |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 1,981  | 43.60    | 86,371.60    |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 3,295  | 278.28   | 916,932.60   |

|                              |       |        |            |
|------------------------------|-------|--------|------------|
| BLACKROCK INC                | 393   | 647.78 | 254,577.54 |
| BLACKSTONE INC               | 1,793 | 98.87  | 177,273.91 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 1,076 | 110.09 | 118,456.84 |
| CARLYLE GROUP INC/THE        | 437   | 34.11  | 14,906.07  |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC      | 281   | 114.94 | 32,298.14  |
| CME GROUP INC                | 908   | 210.00 | 190,680.00 |
| COINBASE GLOBAL INC -CLASS A | 300   | 62.71  | 18,813.00  |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | 744   | 99.17  | 73,782.48  |
| EQUITABLE HOLDINGS INC       | 922   | 27.25  | 25,124.50  |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 93    | 392.52 | 36,504.36  |
| FRANKLIN RESOURCES INC       | 810   | 25.34  | 20,525.40  |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR        | 110   | 52.94  | 5,823.40   |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      | 870   | 302.75 | 263,392.50 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 1,423 | 97.91  | 139,325.93 |
| INVESCO LTD                  | 864   | 17.36  | 14,999.04  |
| KKR & CO INC                 | 1,448 | 48.57  | 70,329.36  |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC   | 206   | 188.82 | 38,896.92  |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC     | 96    | 277.64 | 26,653.44  |
| MOODY'S CORP                 | 423   | 277.50 | 117,382.50 |
| MORGAN STANLEY               | 3,397 | 77.82  | 264,354.54 |
| MSCI INC                     | 208   | 432.06 | 89,868.48  |
| NASDAQ INC                   | 291   | 159.28 | 46,350.48  |
| NORTHERN TRUST CORP          | 499   | 97.12  | 48,462.88  |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | 467   | 92.50  | 43,197.50  |
| S&P GLOBAL INC               | 913   | 341.66 | 311,935.58 |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 3,662 | 64.43  | 235,942.66 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | 291   | 55.38  | 16,115.58  |
| STATE STREET CORP            | 923   | 66.27  | 61,167.21  |
| SYNCHRONY FINANCIAL          | 1,387 | 29.54  | 40,971.98  |
| T ROWE PRICE GROUP INC       | 615   | 121.50 | 74,722.50  |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | 271   | 74.08  | 20,075.68  |
| UPSTART HOLDINGS INC         | 160   | 40.95  | 6,552.00   |
| AFLAC INC                    | 1,589 | 55.79  | 88,650.31  |
| ALLEGHANY CORP               | 35    | 833.50 | 29,172.50  |
| ALLSTATE CORP                | 724   | 127.16 | 92,063.84  |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 184   | 137.53 | 25,305.52  |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 2,099 | 52.77  | 110,764.23 |
| AON PLC-CLASS A              | 557   | 271.74 | 151,359.18 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       | 981   | 44.86  | 44,007.66  |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      | 525   | 165.25 | 86,756.25  |
| ASSURANT INC                 | 149   | 172.86 | 25,756.14  |
| BROWN & BROWN INC            | 584   | 59.06  | 34,491.04  |

|                              |       |          |            |
|------------------------------|-------|----------|------------|
| CHUBB LTD                    | 1,089 | 194.53   | 211,843.17 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    | 387   | 116.50   | 45,085.50  |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A  | 72    | 190.96   | 13,749.12  |
| EVEREST RE GROUP LTD         | 100   | 283.19   | 28,319.00  |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL  | 642   | 37.59    | 24,132.78  |
| GLOBE LIFE INC               | 245   | 99.16    | 24,294.20  |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP  | 860   | 65.69    | 56,493.40  |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 466   | 48.98    | 22,824.68  |
| LOEWS CORP                   | 500   | 59.77    | 29,885.00  |
| MARKEL CORP                  | 34    | 1,292.86 | 43,957.24  |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 1,277 | 158.83   | 202,825.91 |
| METLIFE INC                  | 1,803 | 64.22    | 115,788.66 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 664   | 68.55    | 45,517.20  |
| PROGRESSIVE CORP             | 1,480 | 115.99   | 171,665.20 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 953   | 97.41    | 92,831.73  |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 622   | 166.72   | 103,699.84 |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 315   | 204.95   | 64,559.25  |
| MR BERKLEY CORP              | 541   | 68.03    | 36,804.23  |
| CBRE GROUP INC - A           | 847   | 73.13    | 61,941.11  |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | 2,700 | 4.90     | 13,230.00  |
| ZILLOW GROUP INC - C         | 474   | 35.46    | 16,808.04  |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 1,618 | 299.37   | 484,380.66 |
| ADOBE INC                    | 1,202 | 387.72   | 466,039.44 |
| AFFIRM HOLDINGS INC          | 400   | 23.28    | 9,312.00   |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC      | 411   | 94.46    | 38,823.06  |
| ANSYS INC                    | 220   | 256.95   | 56,529.00  |
| APPLOVIN CORP-CLASS A        | 300   | 39.63    | 11,889.00  |
| AUTODESK INC                 | 555   | 192.48   | 106,826.40 |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING    | 1,064 | 218.79   | 232,792.56 |
| AVALARA INC                  | 219   | 84.35    | 18,472.65  |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B  | 600   | 35.58    | 21,348.00  |
| BILL.COM HOLDINGS INC        | 300   | 130.48   | 39,144.00  |
| BLACK KNIGHT INC             | 408   | 66.21    | 27,013.68  |
| BLOCK INC                    | 1,356 | 71.00    | 96,276.00  |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 294   | 145.59   | 42,803.46  |
| CADENCE DESIGN SYS INC       | 699   | 157.62   | 110,176.38 |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC     | 353   | 51.59    | 18,211.27  |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    | 264   | 124.10   | 32,762.40  |
| CITRIX SYSTEMS INC           | 314   | 96.59    | 30,329.26  |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A     | 657   | 51.84    | 34,058.88  |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 1,327 | 70.26    | 93,235.02  |
| COUPA SOFTWARE INC           | 186   | 65.84    | 12,246.24  |

|                              |        |        |              |
|------------------------------|--------|--------|--------------|
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 493    | 184.99 | 91,200.07    |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 113    | 142.80 | 16,136.40    |
| DATADOG INC - CLASS A        | 552    | 107.48 | 59,328.96    |
| DOCUSIGN INC                 | 514    | 68.75  | 35,337.50    |
| DROPBOX INC-CLASS A          | 810    | 22.62  | 18,322.20    |
| DYNATRACE INC                | 474    | 44.08  | 20,893.92    |
| EPAM SYSTEMS INC             | 143    | 326.01 | 46,619.43    |
| FAIR ISAAC CORP              | 65     | 416.15 | 27,049.75    |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV  | 1,539  | 98.63  | 151,791.57   |
| FISERV INC                   | 1,587  | 94.19  | 149,479.53   |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC    | 195    | 217.50 | 42,412.50    |
| FORTINET INC                 | 1,755  | 59.13  | 103,773.15   |
| GARTNER INC                  | 208    | 251.29 | 52,268.32    |
| GLOBAL PAYMENTS INC          | 733    | 118.86 | 87,124.38    |
| GODADDY INC - CLASS A        | 436    | 70.97  | 30,942.92    |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC       | 192    | 77.92  | 14,960.64    |
| HUBSPOT INC                  | 113    | 343.71 | 38,839.23    |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP  | 2,313  | 142.06 | 328,584.78   |
| INTUIT INC                   | 696    | 417.62 | 290,663.52   |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC  | 189    | 182.90 | 34,568.10    |
| MASTERCARD INC - A           | 2,235  | 330.50 | 738,667.50   |
| MICROSOFT CORP               | 18,200 | 267.70 | 4,872,140.00 |
| MONGODB INC                  | 173    | 303.09 | 52,434.57    |
| NORTONLIFELOCK INC           | 1,471  | 22.46  | 33,038.66    |
| OKTA INC                     | 374    | 101.26 | 37,871.24    |
| ORACLE CORP                  | 4,055  | 70.70  | 286,688.50   |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A  | 4,071  | 10.19  | 41,483.49    |
| PALO ALTO NETWORKS INC       | 249    | 510.71 | 127,166.79   |
| PAYCHEX INC                  | 821    | 122.43 | 100,515.03   |
| PAYCOM SOFTWARE INC          | 129    | 306.53 | 39,542.37    |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 2,819  | 77.68  | 218,979.92   |
| PTC INC                      | 291    | 112.44 | 32,720.04    |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A      | 202    | 61.80  | 12,483.60    |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       | 267    | 407.71 | 108,858.57   |
| SALESFORCE INC               | 2,520  | 185.92 | 468,518.40   |
| SERVICENOW INC               | 516    | 504.09 | 260,110.44   |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A        | 539    | 151.53 | 81,674.67    |
| SPLUNK INC                   | 409    | 97.86  | 40,024.74    |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS   | 603    | 60.66  | 36,577.98    |
| SYNOPSYS INC                 | 385    | 317.47 | 122,225.95   |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A  | 1,102  | 49.49  | 54,537.98    |
| TWILIO INC - A               | 426    | 99.12  | 42,225.12    |

|                              |        |        |              |
|------------------------------|--------|--------|--------------|
| TYLER TECHNOLOGIES INC       | 118    | 345.33 | 40,748.94    |
| UNITY SOFTWARE INC           | 546    | 46.81  | 25,558.26    |
| VERISIGN INC                 | 254    | 169.27 | 42,994.58    |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 4,251  | 205.51 | 873,623.01   |
| VMWARE INC-CLASS A           | 530    | 117.96 | 62,518.80    |
| WESTERN UNION CO             | 907    | 16.69  | 15,137.83    |
| WIX.COM LTD                  | 145    | 68.89  | 9,989.05     |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 524    | 152.05 | 79,674.20    |
| ZENDESK INC                  | 305    | 74.17  | 22,621.85    |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A  | 549    | 122.64 | 67,329.36    |
| ZSCALER INC                  | 206    | 170.82 | 35,188.92    |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 1,516  | 65.85  | 99,828.60    |
| APPLE INC                    | 41,695 | 141.66 | 5,906,513.70 |
| ARISTA NETWORKS INC          | 643    | 99.82  | 64,184.26    |
| ARROW ELECTRONICS INC        | 176    | 111.06 | 19,546.56    |
| CDW CORP/DE                  | 343    | 164.34 | 56,368.62    |
| CISCO SYSTEMS INC            | 10,655 | 44.10  | 469,885.50   |
| COGNEX CORP                  | 458    | 45.38  | 20,784.04    |
| CORNING INC                  | 2,050  | 32.76  | 67,158.00    |
| DELL TECHNOLOGIES -C         | 732    | 50.25  | 36,783.00    |
| F5 INC                       | 156    | 158.47 | 24,721.32    |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE   | 3,298  | 14.06  | 46,369.88    |
| HP INC                       | 2,692  | 35.23  | 94,839.16    |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 828    | 29.15  | 24,136.20    |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN     | 465    | 140.48 | 65,323.20    |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 427    | 217.33 | 92,799.91    |
| NETAPP INC                   | 566    | 66.81  | 37,814.46    |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS  | 506    | 74.15  | 37,519.90    |
| TE CONNECTIVITY LTD          | 825    | 118.39 | 97,671.75    |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC    | 118    | 378.02 | 44,606.36    |
| TRIMBLE INC                  | 626    | 61.01  | 38,192.26    |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 854    | 47.07  | 40,197.78    |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 135    | 308.91 | 41,702.85    |
| AT&T INC                     | 18,343 | 20.99  | 385,019.57   |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C        | 594    | 23.17  | 13,762.98    |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A         | 608    | 22.08  | 13,424.64    |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC       | 2,206  | 11.27  | 24,861.62    |
| T-MOBILE US INC              | 1,579  | 137.08 | 216,449.32   |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 10,701 | 50.96  | 545,322.96   |
| AES CORP                     | 1,681  | 21.42  | 36,007.02    |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 637    | 57.32  | 36,512.84    |
| AMEREN CORPORATION           | 655    | 87.91  | 57,581.05    |

|                              |        |        |            |
|------------------------------|--------|--------|------------|
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 1,271  | 93.60  | 118,965.60 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 458    | 148.34 | 67,939.72  |
| ATMOS ENERGY CORP            | 383    | 109.24 | 41,838.92  |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 1,592  | 28.85  | 45,929.20  |
| CMS ENERGY CORP              | 751    | 65.19  | 48,957.69  |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 897    | 92.93  | 83,358.21  |
| CONSTELLATION ENERGY         | 798    | 59.28  | 47,305.44  |
| DOMINION ENERGY INC          | 2,048  | 78.14  | 160,030.72 |
| DTE ENERGY COMPANY           | 491    | 122.91 | 60,348.81  |
| DUKE ENERGY CORP             | 1,999  | 104.53 | 208,955.47 |
| EDISON INTERNATIONAL         | 964    | 62.79  | 60,529.56  |
| ENTERGY CORP                 | 506    | 110.55 | 55,938.30  |
| ESSENTIAL UTILITIES INC      | 585    | 45.96  | 26,886.60  |
| EVERGY INC                   | 608    | 64.11  | 38,978.88  |
| EVERSOURCE ENERGY            | 869    | 83.35  | 72,431.15  |
| EXELON CORP                  | 2,472  | 43.29  | 107,012.88 |
| FIRSTENERGY CORP             | 1,367  | 37.29  | 50,975.43  |
| NEXTERA ENERGY INC           | 5,043  | 78.02  | 393,454.86 |
| NISOURCE INC                 | 1,003  | 28.62  | 28,705.86  |
| NRG ENERGY INC               | 585    | 38.32  | 22,417.20  |
| P G & E CORP                 | 3,764  | 10.25  | 38,581.00  |
| PPL CORP                     | 1,909  | 27.08  | 51,695.72  |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 1,284  | 62.51  | 80,262.84  |
| SEMPRA ENERGY                | 809    | 149.44 | 120,896.96 |
| SOUTHERN CO/THE              | 2,760  | 69.83  | 192,730.80 |
| UGI CORP                     | 505    | 39.47  | 19,932.35  |
| VISTRA CORP                  | 1,086  | 23.39  | 25,401.54  |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 798    | 97.16  | 77,533.68  |
| XCEL ENERGY INC              | 1,442  | 68.56  | 98,863.52  |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 4,199  | 87.08  | 365,648.92 |
| ANALOG DEVICES INC           | 1,356  | 149.69 | 202,979.64 |
| APPLIED MATERIALS INC        | 2,283  | 97.36  | 222,272.88 |
| BROADCOM INC                 | 1,051  | 509.09 | 535,053.59 |
| ENPHASE ENERGY INC           | 360    | 198.39 | 71,420.40  |
| ENTEGRIS INC                 | 344    | 103.90 | 35,741.60  |
| INTEL CORP                   | 10,425 | 38.61  | 402,509.25 |
| KLA CORP                     | 384    | 339.50 | 130,368.00 |
| LAM RESEARCH CORP            | 356    | 450.19 | 160,267.64 |
| MARVELL TECHNOLOGY INC       | 2,197  | 48.22  | 105,939.34 |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC     | 1,403  | 60.58  | 84,993.74  |
| MICRON TECHNOLOGY INC        | 2,826  | 58.44  | 165,151.44 |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 111    | 419.41 | 46,554.51  |

|       |                              |         |        |                                   |  |
|-------|------------------------------|---------|--------|-----------------------------------|--|
|       | NVIDIA CORP                  | 6,384   | 171.26 | 1,093,323.84                      |  |
|       | NXP SEMICONDUCTORS NV        | 672     | 159.32 | 107,063.04                        |  |
|       | ON SEMICONDUCTOR             | 1,091   | 52.97  | 57,790.27                         |  |
|       | QORVO INC                    | 275     | 97.87  | 26,914.25                         |  |
|       | QUALCOMM INC                 | 2,878   | 125.10 | 360,037.80                        |  |
|       | SKYWORKS SOLUTIONS INC       | 418     | 98.03  | 40,976.54                         |  |
|       | SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC  | 128     | 286.34 | 36,651.52                         |  |
|       | TERADYNE INC                 | 414     | 97.12  | 40,207.68                         |  |
|       | TEXAS INSTRUMENTS INC        | 2,370   | 155.95 | 369,601.50                        |  |
|       | アメリカドル 小計                    | 844,304 |        | 86,895,280.09<br>(11,696,973,652) |  |
| カナダドル | ARC RESOURCES LTD            | 1,700   | 15.00  | 25,500.00                         |  |
|       | CAMECO CORP                  | 1,000   | 29.01  | 29,010.00                         |  |
|       | CANADIAN NATURAL RESOURCES   | 3,000   | 65.14  | 195,420.00                        |  |
|       | CENOVUS ENERGY INC           | 3,600   | 24.29  | 87,444.00                         |  |
|       | ENBRIDGE INC                 | 5,100   | 53.85  | 274,635.00                        |  |
|       | IMPERIAL OIL LTD             | 600     | 60.42  | 36,252.00                         |  |
|       | KEYERA CORP                  | 500     | 29.00  | 14,500.00                         |  |
|       | PARKLAND CORP                | 400     | 33.11  | 13,244.00                         |  |
|       | PEMBINA PIPELINE CORP        | 1,457   | 44.28  | 64,515.96                         |  |
|       | SUNCOR ENERGY INC            | 3,700   | 44.55  | 164,835.00                        |  |
|       | TC ENERGY CORP               | 2,500   | 66.81  | 167,025.00                        |  |
|       | TOURMALINE OIL CORP          | 800     | 63.88  | 51,104.00                         |  |
|       | AGNICO EAGLE MINES LTD       | 1,155   | 63.44  | 73,273.20                         |  |
|       | BARRICK GOLD CORP            | 4,500   | 24.23  | 109,035.00                        |  |
|       | CCL INDUSTRIES INC - CL B    | 400     | 60.48  | 24,192.00                         |  |
|       | FIRST QUANTUM MINERALS LTD   | 1,600   | 25.88  | 41,408.00                         |  |
|       | FRANCO-NEVADA CORP           | 500     | 178.62 | 89,310.00                         |  |
|       | IVANHOE MINES LTD-CL A       | 1,800   | 7.49   | 13,482.00                         |  |
|       | KINROSS GOLD CORP            | 3,100   | 5.16   | 15,996.00                         |  |
|       | LUNDIN MINING CORP           | 1,600   | 8.48   | 13,568.00                         |  |
|       | NUTRIEN LTD                  | 1,388   | 103.45 | 143,588.60                        |  |
|       | PAN AMERICAN SILVER CORP     | 600     | 27.18  | 16,308.00                         |  |
|       | TECK RESOURCES LTD-CLS B     | 1,200   | 40.86  | 49,032.00                         |  |
|       | WEST FRASER TIMBER CO LTD    | 200     | 97.63  | 19,526.00                         |  |
|       | WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 1,100   | 49.27  | 54,197.00                         |  |
|       | CAE INC                      | 700     | 32.14  | 22,498.00                         |  |
|       | TOROMONT INDUSTRIES LTD      | 200     | 100.95 | 20,190.00                         |  |
|       | WSP GLOBAL INC               | 300     | 141.86 | 42,558.00                         |  |
|       | GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT | 500     | 35.27  | 17,635.00                         |  |
|       | RITCHIE BROS AUCTIONEERS     | 300     | 79.60  | 23,880.00                         |  |
|       | THOMSON REUTERS CORP         | 423     | 134.19 | 56,762.37                         |  |

|                              |       |          |            |  |
|------------------------------|-------|----------|------------|--|
| AIR CANADA                   | 300   | 17.42    | 5,226.00   |  |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     | 1,500 | 146.75   | 220,125.00 |  |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 2,400 | 90.95    | 218,280.00 |  |
| TFI INTERNATIONAL INC        | 200   | 101.34   | 20,268.00  |  |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      | 800   | 74.61    | 59,688.00  |  |
| BRP INC/CA- SUB VOTING       | 100   | 83.98    | 8,398.00   |  |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        | 400   | 36.95    | 14,780.00  |  |
| RESTAURANT BRANDS INTERN     | 780   | 64.16    | 50,044.80  |  |
| QUEBECOR INC -CL B           | 400   | 28.65    | 11,460.00  |  |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B    | 1,200 | 38.25    | 45,900.00  |  |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A   | 100   | 166.29   | 16,629.00  |  |
| DOLLARAMA INC                | 700   | 74.95    | 52,465.00  |  |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 2,200 | 55.17    | 121,374.00 |  |
| EMPIRE CO LTD 'A'            | 500   | 39.89    | 19,945.00  |  |
| LOBLAW COMPANIES LTD         | 400   | 114.71   | 45,884.00  |  |
| METRO INC/CN                 | 600   | 68.88    | 41,328.00  |  |
| WESTON (GEORGE) LTD          | 116   | 147.41   | 17,099.56  |  |
| SAPUTO INC                   | 700   | 28.76    | 20,132.00  |  |
| BAUSCH HEALTH COS INC        | 800   | 11.28    | 9,024.00   |  |
| BANK OF MONTREAL             | 1,700 | 123.16   | 209,372.00 |  |
| BANK OF NOVA SCOTIA          | 3,100 | 75.56    | 234,236.00 |  |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  | 2,300 | 63.25    | 145,475.00 |  |
| NATIONAL BANK OF CANADA      | 900   | 83.60    | 75,240.00  |  |
| ROYAL BANK OF CANADA         | 3,600 | 124.34   | 447,624.00 |  |
| TORONTO-DOMINION BANK        | 4,700 | 83.74    | 393,578.00 |  |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 3,600 | 58.87    | 211,932.00 |  |
| IGM FINANCIAL INC            | 200   | 35.93    | 7,186.00   |  |
| ONEX CORPORATION             | 200   | 65.70    | 13,140.00  |  |
| TMX GROUP LTD                | 200   | 133.37   | 26,674.00  |  |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD  | 60    | 636.77   | 38,206.20  |  |
| GREAT-WEST LIFECO INC        | 800   | 31.14    | 24,912.00  |  |
| IA FINANCIAL CORP INC        | 300   | 61.45    | 18,435.00  |  |
| INTACT FINANCIAL CORP        | 400   | 180.42   | 72,168.00  |  |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      | 4,900 | 21.92    | 107,408.00 |  |
| POWER CORP OF CANADA         | 1,500 | 33.69    | 50,535.00  |  |
| SUN LIFE FINANCIAL INC       | 1,500 | 59.05    | 88,575.00  |  |
| FIRSTSERVICE CORP            | 100   | 159.20   | 15,920.00  |  |
| BLACKBERRY LTD               | 1,600 | 7.40     | 11,840.00  |  |
| CGI INC                      | 600   | 103.73   | 62,238.00  |  |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC   | 50    | 1,948.66 | 97,433.00  |  |
| LIGHTSPEED COMMERCE INC      | 300   | 32.82    | 9,846.00   |  |
| NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG   | 200   | 51.18    | 10,236.00  |  |

|               |                              |         |        |                               |  |
|---------------|------------------------------|---------|--------|-------------------------------|--|
|               | OPEN TEXT CORP               | 700     | 51.10  | 35,770.00                     |  |
|               | SHOPIFY INC - CLASS A        | 290     | 497.09 | 144,156.10                    |  |
|               | BCE INC                      | 200     | 63.28  | 12,656.00                     |  |
|               | ROGERS COMMUNICATIONS INC-B  | 900     | 62.43  | 56,187.00                     |  |
|               | TELUS CORP                   | 1,100   | 28.89  | 31,779.00                     |  |
|               | ALGONQUIN POWER & UTILITIES  | 1,600   | 17.86  | 28,576.00                     |  |
|               | ALTAGAS LTD                  | 800     | 26.84  | 21,472.00                     |  |
|               | BROOKFIELD RENEWABLE COR-A   | 300     | 47.03  | 14,109.00                     |  |
|               | CANADIAN UTILITIES LTD-A     | 300     | 37.70  | 11,310.00                     |  |
|               | EMERA INC                    | 700     | 59.80  | 41,860.00                     |  |
|               | FORTIS INC                   | 1,200   | 59.77  | 71,724.00                     |  |
|               | HYDRO ONE LTD                | 800     | 33.87  | 27,096.00                     |  |
|               | NORTHLAND POWER INC          | 500     | 38.55  | 19,275.00                     |  |
|               | カナダドル 小計                     | 102,319 |        | 5,856,153.79<br>(610,328,347) |  |
| オーストラリア<br>ドル | AMPOL LTD                    | 557     | 33.15  | 18,464.55                     |  |
|               | SANTOS LTD                   | 8,156   | 7.22   | 58,886.32                     |  |
|               | WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 506     | 23.23  | 11,754.38                     |  |
|               | WOODSIDE ENERGY GROUP LTD    | 4,801   | 30.61  | 146,958.61                    |  |
|               | BHP GROUP LTD                | 12,982  | 40.02  | 519,539.64                    |  |
|               | BLUESCOPE STEEL LTD          | 1,219   | 15.63  | 19,052.97                     |  |
|               | EVOLUTION MINING LTD         | 5,134   | 3.38   | 17,352.92                     |  |
|               | FORTESCUE METALS GROUP LTD   | 4,181   | 17.28  | 72,247.68                     |  |
|               | JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI  | 1,184   | 32.18  | 38,101.12                     |  |
|               | MINERAL RESOURCES LTD        | 500     | 48.20  | 24,100.00                     |  |
|               | NEWCREST MINING LTD          | 2,429   | 23.04  | 55,964.16                     |  |
|               | NORTHERN STAR RESOURCES LTD  | 2,655   | 7.99   | 21,213.45                     |  |
|               | ORICA LTD                    | 941     | 15.47  | 14,557.27                     |  |
|               | RIO TINTO LTD                | 941     | 101.40 | 95,417.40                     |  |
|               | SOUTH32 LTD                  | 11,968  | 3.99   | 47,752.32                     |  |
|               | REECE LTD                    | 697     | 14.19  | 9,890.43                      |  |
|               | BRAMBLES LTD                 | 3,695   | 10.88  | 40,201.60                     |  |
|               | AURIZON HOLDINGS LTD         | 5,283   | 3.74   | 19,758.42                     |  |
|               | QANTAS AIRWAYS LTD           | 2,324   | 4.45   | 10,341.80                     |  |
|               | TRANSURBAN GROUP             | 7,795   | 14.23  | 110,922.85                    |  |
|               | ARISTOCRAT LEISURE LTD       | 1,544   | 33.52  | 51,754.88                     |  |
|               | DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L | 146     | 66.15  | 9,657.90                      |  |
|               | IDP EDUCATION LTD            | 622     | 23.89  | 14,859.58                     |  |
|               | LOTTERY CORP LTD/THE         | 5,855   | 4.58   | 26,815.90                     |  |
|               | REA GROUP LTD                | 142     | 114.07 | 16,197.94                     |  |
|               | SEEK LTD                     | 963     | 21.35  | 20,560.05                     |  |
|               | WESFARMERS LTD               | 2,874   | 43.81  | 125,909.94                    |  |

|         |                                |         |        |                               |  |
|---------|--------------------------------|---------|--------|-------------------------------|--|
|         | COLES GROUP LTD                | 3,280   | 17.81  | 58,416.80                     |  |
|         | ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA  | 3,419   | 7.46   | 25,505.74                     |  |
|         | WOOLWORTHS GROUP LTD           | 3,073   | 35.46  | 108,968.58                    |  |
|         | TREASURY WINE ESTATES LTD      | 1,804   | 11.30  | 20,385.20                     |  |
|         | COCHLEAR LTD                   | 160     | 195.16 | 31,225.60                     |  |
|         | RAMSAY HEALTH CARE LTD         | 437     | 71.52  | 31,254.24                     |  |
|         | SONIC HEALTHCARE LTD           | 1,162   | 33.31  | 38,706.22                     |  |
|         | CSL LTD                        | 1,244   | 271.25 | 337,435.00                    |  |
|         | AUST AND NZ BANKING GROUP      | 7,134   | 21.91  | 156,305.94                    |  |
|         | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 4,315   | 90.16  | 389,040.40                    |  |
|         | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD    | 8,284   | 27.02  | 223,833.68                    |  |
|         | WESTPAC BANKING CORP           | 8,912   | 19.48  | 173,605.76                    |  |
|         | ASX LTD                        | 488     | 82.04  | 40,035.52                     |  |
|         | MACQUARIE GROUP LTD            | 931     | 165.33 | 153,922.23                    |  |
|         | INSURANCE AUSTRALIA GROUP      | 6,395   | 4.36   | 27,882.20                     |  |
|         | MEDIBANK PRIVATE LTD           | 6,661   | 3.23   | 21,515.03                     |  |
|         | QBE INSURANCE GROUP LTD        | 3,778   | 12.05  | 45,524.90                     |  |
|         | SUNCORP GROUP LTD              | 3,194   | 10.84  | 34,622.96                     |  |
|         | LENDLEASE GROUP                | 1,565   | 9.21   | 14,413.65                     |  |
|         | COMPUTERSHARE LTD              | 1,249   | 23.65  | 29,538.85                     |  |
|         | WISETECH GLOBAL LTD            | 371     | 39.00  | 14,469.00                     |  |
|         | XERO LTD                       | 357     | 82.15  | 29,327.55                     |  |
|         | TELSTRA CORP LTD               | 11,202  | 3.89   | 43,575.78                     |  |
|         | APA GROUP                      | 3,043   | 11.50  | 34,994.50                     |  |
|         | ORIGIN ENERGY LTD              | 5,149   | 5.55   | 28,576.95                     |  |
|         | オーストラリアドル 小計                   | 177,701 |        | 3,731,316.36<br>(346,825,855) |  |
| イギリスポンド | BP PLC                         | 49,918  | 3.86   | 192,933.07                    |  |
|         | SHELL PLC                      | 19,467  | 20.87  | 406,373.62                    |  |
|         | ANGLO AMERICAN PLC             | 3,232   | 30.66  | 99,093.12                     |  |
|         | ANTOFAGASTA PLC                | 960     | 11.84  | 11,371.20                     |  |
|         | CRODA INTERNATIONAL PLC        | 337     | 63.04  | 21,244.48                     |  |
|         | GLENCORE PLC                   | 25,114  | 4.46   | 112,071.22                    |  |
|         | JOHNSON MATTHEY PLC            | 520     | 19.85  | 10,324.60                     |  |
|         | MONDI PLC                      | 1,226   | 14.76  | 18,101.89                     |  |
|         | RIO TINTO PLC                  | 2,836   | 49.79  | 141,204.44                    |  |
|         | ASHTED GROUP PLC               | 1,128   | 35.51  | 40,055.28                     |  |
|         | BAE SYSTEMS PLC                | 8,037   | 7.83   | 62,929.71                     |  |
|         | BUNZL PLC                      | 864     | 26.44  | 22,844.16                     |  |
|         | DCC PLC                        | 253     | 50.02  | 12,655.06                     |  |
|         | FERGUSON PLC                   | 560     | 92.00  | 51,520.00                     |  |
|         | MELROSE INDUSTRIES PLC         | 11,788  | 1.51   | 17,900.07                     |  |

|                              |         |        |            |
|------------------------------|---------|--------|------------|
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC     | 22,200  | 0.80   | 17,968.68  |
| SMITHS GROUP PLC             | 904     | 13.99  | 12,646.96  |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 193     | 97.00  | 18,721.00  |
| EXPERIAN PLC                 | 2,341   | 23.90  | 55,949.90  |
| INTERTEK GROUP PLC           | 393     | 43.25  | 16,997.25  |
| RELX PLC                     | 4,901   | 22.05  | 108,067.05 |
| RENTOKIL INITIAL PLC         | 4,847   | 4.82   | 23,396.46  |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     | 2,276   | 4.72   | 10,744.99  |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE  | 290     | 37.36  | 10,834.40  |
| BURBERRY GROUP PLC           | 1,068   | 16.98  | 18,134.64  |
| PERSIMMON PLC                | 813     | 18.71  | 15,215.29  |
| TAYLOR WIMPEY PLC            | 8,804   | 1.18   | 10,423.93  |
| COMPASS GROUP PLC            | 4,531   | 16.97  | 76,891.07  |
| ENTAIN PLC                   | 1,492   | 13.36  | 19,933.12  |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 483     | 44.04  | 21,271.32  |
| WHITBREAD PLC                | 456     | 25.56  | 11,655.36  |
| AUTO TRADER GROUP PLC        | 2,260   | 5.50   | 12,430.00  |
| INFORMA PLC                  | 3,841   | 5.42   | 20,841.26  |
| PEARSON PLC                  | 1,922   | 7.80   | 15,006.97  |
| WPP PLC                      | 3,099   | 8.10   | 25,101.90  |
| JD SPORTS FASHION PLC        | 6,745   | 1.19   | 8,033.29   |
| KINGFISHER PLC               | 5,496   | 2.43   | 13,371.76  |
| NEXT PLC                     | 340     | 59.82  | 20,338.80  |
| OCADO GROUP PLC              | 1,100   | 8.70   | 9,576.60   |
| SAINSBURY (J) PLC            | 4,929   | 2.10   | 10,390.33  |
| TESCO PLC                    | 19,411  | 2.55   | 49,575.69  |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 1,005   | 16.36  | 16,441.80  |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 5,513   | 35.30  | 194,636.46 |
| COCA-COLA HBC AG-DI          | 447     | 18.15  | 8,113.05   |
| DIAGEO PLC                   | 5,895   | 36.58  | 215,668.57 |
| IMPERIAL BRANDS PLC          | 2,394   | 18.38  | 44,013.69  |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 1,808   | 62.46  | 112,927.68 |
| UNILEVER PLC                 | 6,631   | 37.37  | 247,800.47 |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 2,260   | 11.65  | 26,329.00  |
| ASTRAZENECA PLC              | 3,962   | 107.76 | 426,945.12 |
| GSK PLC                      | 13,003  | 17.56  | 228,358.68 |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC    | 361     | 16.37  | 5,909.57   |
| BARCLAYS PLC                 | 42,294  | 1.58   | 67,222.08  |
| HSBC HOLDINGS PLC            | 51,449  | 5.37   | 276,435.47 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 179,529 | 0.43   | 77,906.60  |
| NATWEST GROUP PLC            | 13,892  | 2.21   | 30,770.78  |
| STANDARD CHARTERED PLC       | 6,476   | 5.89   | 38,169.54  |

|        |                              |         |          |                               |  |
|--------|------------------------------|---------|----------|-------------------------------|--|
|        | 3I GROUP PLC                 | 2,445   | 11.22    | 27,445.12                     |  |
|        | ABRDN PLC                    | 6,100   | 1.70     | 10,427.95                     |  |
|        | HARGREAVES LANSDOWN PLC      | 905     | 8.04     | 7,281.63                      |  |
|        | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  | 832     | 76.00    | 63,232.00                     |  |
|        | M&G PLC                      | 6,694   | 1.98     | 13,294.28                     |  |
|        | SCHRODERS PLC                | 293     | 27.68    | 8,110.24                      |  |
|        | ST JAMES'S PLACE PLC         | 1,350   | 11.49    | 15,511.50                     |  |
|        | ADMIRAL GROUP PLC            | 491     | 22.19    | 10,895.29                     |  |
|        | AVIVA PLC                    | 7,225   | 4.11     | 29,730.87                     |  |
|        | LEGAL & GENERAL GROUP PLC    | 16,539  | 2.44     | 40,454.39                     |  |
|        | PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC   | 1,739   | 6.20     | 10,795.71                     |  |
|        | PRUDENTIAL PLC               | 6,943   | 9.86     | 68,471.86                     |  |
|        | AVEVA GROUP PLC              | 270     | 24.63    | 6,650.10                      |  |
|        | SAGE GROUP PLC/THE           | 2,629   | 6.46     | 16,993.85                     |  |
|        | HALMA PLC                    | 972     | 19.96    | 19,405.98                     |  |
|        | BT GROUP PLC                 | 17,798  | 1.88     | 33,549.23                     |  |
|        | VODAFONE GROUP PLC           | 69,201  | 1.26     | 87,539.26                     |  |
|        | NATIONAL GRID PLC            | 9,568   | 10.51    | 100,559.68                    |  |
|        | SEVERN TRENT PLC             | 644     | 27.89    | 17,961.16                     |  |
|        | SSE PLC                      | 2,781   | 16.49    | 45,872.59                     |  |
|        | UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 1,875   | 10.12    | 18,975.00                     |  |
|        | イギリスポンド 小計                   | 725,588 |          | 4,524,946.19<br>(747,204,364) |  |
| スイスフラン | CLARIANT AG-REG              | 508     | 17.72    | 9,001.76                      |  |
|        | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    | 17      | 723.00   | 12,291.00                     |  |
|        | GIVAUDAN-REG                 | 23      | 3,310.00 | 76,130.00                     |  |
|        | HOLCIM LTD                   | 1,456   | 43.72    | 63,656.32                     |  |
|        | SIKA AG-REG                  | 383     | 227.30   | 87,055.90                     |  |
|        | ABB LTD-REG                  | 4,169   | 25.46    | 106,142.74                    |  |
|        | GEBERIT AG-REG               | 92      | 477.00   | 43,884.00                     |  |
|        | SCHINDLER HOLDING AG-REG     | 63      | 169.00   | 10,647.00                     |  |
|        | SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 95      | 172.05   | 16,344.75                     |  |
|        | VAT GROUP AG                 | 67      | 243.20   | 16,294.40                     |  |
|        | ADECCO GROUP AG-REG          | 350     | 33.86    | 11,851.00                     |  |
|        | SGS SA-REG                   | 17      | 2,205.00 | 37,485.00                     |  |
|        | KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG   | 134     | 226.10   | 30,297.40                     |  |
|        | CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 1,322   | 102.15   | 135,042.30                    |  |
|        | SWATCH GROUP AG/THE-BR       | 81      | 232.40   | 18,824.40                     |  |
|        | SWATCH GROUP AG/THE-REG      | 93      | 43.34    | 4,030.62                      |  |
|        | BARRY CALLEBAUT AG-REG       | 9       | 2,146.00 | 19,314.00                     |  |
|        | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   | 5       | 9,600.00 | 48,000.00                     |  |
|        | NESTLE SA-REG                | 7,203   | 111.64   | 804,142.92                    |  |

|      |                              |        |        |                               |  |
|------|------------------------------|--------|--------|-------------------------------|--|
|      | ALCON INC                    | 1,272  | 66.14  | 84,130.08                     |  |
|      | SONOVA HOLDING AG-REG        | 137    | 309.00 | 42,333.00                     |  |
|      | STRAUMANN HOLDING AG-REG     | 312    | 110.15 | 34,366.80                     |  |
|      | BACHEM HOLDING AG-REG B      | 90     | 71.90  | 6,471.00                      |  |
|      | LONZA GROUP AG-REG           | 189    | 512.80 | 96,919.20                     |  |
|      | NOVARTIS AG-REG              | 5,607  | 80.60  | 451,924.20                    |  |
|      | ROCHE HOLDING AG-BR          | 63     | 361.80 | 22,793.40                     |  |
|      | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 1,802  | 318.80 | 574,477.60                    |  |
|      | VIFOR PHARMA AG-NEW          | 119    | 164.50 | 19,575.50                     |  |
|      | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   | 6,552  | 5.72   | 37,477.44                     |  |
|      | JULIUS BAER GROUP LTD        | 602    | 45.26  | 27,246.52                     |  |
|      | PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 58     | 895.00 | 51,910.00                     |  |
|      | UBS GROUP AG-REG             | 8,895  | 15.99  | 142,275.52                    |  |
|      | BALOISE HOLDING AG - REG     | 108    | 155.70 | 16,815.60                     |  |
|      | SWISS LIFE HOLDING AG-REG    | 79     | 472.00 | 37,288.00                     |  |
|      | SWISS RE AG                  | 767    | 75.12  | 57,617.04                     |  |
|      | ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 381    | 418.00 | 159,258.00                    |  |
|      | SWISS PRIME SITE-REG         | 214    | 85.45  | 18,286.30                     |  |
|      | TEMENOS AG - REG             | 172    | 84.84  | 14,592.48                     |  |
|      | LOGITECH INTERNATIONAL-REG   | 452    | 53.38  | 24,127.76                     |  |
|      | SWISSCOM AG-REG              | 67     | 522.40 | 35,000.80                     |  |
|      | スイスフラン 小計                    | 44,025 |        | 3,505,321.75<br>(492,743,078) |  |
| 香港ドル | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    | 6,832  | 52.85  | 361,071.20                    |  |
|      | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 3,500  | 84.65  | 296,275.00                    |  |
|      | XINYI GLASS HOLDINGS LTD     | 4,000  | 18.20  | 72,800.00                     |  |
|      | MTR CORP                     | 4,000  | 41.00  | 164,000.00                    |  |
|      | SITC INTERNATIONAL HOLDINGS  | 4,000  | 22.80  | 91,200.00                     |  |
|      | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 6,000  | 42.00  | 252,000.00                    |  |
|      | SANDS CHINA LTD              | 6,400  | 15.10  | 96,640.00                     |  |
|      | CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU | 5,600  | 14.14  | 79,184.00                     |  |
|      | BUDWEISER BREWING CO APAC LT | 3,700  | 22.60  | 83,620.00                     |  |
|      | WH GROUP LTD                 | 21,000 | 5.60   | 117,600.00                    |  |
|      | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD   | 9,500  | 31.00  | 294,500.00                    |  |
|      | HANG SENG BANK LTD           | 2,000  | 138.00 | 276,000.00                    |  |
|      | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR  | 3,000  | 374.20 | 1,122,600.00                  |  |
|      | AIA GROUP LTD                | 31,200 | 80.60  | 2,514,720.00                  |  |
|      | CK ASSET HOLDINGS LTD        | 5,332  | 54.60  | 291,127.20                    |  |
|      | ESR GROUP LTD                | 4,400  | 20.20  | 88,880.00                     |  |
|      | HANG LUNG PROPERTIES LTD     | 5,000  | 14.40  | 72,000.00                     |  |
|      | HENDERSON LAND DEVELOPMENT   | 4,118  | 29.00  | 119,422.00                    |  |
|      | NEW WORLD DEVELOPMENT        | 4,250  | 28.15  | 119,637.50                    |  |

|            |                              |         |        |                               |  |
|------------|------------------------------|---------|--------|-------------------------------|--|
|            | SINO LAND CO                 | 7,000   | 11.22  | 78,540.00                     |  |
|            | SUN HUNG KAI PROPERTIES      | 3,500   | 92.00  | 322,000.00                    |  |
|            | SWIRE PACIFIC LTD - CL A     | 1,000   | 46.20  | 46,200.00                     |  |
|            | SWIRE PROPERTIES LTD         | 2,200   | 19.00  | 41,800.00                     |  |
|            | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 4,000   | 35.35  | 141,400.00                    |  |
|            | HKT TRUST AND HKT LTD-SS     | 10,000  | 10.52  | 105,200.00                    |  |
|            | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 1,500   | 48.45  | 72,675.00                     |  |
|            | CLP HOLDINGS LTD             | 4,000   | 65.20  | 260,800.00                    |  |
|            | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS  | 6,500   | 7.23   | 46,995.00                     |  |
|            | HONG KONG & CHINA GAS        | 28,474  | 8.37   | 238,327.38                    |  |
|            | POWER ASSETS HOLDINGS LTD    | 4,000   | 48.60  | 194,400.00                    |  |
|            | 香港ドル 小計                      | 206,006 |        | 8,061,614.28<br>(138,256,684) |  |
| シンガポールドル   | KEPPEL CORP LTD              | 3,500   | 6.56   | 22,960.00                     |  |
|            | SINGAPORE TECH ENGINEERING   | 3,000   | 4.01   | 12,030.00                     |  |
|            | SINGAPORE AIRLINES LTD       | 3,900   | 5.15   | 20,085.00                     |  |
|            | GENTING SINGAPORE LTD        | 12,300  | 0.72   | 8,917.50                      |  |
|            | WILMAR INTERNATIONAL LTD     | 4,900   | 4.05   | 19,845.00                     |  |
|            | DBS GROUP HOLDINGS LTD       | 4,600   | 29.81  | 137,126.00                    |  |
|            | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 8,700   | 11.33  | 98,571.00                     |  |
|            | UNITED OVERSEAS BANK LTD     | 3,000   | 26.40  | 79,200.00                     |  |
|            | SINGAPORE EXCHANGE LTD       | 2,000   | 9.47   | 18,940.00                     |  |
|            | CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI | 6,900   | 3.85   | 26,565.00                     |  |
|            | CITY DEVELOPMENTS LTD        | 1,500   | 8.16   | 12,240.00                     |  |
|            | UOL GROUP LTD                | 1,800   | 7.34   | 13,212.00                     |  |
|            | VENTURE CORP LTD             | 700     | 16.71  | 11,697.00                     |  |
|            | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 21,700  | 2.58   | 55,986.00                     |  |
|            | シンガポールドル 小計                  | 78,500  |        | 537,374.50<br>(52,195,185)    |  |
| ニュージーランドドル | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    | 2,910   | 7.32   | 21,315.75                     |  |
|            | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 1,585   | 19.73  | 31,272.05                     |  |
|            | SPARK NEW ZEALAND LTD        | 4,546   | 4.78   | 21,729.88                     |  |
|            | MERCURY NZ LTD               | 1,273   | 5.59   | 7,116.07                      |  |
|            | MERIDIAN ENERGY LTD          | 3,652   | 4.42   | 16,141.84                     |  |
|            | ニュージーランドドル 小計                | 13,966  |        | 97,575.59<br>(8,269,531)      |  |
| スウェーデンクローネ | BOLIDEN AB                   | 707     | 330.50 | 233,663.50                    |  |
|            | HOLMEN AB-B SHARES           | 252     | 422.20 | 106,394.40                    |  |
|            | SVENSKA CELLULOSE AB SCA-B   | 1,552   | 153.30 | 237,921.60                    |  |
|            | ALFA LAVAL AB                | 775     | 246.30 | 190,882.50                    |  |
|            | ASSA ABLOY AB-B              | 2,540   | 212.50 | 539,750.00                    |  |
|            | ATLAS COPCO AB-A SHS         | 6,920   | 94.33  | 652,763.60                    |  |
|            | ATLAS COPCO AB-B SHS         | 3,860   | 83.96  | 324,085.60                    |  |

|                              |        |        |                                |  |
|------------------------------|--------|--------|--------------------------------|--|
| EPIROC AB-A                  | 1,654  | 159.00 | 262,986.00                     |  |
| EPIROC AB-B                  | 1,010  | 136.20 | 137,562.00                     |  |
| HUSQVARNA AB-B SHS           | 1,008  | 75.34  | 75,942.72                      |  |
| INDUTRADE AB                 | 800    | 183.30 | 146,640.00                     |  |
| INVESTMENT AB LATOUR-B SHS   | 423    | 198.70 | 84,050.10                      |  |
| LIFCO AB-B SHS               | 500    | 160.15 | 80,075.00                      |  |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS     | 4,217  | 72.28  | 304,804.76                     |  |
| SANDVIK AB                   | 2,875  | 167.50 | 481,562.50                     |  |
| SKANSKA AB-B SHS             | 796    | 150.50 | 119,798.00                     |  |
| SKF AB-B SHARES              | 930    | 149.45 | 138,988.50                     |  |
| VOLVO AB-A SHS               | 445    | 163.30 | 72,668.50                      |  |
| VOLVO AB-B SHS               | 4,063  | 157.28 | 639,028.64                     |  |
| SECURITAS AB-B SHS           | 897    | 87.04  | 78,074.88                      |  |
| VOLVO CAR AB-B               | 1,500  | 78.00  | 117,000.00                     |  |
| ELECTROLUX AB-B              | 455    | 134.64 | 61,261.20                      |  |
| EVOLUTION AB                 | 467    | 961.30 | 448,927.10                     |  |
| EMBRACER GROUP AB            | 1,300  | 79.44  | 103,272.00                     |  |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS    | 1,913  | 121.48 | 232,391.24                     |  |
| SWEDISH MATCH AB             | 3,830  | 100.90 | 386,447.00                     |  |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B          | 1,464  | 262.20 | 383,860.80                     |  |
| GETINGE AB-B SHS             | 567    | 230.40 | 130,636.80                     |  |
| SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB  | 458    | 217.30 | 99,523.40                      |  |
| NORDEA BANK ABP              | 8,177  | 93.30  | 762,914.10                     |  |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 4,153  | 101.60 | 421,944.80                     |  |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 3,547  | 87.00  | 308,589.00                     |  |
| SWEDBANK AB - A SHARES       | 2,313  | 130.85 | 302,656.05                     |  |
| EQT AB                       | 856    | 215.60 | 184,553.60                     |  |
| INDUSTRIVARDEN AB-A SHS      | 231    | 228.10 | 52,691.10                      |  |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS      | 544    | 226.00 | 122,944.00                     |  |
| INVESTOR AB-A SHS            | 1,300  | 182.80 | 237,640.00                     |  |
| INVESTOR AB-B SHS            | 4,615  | 165.60 | 764,244.00                     |  |
| KINNEVIK AB - B              | 570    | 162.45 | 92,596.50                      |  |
| LUNDBERGS AB-B SHS           | 218    | 416.00 | 90,688.00                      |  |
| FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS  | 1,722  | 51.75  | 89,113.50                      |  |
| SAGAX AB-B                   | 500    | 194.00 | 97,000.00                      |  |
| SINCH AB                     | 1,600  | 38.43  | 61,488.00                      |  |
| ERICSSON LM-B SHS            | 7,389  | 78.19  | 577,745.91                     |  |
| HEXAGON AB-B SHS             | 4,909  | 105.70 | 518,881.30                     |  |
| TELE2 AB-B SHS               | 1,425  | 114.10 | 162,592.50                     |  |
| TELIA CO AB                  | 6,823  | 39.08  | 266,642.84                     |  |
| スウェーデンクローネ 小計                | 99,070 |        | 11,985,887.54<br>(159,172,586) |  |

|              |                           |        |           |                               |  |
|--------------|---------------------------|--------|-----------|-------------------------------|--|
| ノルウェークローネ    | AKER BP ASA               | 807    | 331.70    | 267,681.90                    |  |
|              | EQUINOR ASA               | 2,505  | 324.25    | 812,246.25                    |  |
|              | NORSK HYDRO ASA           | 3,237  | 60.38     | 195,450.06                    |  |
|              | YARA INTERNATIONAL ASA    | 412    | 428.00    | 176,336.00                    |  |
|              | KONGSBERG GRUPPEN ASA     | 300    | 324.40    | 97,320.00                     |  |
|              | ADEVINTA ASA              | 545    | 76.55     | 41,719.75                     |  |
|              | MOWI ASA                  | 1,148  | 225.80    | 259,218.40                    |  |
|              | ORKLA ASA                 | 1,843  | 75.34     | 138,851.62                    |  |
|              | SALMAR ASA                | 163    | 659.50    | 107,498.50                    |  |
|              | DNB BANK ASA              | 2,359  | 176.00    | 415,184.00                    |  |
|              | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 557    | 188.20    | 104,827.40                    |  |
|              | TELENOR ASA               | 1,721  | 130.95    | 225,364.95                    |  |
| ノルウェークローネ 小計 |                           | 15,597 |           | 2,841,698.83<br>(38,675,521)  |  |
| デンマーククローネ    | CHR HANSEN HOLDING A/S    | 274    | 526.20    | 144,178.80                    |  |
|              | NOVOZYMES A/S-B SHARES    | 501    | 418.10    | 209,468.10                    |  |
|              | ROCKWOOL A/S-B SHS        | 21     | 1,667.50  | 35,017.50                     |  |
|              | VESTAS WIND SYSTEMS A/S   | 2,559  | 164.50    | 420,955.50                    |  |
|              | AP MOLLER-MAERSK A/S-A    | 8      | 16,840.00 | 134,720.00                    |  |
|              | AP MOLLER-MAERSK A/S-B    | 13     | 17,105.00 | 222,365.00                    |  |
|              | DSV A/S                   | 517    | 1,027.00  | 530,959.00                    |  |
|              | PANDORA A/S               | 255    | 469.70    | 119,773.50                    |  |
|              | CARLSBERG AS-B            | 252    | 897.60    | 226,195.20                    |  |
|              | COLOPLAST-B               | 308    | 810.60    | 249,664.80                    |  |
|              | DEMANT A/S                | 235    | 288.80    | 67,868.00                     |  |
|              | GN STORE NORD A/S         | 312    | 244.20    | 76,190.40                     |  |
|              | GENMAB A/S                | 168    | 2,232.00  | 374,976.00                    |  |
|              | NOVO NORDISK A/S-B        | 4,317  | 786.30    | 3,394,457.10                  |  |
|              | DANSKE BANK A/S           | 1,679  | 107.45    | 180,408.55                    |  |
|              | TRYG A/S                  | 888    | 156.40    | 138,883.20                    |  |
|              | ORSTED A/S                | 479    | 734.60    | 351,873.40                    |  |
| デンマーククローネ 小計 |                           | 12,786 |           | 6,877,954.05<br>(131,300,142) |  |
| イスラエルシェケル    | ICL GROUP LTD             | 1,984  | 32.35     | 64,182.40                     |  |
|              | ELBIT SYSTEMS LTD         | 62     | 706.00    | 43,772.00                     |  |
|              | BANK HAPOLIM BM           | 3,065  | 29.10     | 89,191.50                     |  |
|              | BANK LEUMI LE-ISRAEL      | 3,682  | 31.35     | 115,430.70                    |  |
|              | ISRAEL DISCOUNT BANK-A    | 3,008  | 18.62     | 56,008.96                     |  |
|              | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD  | 381    | 113.50    | 43,243.50                     |  |
|              | AZRIELI GROUP LTD         | 97     | 257.10    | 24,938.70                     |  |
|              | NICE LTD                  | 172    | 706.70    | 121,552.40                    |  |
|              | TOWER SEMICONDUCTOR LTD   | 300    | 160.20    | 48,060.00                     |  |

|              |                             |        |        |                            |  |
|--------------|-----------------------------|--------|--------|----------------------------|--|
| イスラエルシェケル 小計 |                             | 12,751 |        | 606,380.16<br>(23,969,055) |  |
| ユーロ          | ENI SPA                     | 6,291  | 11.66  | 73,390.80                  |  |
|              | GALP ENERGIA SGPS SA        | 1,546  | 11.28  | 17,438.88                  |  |
|              | NESTE OYJ                   | 1,041  | 41.53  | 43,232.73                  |  |
|              | OMV AG                      | 363    | 44.62  | 16,197.06                  |  |
|              | REPSOL SA                   | 3,669  | 13.75  | 50,448.75                  |  |
|              | TENARIS SA                  | 1,104  | 12.45  | 13,744.80                  |  |
|              | TOTALENERGIES SE            | 6,345  | 49.55  | 314,426.47                 |  |
|              | AIR LIQUIDE SA              | 1,321  | 134.90 | 178,202.90                 |  |
|              | AKZO NOBEL N.V.             | 470    | 64.48  | 30,305.60                  |  |
|              | ARCELORMITTAL               | 1,606  | 22.50  | 36,135.00                  |  |
|              | ARKEMA                      | 174    | 89.62  | 15,593.88                  |  |
|              | BASF SE                     | 2,328  | 42.21  | 98,276.52                  |  |
|              | COVESTRO AG                 | 491    | 34.48  | 16,929.68                  |  |
|              | CRH PLC                     | 1,949  | 33.03  | 64,375.47                  |  |
|              | EVONIK INDUSTRIES AG        | 609    | 21.41  | 13,038.69                  |  |
|              | HEIDELBERGCEMENT AG         | 340    | 48.49  | 16,486.60                  |  |
|              | KONINKLIJKE DSM NV          | 445    | 137.75 | 61,298.75                  |  |
|              | OCI NV                      | 260    | 30.38  | 7,898.80                   |  |
|              | SMURFIT KAPPA GROUP PLC     | 631    | 32.90  | 20,759.90                  |  |
|              | SOLVAY SA                   | 180    | 79.76  | 14,356.80                  |  |
|              | STORA ENSO OYJ-R SHS        | 1,476  | 15.20  | 22,435.20                  |  |
|              | SYMRISE AG                  | 338    | 106.20 | 35,895.60                  |  |
|              | UMICORE                     | 493    | 32.54  | 16,042.22                  |  |
|              | UPM-KYMMENE OYJ             | 1,416  | 29.17  | 41,304.72                  |  |
|              | VOESTALPINE AG              | 334    | 21.10  | 7,047.40                   |  |
|              | ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 660    | 23.80  | 15,708.00                  |  |
|              | AIRBUS SE                   | 1,493  | 92.50  | 138,102.50                 |  |
|              | ALSTOM                      | 809    | 23.52  | 19,027.68                  |  |
|              | BOUYGUES SA                 | 637    | 30.84  | 19,645.08                  |  |
|              | BRENTAG SE                  | 401    | 60.80  | 24,380.80                  |  |
|              | CNH INDUSTRIAL NV           | 2,573  | 11.42  | 29,383.66                  |  |
|              | COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN   | 1,282  | 43.24  | 55,440.09                  |  |
|              | DAIMLER TRUCK HOLDING AG    | 1,262  | 25.73  | 32,471.26                  |  |
|              | DASSAULT AVIATION SA        | 54     | 147.00 | 7,938.00                   |  |
|              | EIFPAGE                     | 217    | 88.96  | 19,304.32                  |  |
|              | FERROVIAL SA                | 1,232  | 24.48  | 30,159.36                  |  |
|              | GEA GROUP AG                | 354    | 33.19  | 11,749.26                  |  |
|              | IMCD NV                     | 142    | 128.65 | 18,268.30                  |  |
|              | KINGSPAN GROUP PLC          | 381    | 59.18  | 22,547.58                  |  |
|              | KION GROUP AG               | 157    | 40.11  | 6,297.27                   |  |

|                              |       |          |            |
|------------------------------|-------|----------|------------|
| KNORR-BREMSE AG              | 163   | 57.22    | 9,326.86   |
| KONE OYJ-B                   | 824   | 42.77    | 35,242.48  |
| LEGRAND SA                   | 686   | 71.68    | 49,172.48  |
| MTU AERO ENGINES AG          | 133   | 173.60   | 23,088.80  |
| PRYSMIAN SPA                 | 643   | 27.31    | 17,560.33  |
| RATIONAL AG                  | 13    | 554.00   | 7,202.00   |
| RHEINMETALL AG               | 113   | 206.40   | 23,323.20  |
| SAFRAN SA                    | 867   | 95.00    | 82,365.00  |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE        | 1,370 | 116.74   | 159,933.80 |
| SIEMENS AG-REG               | 1,987 | 102.62   | 203,905.94 |
| SIEMENS ENERGY AG            | 1,027 | 15.70    | 16,123.90  |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE | 606   | 17.85    | 10,817.10  |
| THALES SA                    | 272   | 113.55   | 30,885.60  |
| VINCI SA                     | 1,365 | 87.75    | 119,778.75 |
| WARTSILA OYJ ABP             | 1,007 | 7.44     | 7,500.13   |
| BUREAU VERITAS SA            | 722   | 25.39    | 18,331.58  |
| RANDSTAD NV                  | 291   | 47.37    | 13,784.67  |
| TELEPERFORMANCE              | 150   | 294.20   | 44,130.00  |
| WOLTERS KLUWER               | 672   | 90.26    | 60,654.72  |
| ADP                          | 62    | 128.10   | 7,942.20   |
| AENA SME SA                  | 191   | 129.80   | 24,791.80  |
| ATLANTIA SPA                 | 1,420 | 22.20    | 31,524.00  |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       | 1,120 | 5.96     | 6,681.92   |
| DEUTSCHE POST AG-REG         | 2,513 | 35.90    | 90,229.26  |
| GETLINK SE                   | 1,026 | 17.50    | 17,955.00  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG  | 819   | 74.94    | 61,375.86  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 159   | 69.40    | 11,034.60  |
| CONTINENTAL AG               | 291   | 66.62    | 19,386.42  |
| FERRARI NV                   | 321   | 179.70   | 57,683.70  |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG       | 2,061 | 58.56    | 120,692.16 |
| MICHELIN (CGDE)              | 1,732 | 26.24    | 45,456.34  |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF   | 390   | 64.80    | 25,272.00  |
| RENAULT SA                   | 448   | 24.71    | 11,070.08  |
| STELLANTIS NV                | 5,670 | 12.42    | 70,466.76  |
| VALEO                        | 541   | 18.81    | 10,176.21  |
| VOLKSWAGEN AG                | 85    | 180.95   | 15,380.75  |
| VOLKSWAGEN AG-PREF           | 466   | 139.18   | 64,857.88  |
| ADIDAS AG                    | 445   | 170.36   | 75,810.20  |
| ESSILORLUXOTTICA             | 731   | 146.55   | 107,128.05 |
| HERMES INTERNATIONAL         | 81    | 1,067.50 | 86,467.50  |
| KERING                       | 190   | 502.50   | 95,475.00  |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 713   | 587.40   | 418,816.20 |

|                              |       |        |            |
|------------------------------|-------|--------|------------|
| MONCLER SPA                  | 486   | 39.70  | 19,294.20  |
| PUMA SE                      | 264   | 66.88  | 17,656.32  |
| SEB SA                       | 52    | 93.65  | 4,869.80   |
| ACCOR SA                     | 532   | 28.20  | 15,002.40  |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI | 425   | 101.95 | 43,328.75  |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM   | 200   | 33.90  | 6,780.00   |
| SODEXO SA                    | 226   | 66.88  | 15,114.88  |
| BOLLORE SE                   | 2,292 | 4.90   | 11,244.55  |
| PUBLICIS GROUPE              | 581   | 46.61  | 27,080.41  |
| SCOUT24 SE                   | 199   | 51.50  | 10,248.50  |
| UBISOFT ENTERTAINMENT        | 238   | 44.98  | 10,705.24  |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP NV     | 1,875 | 20.00  | 37,500.00  |
| VIVENDI SE                   | 2,075 | 10.06  | 20,884.87  |
| D'IETEREN GROUP              | 66    | 135.30 | 8,929.80   |
| DELIVERY HERO SE             | 438   | 39.59  | 17,340.42  |
| INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL   | 2,726 | 21.93  | 59,781.18  |
| JUST EAT TAKEAWAY            | 417   | 18.32  | 7,640.27   |
| PROSUS NV                    | 2,137 | 53.07  | 113,410.59 |
| ZALANDO SE                   | 571   | 25.14  | 14,354.94  |
| CARREFOUR SA                 | 1,574 | 17.07  | 26,876.05  |
| HELLOFRESH SE                | 407   | 30.70  | 12,494.90  |
| JERONIMO MARTINS             | 716   | 19.56  | 14,004.96  |
| KESKO OYJ-B SHS              | 701   | 21.47  | 15,050.47  |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 2,655 | 24.91  | 66,149.32  |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV   | 2,218 | 50.81  | 112,696.58 |
| DANONE                       | 1,661 | 52.59  | 87,351.99  |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV     | 1,223 | 10.02  | 12,260.57  |
| HEINEKEN HOLDING NV          | 283   | 70.60  | 19,979.80  |
| HEINEKEN NV                  | 662   | 89.04  | 58,944.48  |
| JDE PEET'S NV                | 306   | 25.90  | 7,925.40   |
| KERRY GROUP PLC-A            | 406   | 91.66  | 37,213.96  |
| PERNOD RICARD SA             | 533   | 179.90 | 95,886.70  |
| REMY COINTREAU               | 59    | 169.00 | 9,971.00   |
| BEIERSDORF AG                | 255   | 97.98  | 24,984.90  |
| HENKEL AG & CO KGAA          | 211   | 59.05  | 12,459.55  |
| HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF | 516   | 60.36  | 31,145.76  |
| L'OREAL                      | 617   | 336.85 | 207,836.45 |
| AMPLIFON SPA                 | 308   | 29.80  | 9,178.40   |
| BIOMERIEUX                   | 121   | 91.40  | 11,059.40  |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR   | 100   | 114.15 | 11,415.00  |
| DIASORIN SPA                 | 77    | 127.75 | 9,836.75   |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG &  | 528   | 47.09  | 24,863.52  |

|                              |        |        |            |
|------------------------------|--------|--------|------------|
| FRESENIUS SE & CO KGAA       | 1,025  | 28.10  | 28,802.50  |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       | 2,318  | 20.61  | 47,773.98  |
| SARTORIUS AG-VORZUG          | 62     | 328.20 | 20,348.40  |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG      | 724    | 46.83  | 33,904.92  |
| ARGENX SE                    | 118    | 336.30 | 39,683.40  |
| BAYER AG-REG                 | 2,489  | 57.79  | 143,839.31 |
| EUROFINS SCIENTIFIC          | 342    | 78.80  | 26,949.60  |
| GRIFOLS SA                   | 945    | 18.53  | 17,510.85  |
| IPSEN                        | 84     | 87.90  | 7,383.60   |
| MERCK KGAA                   | 328    | 164.80 | 54,054.40  |
| ORION OYJ-CLASS B            | 302    | 37.73  | 11,394.46  |
| QIAGEN N.V.                  | 593    | 43.50  | 25,795.50  |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA  | 259    | 41.86  | 10,841.74  |
| SANOFI                       | 2,877  | 100.56 | 289,311.12 |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH     | 73     | 305.30 | 22,286.90  |
| UCB SA                       | 343    | 80.94  | 27,762.42  |
| ABN AMRO BANK NV-CVA         | 944    | 11.37  | 10,738.00  |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 16,837 | 4.34   | 73,123.09  |
| BANCO SANTANDER SA           | 43,806 | 2.76   | 120,904.56 |
| BNP PARIBAS                  | 2,849  | 47.93  | 136,566.81 |
| CAIXABANK SA                 | 11,253 | 3.39   | 38,237.69  |
| COMMERZBANK AG               | 3,214  | 7.32   | 23,552.19  |
| CREDIT AGRICOLE SA           | 2,996  | 9.17   | 27,500.28  |
| ERSTE GROUP BANK AG          | 930    | 26.11  | 24,282.30  |
| FINECOBANK SPA               | 1,528  | 12.02  | 18,366.56  |
| ING GROEP NV                 | 9,906  | 9.77   | 96,870.77  |
| INTESA SANPAOLO              | 41,742 | 1.88   | 78,566.79  |
| KBC GROUP NV                 | 669    | 55.92  | 37,410.48  |
| MEDIOBANCA SPA               | 1,612  | 8.62   | 13,908.33  |
| SOCIETE GENERALE SA          | 2,057  | 22.80  | 46,899.60  |
| UNICREDIT SPA                | 5,353  | 9.82   | 52,587.87  |
| AMUNDI SA                    | 166    | 52.15  | 8,656.90   |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED  | 5,239  | 8.91   | 46,726.64  |
| DEUTSCHE BOERSE AG           | 484    | 157.30 | 76,133.20  |
| EURAZEO SE                   | 89     | 62.60  | 5,571.40   |
| EURONEXT NV                  | 211    | 77.60  | 16,373.60  |
| EXOR NV                      | 285    | 62.42  | 17,789.70  |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA  | 286    | 80.62  | 23,057.32  |
| SOFINA                       | 37     | 200.80 | 7,429.60   |
| WENDEL                       | 66     | 81.60  | 5,385.60   |
| AEGON NV                     | 4,260  | 4.25   | 18,113.52  |
| AGEAS                        | 404    | 41.88  | 16,919.52  |

|                              |        |          |            |
|------------------------------|--------|----------|------------|
| ALLIANZ SE-REG               | 1,036  | 181.20   | 187,723.20 |
| ASSICURAZIONI GENERALI       | 2,807  | 16.02    | 44,968.14  |
| AXA SA                       | 4,940  | 22.46    | 110,977.10 |
| HANNOVER RUECK SE            | 156    | 136.85   | 21,348.60  |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG   | 357    | 222.60   | 79,468.20  |
| NN GROUP NV                  | 721    | 42.70    | 30,786.70  |
| POSTE ITALIANE SPA           | 1,510  | 8.94     | 13,508.46  |
| SAMPO OYJ-A SHS              | 1,281  | 40.26    | 51,573.06  |
| AROUNDTOWN SA                | 2,392  | 3.61     | 8,635.12   |
| LEG IMMOBILIEN SE            | 186    | 84.66    | 15,746.76  |
| VONOVIA SE                   | 1,879  | 31.70    | 59,564.30  |
| ADYEN NV                     | 56     | 1,413.20 | 79,139.20  |
| AMADEUS IT GROUP SA          | 1,141  | 53.26    | 60,769.66  |
| BECHTLE AG                   | 184    | 39.19    | 7,210.96   |
| CAPGEMINI SE                 | 407    | 178.35   | 72,588.45  |
| DASSAULT SYSTEMES SE         | 1,688  | 36.63    | 61,839.88  |
| EDENRED                      | 654    | 45.01    | 29,436.54  |
| NEMETSCHEK SE                | 131    | 59.92    | 7,849.52   |
| NEXI SPA                     | 1,362  | 8.28     | 11,277.36  |
| SAP SE                       | 2,643  | 92.33    | 244,028.19 |
| WORLDLINE SA                 | 605    | 38.53    | 23,310.65  |
| NOKIA OYJ                    | 13,665 | 4.45     | 60,809.25  |
| CELLNEX TELECOM SA           | 1,440  | 38.95    | 56,088.00  |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG      | 8,243  | 18.88    | 155,627.84 |
| ELISA OYJ                    | 350    | 52.00    | 18,200.00  |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL | 742    | 9.97     | 7,400.70   |
| KONINKLIJKE KPN NV           | 8,408  | 3.37     | 28,360.18  |
| ORANGE                       | 5,015  | 11.10    | 55,696.59  |
| PROXIMUS                     | 539    | 14.04    | 7,567.56   |
| TELECOM ITALIA SPA           | 29,748 | 0.26     | 7,761.25   |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 3,933  | 2.75     | 10,815.75  |
| TELEFONICA SA                | 13,346 | 4.73     | 63,179.96  |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 265    | 27.98    | 7,414.70   |
| ACCIONA SA                   | 68     | 177.50   | 12,070.00  |
| E.ON SE                      | 5,716  | 8.60     | 49,169.03  |
| EDF                          | 1,575  | 7.72     | 12,168.45  |
| EDP RENOVAVEIS SA            | 748    | 22.85    | 17,091.80  |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA  | 7,157  | 4.49     | 32,142.08  |
| ELIA GROUP SA/NV             | 83     | 133.60   | 11,088.80  |
| ENAGAS SA                    | 745    | 20.71    | 15,428.95  |
| ENDESA SA                    | 751    | 18.94    | 14,227.69  |
| ENEL SPA                     | 20,504 | 5.51     | 113,038.55 |

|                              |           |        |                                    |  |
|------------------------------|-----------|--------|------------------------------------|--|
| ENGIE                        | 4,634     | 11.34  | 52,577.36                          |  |
| FORTUM OYJ                   | 1,124     | 15.95  | 17,933.42                          |  |
| IBERDROLA SA                 | 14,691    | 10.05  | 147,718.00                         |  |
| NATURGY ENERGY GROUP SA      | 286       | 26.85  | 7,679.10                           |  |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 1,162     | 18.41  | 21,392.42                          |  |
| RWE AG                       | 1,635     | 37.42  | 61,181.70                          |  |
| SNAM SPA                     | 5,207     | 4.96   | 25,826.72                          |  |
| TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA | 3,614     | 7.45   | 26,924.30                          |  |
| UNIPER SE                    | 259       | 17.80  | 4,610.20                           |  |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT         | 1,619     | 23.91  | 38,710.29                          |  |
| VERBUND AG                   | 172       | 94.55  | 16,262.60                          |  |
| ASM INTERNATIONAL NV         | 117       | 246.90 | 28,887.30                          |  |
| ASML HOLDING NV              | 1,034     | 484.85 | 501,334.90                         |  |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG     | 3,320     | 24.06  | 79,879.20                          |  |
| STMICROELECTRONICS NV        | 1,736     | 31.79  | 55,187.44                          |  |
| ユーロ 小計                       | 473,089   |        | 10,377,758.19<br>(1,473,952,995)   |  |
| 合 計                          | 2,805,702 |        | 15,919,866,995<br>(15,919,866,995) |  |

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

## (2)株式以外の有価証券

（単位：円）

| 通貨         | 種 類  | 銘 柄                          | 口数    | 評価額        | 備考 |
|------------|------|------------------------------|-------|------------|----|
| アメリカ<br>ドル | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 414   | 59,421.42  |    |
|            |      | AMERICAN HOMES 4 RENT- A     | 869   | 30,614.87  |    |
|            |      | AMERICAN TOWER CORP          | 1,177 | 307,962.05 |    |
|            |      | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 356   | 69,473.40  |    |
|            |      | BOSTON PROPERTIES INC        | 380   | 34,960.00  |    |
|            |      | CAMDEN PROPERTY TRUST        | 260   | 35,128.60  |    |
|            |      | CROWN CASTLE INTL CORP       | 1,093 | 191,264.07 |    |
|            |      | DIGITAL REALTY TRUST INC     | 719   | 99,797.20  |    |
|            |      | DUKE REALTY CORP             | 951   | 54,634.95  |    |
|            |      | EQUINIX INC                  | 228   | 157,130.76 |    |
|            |      | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 452   | 33,199.40  |    |
|            |      | EQUITY RESIDENTIAL           | 907   | 65,140.74  |    |
|            |      | ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 163   | 42,658.73  |    |
|            |      | EXTRA SPACE STORAGE INC      | 340   | 58,605.80  |    |
|            |      | HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 1,384 | 36,122.40  |    |
|            |      | HOST HOTELS & RESORTS INC    | 1,819 | 29,267.71  |    |

|             |      |                              |        |                               |  |
|-------------|------|------------------------------|--------|-------------------------------|--|
|             |      | INVITATION HOMES INC         | 1,526  | 54,188.26                     |  |
|             |      | IRON MOUNTAIN INC            | 736    | 36,402.56                     |  |
|             |      | KIMCO REALTY CORP            | 1,576  | 31,740.64                     |  |
|             |      | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 1,507  | 23,328.36                     |  |
|             |      | MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 295    | 50,896.35                     |  |
|             |      | PROLOGIS INC                 | 1,871  | 229,365.89                    |  |
|             |      | PUBLIC STORAGE               | 400    | 125,676.00                    |  |
|             |      | REALTY INCOME CORP           | 1,547  | 107,036.93                    |  |
|             |      | REGENCY CENTERS CORP         | 399    | 24,530.52                     |  |
|             |      | SBA COMMUNICATIONS CORP      | 275    | 90,125.75                     |  |
|             |      | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 833    | 82,983.46                     |  |
|             |      | SUN COMMUNITIES INC          | 297    | 48,351.60                     |  |
|             |      | UDR INC                      | 796    | 36,735.40                     |  |
|             |      | VENTAS INC                   | 1,007  | 51,588.61                     |  |
|             |      | VICI PROPERTIES INC          | 2,434  | 73,798.88                     |  |
|             |      | VORNADO REALTY TRUST         | 416    | 12,430.08                     |  |
|             |      | WELLTOWER INC                | 1,175  | 97,948.00                     |  |
|             |      | WEYERHAEUSER CO              | 1,898  | 65,158.34                     |  |
|             |      | WP CAREY INC                 | 487    | 41,774.86                     |  |
| アメリカドル合計    |      |                              | 30,987 | 2,589,442.59<br>(348,564,867) |  |
| カナダドル       | 投資証券 | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 200    | 8,992.00                      |  |
|             |      | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 200    | 4,078.00                      |  |
| カナダドル合計     |      |                              | 400    | 13,070.00<br>(1,362,155)      |  |
| オーストラリアドル   | 投資証券 | DEXUS/AU                     | 2,608  | 24,358.72                     |  |
|             |      | GOODMAN GROUP                | 4,289  | 80,118.52                     |  |
|             |      | GPT GROUP                    | 4,795  | 21,241.85                     |  |
|             |      | MIRVAC GROUP                 | 9,499  | 20,232.87                     |  |
|             |      | SCENTRE GROUP                | 13,419 | 35,962.92                     |  |
|             |      | STOCKLAND                    | 5,586  | 21,506.10                     |  |
|             |      | VICINITY CENTRES             | 11,078 | 20,605.08                     |  |
| オーストラリアドル合計 |      |                              | 51,274 | 224,026.06<br>(20,823,222)    |  |
| イギリスポンド     | 投資証券 | BRITISH LAND CO PLC          | 2,026  | 10,008.44                     |  |
|             |      | LAND SECURITIES GROUP PLC    | 1,851  | 13,256.86                     |  |
|             |      | SEGRO PLC                    | 3,035  | 31,169.45                     |  |
| イギリスポンド合計   |      |                              | 6,912  | 54,434.75<br>(8,988,810)      |  |
| 香港ドル        | 投資証券 | LINK REIT                    | 5,400  | 344,250.00                    |  |
| 香港ドル合計      |      |                              | 5,400  | 344,250.00<br>(5,903,887)     |  |
|             | 投資証券 | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 9,200  | 25,944.00                     |  |

|            |      |                              |        |                              |  |
|------------|------|------------------------------|--------|------------------------------|--|
| シンガポールドル   |      | CAPITALAND INTEGRATED COMMER | 13,499 | 29,562.81                    |  |
|            |      | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST   | 4,100  | 7,585.00                     |  |
|            |      | MAPLETREE LOGISTICS TRUST    | 8,800  | 14,960.00                    |  |
| シンガポールドル合計 |      |                              | 35,599 | 78,051.81<br>(7,581,172)     |  |
| ユーロ        | 投資証券 | COVIVIO                      | 129    | 7,346.55                     |  |
|            |      | GECINA SA                    | 99     | 9,251.55                     |  |
|            |      | KLEPIERRE                    | 451    | 9,340.21                     |  |
|            |      | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    | 304    | 15,814.08                    |  |
|            |      | WAREHOUSES DE PAUW SCA       | 408    | 12,778.56                    |  |
| ユーロ合計      |      |                              | 1,391  | 54,530.95<br>(7,745,030)     |  |
| 合計         |      |                              |        | 400,969,143<br>(400,969,143) |  |

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

| 種類         | 銘柄数       | 組入株式<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|------------|-----------|--------------|----------------|-------------------------|
| アメリカドル     | 株式 604銘柄  | 97.11%       | —              | 71.67%                  |
|            | 投資証券 35銘柄 | —            | 2.89%          | 2.14%                   |
| カナダドル      | 株式 86銘柄   | 99.78%       | —              | 3.74%                   |
|            | 投資証券 2銘柄  | —            | 0.22%          | 0.01%                   |
| オーストラリアドル  | 株式 52銘柄   | 94.34%       | —              | 2.13%                   |
|            | 投資証券 7銘柄  | —            | 5.66%          | 0.13%                   |
| イギリスポンド    | 株式 78銘柄   | 98.81%       | —              | 4.58%                   |
|            | 投資証券 3銘柄  | —            | 1.19%          | 0.06%                   |
| スイスフラン     | 株式 40銘柄   | 100.00%      | —              | 3.02%                   |
| 香港ドル       | 株式 30銘柄   | 95.90%       | —              | 0.85%                   |
|            | 投資証券 1銘柄  | —            | 4.10%          | 0.04%                   |
| シンガポールドル   | 株式 14銘柄   | 87.32%       | —              | 0.32%                   |
|            | 投資証券 4銘柄  | —            | 12.68%         | 0.05%                   |
| ニュージーランドドル | 株式 5銘柄    | 100.00%      | —              | 0.05%                   |
| スウェーデンクローネ | 株式 47銘柄   | 100.00%      | —              | 0.98%                   |
| ノルウェークローネ  | 株式 12銘柄   | 100.00%      | —              | 0.24%                   |
| デンマーククローネ  | 株式 17銘柄   | 100.00%      | —              | 0.80%                   |
| イスラエルシェケル  | 株式 9銘柄    | 100.00%      | —              | 0.15%                   |
| ユーロ        | 株式 223銘柄  | 99.48%       | —              | 9.03%                   |
|            | 投資証券 5銘柄  | —            | 0.52%          | 0.05%                   |

## 第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

## ２【ファンドの現況】

## 【ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン（ラップ向け）】

## 【純資産額計算書】

令和 4年 6月30日現在

（単位：円）

|                 |              |
|-----------------|--------------|
| 資産総額            | 290,598,589  |
| 負債総額            | 4,911        |
| 純資産総額（ - ）      | 290,593,678  |
| 発行済口数           | 330,158,556口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 0.8802       |
| （10,000口当たり）    | （8,802）      |

（参考）

## ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

令和 4年 6月30日現在

（単位：円）

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産総額            | 17,620,427,857 |
| 負債総額            | 1,064,545,652  |
| 純資産総額（ - ）      | 16,555,882,205 |
| 発行済口数           | 7,234,632,204口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 2.2884         |
| （10,000口当たり）    | （22,884）       |

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第１【委託会社等の概況】

##### １【委託会社等の概況】

< 更新後 >

##### （１）資本金の額等

2022年6月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近５年間に於ける資本金の額の増減はありません。

##### （２）委託会社の機構

###### ・会社の意思決定機構

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

###### ・投資運用の意思決定機構

###### 投資環境見通しの策定

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

###### 運用戦略の決定

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

###### 運用計画の決定

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

###### ポートフォリオの構築

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

###### 投資行動のモニタリング１

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

###### 投資行動のモニタリング２

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

###### ファンドに係る法人等の管理

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

###### 運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

### < 更新後 >

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

2022年 6月30日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

| 商品分類       | 本 数<br>( 本 ) | 純資産総額<br>( 百万円 ) |
|------------|--------------|------------------|
| 追加型株式投資信託  | 904          | 19,365,803       |
| 追加型公社債投資信託 | 16           | 1,403,852        |
| 単位型株式投資信託  | 93           | 425,414          |
| 単位型公社債投資信託 | 52           | 160,162          |
| 合 計        | 1,065        | 21,355,231       |

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

## 3【委託会社等の経理状況】

### < 更新後 >

#### ( 1 ) 財務諸表の作成方法について

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

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

#### ( 2 ) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第37期事業年度（自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### ( 1 ) 【貸借対照表】

(単位：千円)

第36期  
(令和3年3月31日現在)

第37期  
(令和4年3月31日現在)

## (資産の部)

## 流動資産

|         |   |            |   |            |
|---------|---|------------|---|------------|
| 現金及び預金  | 2 | 56,803,388 | 2 | 51,593,362 |
| 有価証券    |   | 2,001      |   | 293,326    |
| 前払費用    |   | 598,135    |   | 645,109    |
| 未収入金    |   | 31,359     |   | 61,092     |
| 未収委託者報酬 |   | 13,216,357 |   | 15,750,264 |
| 未収収益    | 2 | 662,230    | 2 | 783,790    |
| 金銭の信託   |   | 2,300,000  |   | 8,401,300  |
| その他     |   | 269,506    |   | 295,584    |
| 流動資産合計  |   | 73,882,978 |   | 77,823,830 |

## 固定資産

## 有形固定資産

|          |   |           |   |           |
|----------|---|-----------|---|-----------|
| 建物       | 1 | 548,902   | 1 | 391,042   |
| 器具備品     | 1 | 1,435,369 | 1 | 1,079,023 |
| 土地       |   | 628,433   |   | 628,433   |
| 有形固定資産合計 |   | 2,612,705 |   | 2,098,499 |

## 無形固定資産

|           |  |           |  |           |
|-----------|--|-----------|--|-----------|
| 電話加入権     |  | 15,822    |  | 15,822    |
| ソフトウェア    |  | 3,569,171 |  | 4,381,293 |
| ソフトウェア仮勘定 |  | 1,895,190 |  | 1,581,652 |
| 無形固定資産合計  |  | 5,480,184 |  | 5,978,768 |

## 投資その他の資産

|            |   |            |   |            |
|------------|---|------------|---|------------|
| 投資有価証券     |   | 18,616,670 |   | 16,803,642 |
| 関係会社株式     |   | 320,136    |   | 159,536    |
| 投資不動産      | 1 | 814,684    | 1 | 810,684    |
| 長期差入保証金    |   | 538,497    |   | 524,244    |
| 前払年金費用     |   | 258,835    |   | 189,708    |
| 繰延税金資産     |   | 916,962    |   | 982,406    |
| その他        |   | 45,230     |   | 45,230     |
| 貸倒引当金      |   | 23,600     |   | 23,600     |
| 投資その他の資産合計 |   | 21,487,417 |   | 19,491,852 |

## 固定資産合計

29,580,307 27,569,120

## 資産合計

103,463,286 105,392,950

(単位：千円)

第36期  
(令和3年3月31日現在)第37期  
(令和4年3月31日現在)

## (負債の部)

## 流動負債

|         |   |           |   |           |
|---------|---|-----------|---|-----------|
| 預り金     |   | 533,622   |   | 565,222   |
| 未払金     |   |           |   |           |
| 未払収益分配金 |   | 158,856   |   | 197,334   |
| 未払償還金   |   | 133,877   |   | 7,418     |
| 未払手数料   | 2 | 5,200,810 | 2 | 6,423,139 |
| その他未払金  | 2 | 4,412,521 | 2 | 4,565,457 |

|           |   |            |   |            |
|-----------|---|------------|---|------------|
| 未払費用      | 2 | 4,755,909  | 2 | 4,328,968  |
| 未払消費税等    |   | 752,617    |   | 1,112,923  |
| 未払法人税等    |   | 873,027    |   | 769,692    |
| 賞与引当金     |   | 933,381    |   | 942,287    |
| 役員賞与引当金   |   | 160,710    |   | 149,028    |
| その他       |   | 691,143    |   | 5,517      |
| 流動負債合計    |   | 18,606,476 |   | 19,066,990 |
| 固定負債      |   |            |   |            |
| 長期未払金     |   | 21,600     |   | 10,800     |
| 退職給付引当金   |   | 1,145,514  |   | 1,246,300  |
| 役員退職慰労引当金 |   | 117,938    |   | 117,938    |
| 時効後支払損引当金 |   | 245,426    |   | 250,214    |
| 固定負債合計    |   | 1,530,479  |   | 1,625,252  |
| 負債合計      |   | 20,136,956 |   | 20,692,243 |
| (純資産の部)   |   |            |   |            |
| 株主資本      |   |            |   |            |
| 資本金       |   | 2,000,131  |   | 2,000,131  |
| 資本剰余金     |   |            |   |            |
| 資本準備金     |   | 3,572,096  |   | 3,572,096  |
| その他資本剰余金  |   | 41,160,616 |   | 41,160,616 |
| 資本剰余金合計   |   | 44,732,712 |   | 44,732,712 |
| 利益剰余金     |   |            |   |            |
| 利益準備金     |   | 342,589    |   | 342,589    |
| その他利益剰余金  |   |            |   |            |
| 別途積立金     |   | 6,998,000  |   | 6,998,000  |
| 繰越利益剰余金   |   | 26,951,289 |   | 29,000,498 |
| 利益剰余金合計   |   | 34,291,879 |   | 36,341,088 |
| 株主資本合計    |   | 81,024,723 |   | 83,073,932 |

(単位：千円)

|              | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) | 第37期<br>(令和4年3月31日現在) |
|--------------|-----------------------|-----------------------|
| 評価・換算差額等     |                       |                       |
| その他有価証券評価差額金 | 2,301,606             | 1,626,775             |
| 評価・換算差額等合計   | 2,301,606             | 1,626,775             |
| 純資産合計        | 83,326,329            | 84,700,707            |
| 負債純資産合計      | 103,463,286           | 105,392,950           |

## ( 2 ) 【損益計算書】

(単位：千円)

|  | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) | 第37期<br>(自 令和3年4月1日<br>至 令和4年3月31日) |
|--|-------------------------------------|-------------------------------------|
|--|-------------------------------------|-------------------------------------|

|             |   |            |   |            |
|-------------|---|------------|---|------------|
| 営業収益        |   |            |   |            |
| 委託者報酬       |   | 67,963,712 |   | 79,977,953 |
| 投資顧問料       |   | 2,443,980  |   | 2,711,169  |
| その他営業収益     |   | 21,613     |   | 13,459     |
| 営業収益合計      |   | 70,429,306 |   | 82,702,582 |
| 営業費用        |   |            |   |            |
| 支払手数料       | 2 | 26,689,896 | 2 | 31,644,834 |
| 広告宣伝費       |   | 668,150    |   | 720,785    |
| 公告費         |   | 250        |   | 500        |
| 調査費         |   |            |   |            |
| 調査費         |   | 2,077,942  |   | 2,430,158  |
| 委託調査費       |   | 12,035,954 |   | 14,557,009 |
| 事務委託費       |   | 798,528    |   | 1,450,062  |
| 営業雑経費       |   |            |   |            |
| 通信費         |   | 296,490    |   | 138,868    |
| 印刷費         |   | 378,180    |   | 379,428    |
| 協会費         |   | 51,841     |   | 49,590     |
| 諸会費         |   | 16,613     |   | 17,729     |
| 事務機器関連費     |   | 1,977,769  |   | 2,172,978  |
| その他営業雑経費    |   | 8,391      |   | 649        |
| 営業費用合計      |   | 45,000,009 |   | 53,562,596 |
| 一般管理費       |   |            |   |            |
| 給料          |   |            |   |            |
| 役員報酬        |   | 352,879    |   | 414,260    |
| 給料・手当       |   | 6,461,546  |   | 6,496,233  |
| 賞与引当金繰入     |   | 933,381    |   | 942,287    |
| 役員賞与引当金繰入   |   | 160,710    |   | 149,028    |
| 福利厚生費       |   | 1,272,568  |   | 1,282,310  |
| 交際費         |   | 2,721      |   | 4,874      |
| 旅費交通費       |   | 22,768     |   | 21,698     |
| 租税公課        |   | 402,939    |   | 430,233    |
| 不動産賃借料      |   | 666,331    |   | 724,961    |
| 退職給付費用      |   | 481,135    |   | 494,615    |
| 役員退職慰労引当金繰入 |   | 11,763     |   | -          |
| 固定資産減価償却費   |   | 1,358,911  |   | 2,249,287  |
| 諸経費         |   | 413,538    |   | 379,054    |
| 一般管理費合計     |   | 12,541,193 |   | 13,588,846 |
| 営業利益        |   | 12,888,103 |   | 15,551,139 |

(単位：千円)

|             | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) | 第37期<br>(自 令和3年4月1日<br>至 令和4年3月31日) |
|-------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 営業外収益       |                                     |                                     |
| 受取配当金       | 170,807                             | 243,133                             |
| 受取利息        | 2 2,726                             | 2 7,408                             |
| 投資有価証券償還益   | 81,557                              | 1,089,101                           |
| 収益分配金等時効完成分 | 275,835                             | 137,485                             |
| 受取賃貸料       | 2 65,808                            | 2 65,808                            |

|              |             |             |
|--------------|-------------|-------------|
| その他          | 12,504      | 36,211      |
| 営業外収益合計      | 609,239     | 1,579,148   |
| 営業外費用        |             |             |
| 投資有価証券償還損    | 95,946      | 3,074       |
| 時効後支払損引当金繰入  | 16,395      | 16,548      |
| 事務過誤費        | -           | 76,076      |
| 賃貸関連費用       | 13,472      | 15,780      |
| その他          | 2,932       | 7,585       |
| 営業外費用合計      | 128,747     | 119,066     |
| 経常利益         | 13,368,595  | 17,011,221  |
| 特別利益         |             |             |
| 投資有価証券売却益    | 2,007,655   | 605,706     |
| 特別利益合計       | 2,007,655   | 605,706     |
| 特別損失         |             |             |
| 投資有価証券売却損    | 51,737      | 28,188      |
| 投資有価証券評価損    | 26,317      | 36,558      |
| 固定資産除却損      | 1 536       | 1 13,094    |
| 特別損失合計       | 78,591      | 77,840      |
| 税引前当期純利益     | 15,297,659  | 17,539,087  |
| 法人税、住民税及び事業税 | 2 4,755,427 | 2 5,366,608 |
| 法人税等調整額      | 19,122      | 22,446      |
| 法人税等合計       | 4,736,304   | 5,389,054   |
| 当期純利益        | 10,561,354  | 12,150,032  |

## （３）【株主資本等変動計算書】

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

（単位：千円）

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

|                     | 評価・換算差額等     |            | 純資産合計      |
|---------------------|--------------|------------|------------|
|                     | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 |            |
| 当期首残高               | 1,815        | 1,815      | 79,922,854 |
| 当期変動額               |              |            |            |
| 剰余金の配当              |              |            | 9,457,670  |
| 当期純利益               |              |            | 10,561,354 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | 2,299,791    | 2,299,791  | 2,299,791  |

|         |           |           |            |
|---------|-----------|-----------|------------|
| 当期変動額合計 | 2,299,791 | 2,299,791 | 3,403,475  |
| 当期末残高   | 2,301,606 | 2,301,606 | 83,326,329 |

## 第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日）

（単位：千円）

|                     | 株主資本      |           |              |             |           |           |             |            |             |
|---------------------|-----------|-----------|--------------|-------------|-----------|-----------|-------------|------------|-------------|
|                     | 資本金       | 資本剰余金     |              |             | 利益剰余金     |           |             | 株主資本合計     |             |
|                     |           | 資本<br>準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本<br>剰余金合計 | 利益<br>準備金 | その他利益剰余金  |             |            | 利益剰余金<br>合計 |
|                     |           |           |              |             |           | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>剰余金 |            |             |
| 当期首残高               | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616   | 44,732,712  | 342,589   | 6,998,000 | 26,951,289  | 34,291,879 | 81,024,723  |
| 会計方針の変更による累積の影響額    |           |           |              |             |           |           | 475,687     | 475,687    | 475,687     |
| 会計方針の変更を反映した当期首残高   | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616   | 44,732,712  | 342,589   | 6,998,000 | 27,426,976  | 34,767,566 | 81,500,410  |
| 当期変動額               |           |           |              |             |           |           |             |            |             |
| 剰余金の配当              |           |           |              |             |           |           | 10,576,511  | 10,576,511 | 10,576,511  |
| 当期純利益               |           |           |              |             |           |           | 12,150,032  | 12,150,032 | 12,150,032  |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) |           |           |              |             |           |           |             |            |             |
| 当期変動額合計             | —         | —         | —            | —           | —         | —         | 1,573,521   | 1,573,521  | 1,573,521   |
| 当期末残高               | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616   | 44,732,712  | 342,589   | 6,998,000 | 29,000,498  | 36,341,088 | 83,073,932  |

|                     | 評価・換算差額等     |            | 純資産合計      |
|---------------------|--------------|------------|------------|
|                     | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 |            |
| 当期首残高               | 2,301,606    | 2,301,606  | 83,326,329 |
| 会計方針の変更による累積的影響額    |              |            | 475,687    |
| 会計方針の変更を反映した当期首残高   | 2,301,606    | 2,301,606  | 83,802,017 |
| 当期変動額               |              |            |            |
| 剰余金の配当              |              |            | 10,576,511 |
| 当期純利益               |              |            | 12,150,032 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | 674,831      | 674,831    | 674,831    |
| 当期変動額合計             | 674,831      | 674,831    | 898,690    |
| 当期末残高               | 1,626,775    | 1,626,775  | 84,700,707 |

## [注記事項]

## （重要な会計方針）

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

## (2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

## 3. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産及び投資不動産

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

ております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

|       |        |
|-------|--------|
| 建物    | 5年～50年 |
| 器具備品  | 2年～20年 |
| 投資不動産 | 3年～47年 |

(2)無形固定資産

定額法を採用しております。

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

4.外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5.引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3)役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5)役員退職慰労引当金

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

(6)時効後支払損引当金

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

6.収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該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)委託者報酬

投資信託の信託約款に基づき信託財産の運用指図等を行っております。委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受領しております。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2)投資顧問料

顧客との投資一任及び投資助言契約に基づき運用及び助言を行っております。投資顧問料は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を主に年4回受領しております。当該報酬は契約期間にわたり収益として認識しております。

7.その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(1)連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

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

令和2年度税制改正において従来の連結納税制度が見直され、グループ通算制度に移行する税制改正法（「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号））が令和2年3月31日に公布されておりますが、繰延税金資産の額について、「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 令和2年3月31日）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 平成30年2月16日）第44項の定めを適用せず、改正前の税法の規定に基づいて算定しております。

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り扱いを定めた「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 令和3年8月12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 令和2年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）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いたしました。収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当事業年度の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当事業年度の期首の繰越利益剰余金に加減し、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。

この結果、収益認識会計基準等の適用を行う前と比べて、当事業年度の貸借対照表は、流動負債のその他は484,886千円減少、繰延税金資産は148,472千円減少、繰越利益剰余金は336,414千円増加しております。

当事業年度の損益計算書は、委託者報酬、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ200,739千円減少しております。

当事業年度の期首の純資産に累積的影響額が反映されたことにより、株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の期首残高は475,687千円増加しております。

1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

### （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 令和元年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 令和元年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いたしました。なお、時価算定会計基準等の適用による、財務諸表への影響はありません。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いたしました。

## （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 令和3年6月17日）

### （1）概要

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 企業会計基準適用指針第31号）の令和3年6月17日の改正は、令和元年7月4日の公表時において、「投資信託の時価の算定」に関する検討には、関係者との協議等に一定の期間が必要と考えられるため、また、「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」の時価の注記についても、一定の検討を要するため、「時価の算定に関する会計基準」公表後、概ね1年をかけて検討を行うこととされていたものが、改正され、公表されたものです。

### （2）適用予定日

令和5年3月期の期首より適用します。

### （3）当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」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ます。

## （貸借対照表関係）

### 1. 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

|      | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) | 第37期<br>(令和4年3月31日現在) |
|------|-----------------------|-----------------------|
| 建物   | 643,920千円             | 805,250千円             |
| 器具備品 | 1,545,179千円           | 2,054,366千円           |

投資不動産

151,833千円

157,995千円

## 2. 関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

|        | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) | 第37期<br>(令和4年3月31日現在) |
|--------|-----------------------|-----------------------|
| 預金     | 40,328,414千円          | 43,782,913千円          |
| 未収収益   | 14,138千円              | 13,741千円              |
| 未払手数料  | 772,495千円             | 836,105千円             |
| その他未払金 | 3,425,136千円           | 3,887,520千円           |
| 未払費用   | 349,222千円             | 337,847千円             |

## (損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

|      | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) | 第37期<br>(自 令和3年4月1日<br>至 令和4年3月31日) |
|------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 建物   | -                                   | 2,599千円                             |
| 器具備品 | 536千円                               | 10,495千円                            |
| 計    | 536千円                               | 13,094千円                            |

## 2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

|              | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) | 第37期<br>(自 令和3年4月1日<br>至 令和4年3月31日) |
|--------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 支払手数料        | 5,128,270千円                         | 5,153,589千円                         |
| 受取利息         | 143千円                               | 7,377千円                             |
| 受取賃貸料        | 65,808千円                            | 65,808千円                            |
| 法人税、住民税及び事業税 | 3,492,898千円                         | 4,062,765千円                         |

## (株主資本等変動計算書関係)

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|          |             |
|----------|-------------|
| 配当金の総額   | 9,457,670千円 |
| 1株当たり配当額 | 44,700円     |
| 基準日      | 令和2年3月31日   |
| 効力発生日    | 令和2年6月29日   |

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

令和3年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|          |              |
|----------|--------------|
| 配当金の総額   | 10,576,511千円 |
| 配当の原資    | 利益剰余金        |
| 1株当たり配当額 | 49,988円      |
| 基準日      | 令和3年3月31日    |

効力発生日

令和3年6月29日

第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

令和3年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|          |              |
|----------|--------------|
| 配当金の総額   | 10,576,511千円 |
| 1株当たり配当額 | 49,988円      |
| 基準日      | 令和3年3月31日    |
| 効力発生日    | 令和3年6月29日    |

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

令和4年6月28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。

|          |             |
|----------|-------------|
| 配当金の総額   | 6,075,125千円 |
| 配当の原資    | 利益剰余金       |
| 1株当たり配当額 | 28,713円     |
| 基準日      | 令和4年3月31日   |
| 効力発生日    | 令和4年6月29日   |

## (リース取引関係)

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

|     | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) | 第37期<br>(令和4年3月31日現在) |
|-----|-----------------------|-----------------------|
| 1年内 | 709,808千円             | 709,808千円             |
| 1年超 | 709,808千円             | 414,054千円             |
| 合計  | 1,419,616千円           | 1,123,863千円           |

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

第36期(令和3年3月31日現在)

|           | 貸借対照表<br>計上額（千円） | 時価（千円）    | 差額（千円） |
|-----------|------------------|-----------|--------|
| (1) 有価証券  | 2,001            | 2,001     | -      |
| (2) 金銭の信託 | 2,300,000        | 2,300,000 | -      |

|            |            |            |   |
|------------|------------|------------|---|
| (3) 投資有価証券 | 18,585,310 | 18,585,310 | - |
| 資産計        | 20,887,311 | 20,887,311 | - |

(注1) 「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため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2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（前事業年度の貸借対照表計上額31,360千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3) 投資有価証券」には含めておりません。

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

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。

(注4) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第36期(令和3年3月31日現在)

(単位：千円)

|                   | 1年以内       | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超   |
|-------------------|------------|-------------|--------------|--------|
| 現金及び預金            | 56,803,388 | -           | -            | -      |
| 金銭の信託             | 2,300,000  | -           | -            | -      |
| 未収委託者報酬           | 13,216,357 | -           | -            | -      |
| 有価証券及び投資有価証券      |            |             |              |        |
| その他有価証券のうち満期があるもの |            |             |              |        |
| 投資信託              | 2,001      | 8,412,286   | 3,123,026    | 11,398 |
| 合計                | 72,321,747 | 8,412,286   | 3,123,026    | 11,398 |

第37期(令和4年3月31日現在)

|            | 貸借対照表<br>計上額（千円） | 時価（千円）     | 差額（千円） |
|------------|------------------|------------|--------|
| (1) 有価証券   | 293,326          | 293,326    | -      |
| (2) 金銭の信託  | 8,401,300        | 8,401,300  | -      |
| (3) 投資有価証券 | 16,772,282       | 16,772,282 | -      |
| 資産計        | 25,466,909       | 25,466,909 | -      |

(注1) 「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため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2) 市場価格のない株式等

非上場株式（当事業年度の貸借対照表計上額31,360千円）は、市場価格がないため、「(3) 投資有価証券」には含めておりません。

また、関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額 関連会社株式159,536千円）は、市場価格がないため、記載しておりません。

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。

(注4) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第37期(令和4年3月31日現在)

(単位：千円)

|                   | 1年以内       | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超 |
|-------------------|------------|-------------|--------------|------|
| 現金及び預金            | 51,593,362 | -           | -            | -    |
| 金銭の信託             | 8,401,300  | -           | -            | -    |
| 未収委託者報酬           | 15,750,264 | -           | -            | -    |
| 有価証券及び投資有価証券      |            |             |              |      |
| その他有価証券のうち満期があるもの |            |             |              |      |
| 投資信託              | 293,326    | 6,911,464   | 3,695,585    | -    |
| 合計                | 76,038,253 | 6,911,464   | 3,695,585    | -    |

### 3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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又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順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

なお、財務諸表等規則附則（令和3年9月24日内閣府令第9号）に基づく経過措置を適用した投資信託（貸借対照表計上額 有価証券 293,326千円、投資有価証券16,772,282千円）は、次表には含めておりません。

#### 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

| 区分    | 時価（千円） |           |      |           |
|-------|--------|-----------|------|-----------|
|       | レベル1   | レベル2      | レベル3 | 合計        |
| 金銭の信託 | -      | 8,401,300 | -    | 8,401,300 |
| 資産計   | -      | 8,401,300 | -    | 8,401,300 |

（注）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

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しており、レベル2の時価に分類しております。

（有価証券関係）

#### 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

また、当事業年度の関連会社株式（貸借対照表計上額は関連会社株式159,536千円）は、市場価格がないため、記載していません。

#### 2. その他有価証券

第36期(令和3年3月31日現在)

|                      | 種類  | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額（千円）    |
|----------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの  | 株式  | -                | -            | -         |
|                      | 債券  | -                | -            | -         |
|                      | その他 | 14,810,957       | 11,362,471   | 3,448,485 |
|                      | 小計  | 14,810,957       | 11,362,471   | 3,448,485 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | 株式  | -                | -            | -         |
|                      | 債券  | -                | -            | -         |
|                      | その他 | 6,076,354        | 6,207,447    | 131,093   |
|                      | 小計  | 6,076,354        | 6,207,447    | 131,093   |
| 合計                   |     | 20,887,311       | 17,569,919   | 3,317,392 |

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

非上場株式（貸借対照表計上額は31,360千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、含めておりません。

第37期(令和4年3月31日現在)

|                      | 種類  | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額(千円)    |
|----------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの  | 株式  | -                | -            | -         |
|                      | 債券  | -                | -            | -         |
|                      | その他 | 19,193,250       | 16,560,340   | 2,632,910 |
|                      | 小計  | 19,193,250       | 16,560,340   | 2,632,910 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | 株式  | -                | -            | -         |
|                      | 債券  | -                | -            | -         |
|                      | その他 | 6,273,658        | 6,561,836    | 288,177   |
|                      | 小計  | 6,273,658        | 6,561,836    | 288,177   |
| 合計                   |     | 25,466,909       | 23,122,176   | 2,344,732 |

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」(貸借対照表計上額は8,401,300千円、取得原価は8,400,000千円)を含めております。

非上場株式(貸借対照表計上額は31,360千円)は、市場価格がないため、含めておりません。

### 3.売却したその他有価証券

第36期(自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)

| 種類  | 売却額(千円)   | 売却益の合計額(千円) | 売却損の合計額(千円) |
|-----|-----------|-------------|-------------|
| 株式  | -         | -           | -           |
| 債券  | -         | -           | -           |
| その他 | 5,747,529 | 2,007,655   | 51,737      |
| 合計  | 5,747,529 | 2,007,655   | 51,737      |

第37期(自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)

| 種類  | 売却額(千円)   | 売却益の合計額(千円) | 売却損の合計額(千円) |
|-----|-----------|-------------|-------------|
| 株式  | -         | -           | -           |
| 債券  | -         | -           | -           |
| その他 | 4,164,921 | 605,706     | 28,188      |
| 合計  | 4,164,921 | 605,706     | 28,188      |

### 4.減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について26,317千円(その他有価証券のその他26,317千円)減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について36,558千円(その他有価証券のその他36,558千円)減損処理を行っております。

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

(退職給付関係)

#### 1.採用している退職給付制度の概要

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

#### 2.確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

|                  | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) | 第37期<br>(自 令和3年4月1日<br>至 令和4年3月31日) |
|------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 退職給付債務の期首残高      | 3,718,736 千円                        | 3,729,235 千円                        |
| 勤務費用             | 203,106                             | 198,457                             |
| 利息費用             | 19,110                              | 21,549                              |
| 数理計算上の差異の<br>発生額 | 18,826                              | 46,069                              |

|             |           |           |
|-------------|-----------|-----------|
| 退職給付の支払額    | 192,890   | 179,650   |
| 過去勤務費用の発生額  | -         | -         |
| 退職給付債務の期末残高 | 3,729,235 | 3,723,521 |

## (2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

|              | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) | 第37期<br>(自 令和3年4月1日<br>至 令和4年3月31日) |
|--------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 年金資産の期首残高    | 2,460,824 千円                        | 2,649,846 千円                        |
| 期待運用収益       | 44,130                              | 47,588                              |
| 数理計算上の差異の発生額 | 304,281                             | 1,824                               |
| 事業主からの拠出額    | -                                   | -                                   |
| 退職給付の支払額     | 159,390                             | 115,331                             |
| 年金資産の期末残高    | 2,649,846                           | 2,583,927                           |

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

|                     | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) | 第37期<br>(令和4年3月31日現在) |
|---------------------|-----------------------|-----------------------|
| 積立型制度の退職給付債務        | 2,810,893 千円          | 2,675,015 千円          |
| 年金資産                | 2,649,846             | 2,583,927             |
|                     | 161,046               | 91,087                |
| 非積立型制度の退職給付債務       | 918,342               | 1,048,506             |
| 未積立退職給付債務           | 1,079,388             | 1,139,593             |
| 未認識数理計算上の差異         | 161,333               | 205,679               |
| 未認識過去勤務費用           | 354,043               | 288,681               |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 886,678               | 1,056,591             |
| 退職給付引当金             | 1,145,514             | 1,246,300             |
| 前払年金費用              | 258,835               | 189,708               |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 886,678               | 1,056,591             |

## (4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

|                 | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) | 第37期<br>(自 令和3年4月1日<br>至 令和4年3月31日) |
|-----------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 勤務費用            | 203,106 千円                          | 198,457 千円                          |
| 利息費用            | 19,110                              | 21,549                              |
| 期待運用収益          | 44,130                              | 47,588                              |
| 数理計算上の差異の費用処理額  | 41,361                              | 3,547                               |
| 過去勤務費用の費用処理額    | 65,361                              | 65,361                              |
| その他             | 44,446                              | 109,013                             |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 329,255                             | 343,245                             |

(注)「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額、再就職支援金及び退職金です。

(5)年金資産に関する事項  
年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

|     | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) | 第37期<br>(令和4年3月31日現在) |
|-----|-----------------------|-----------------------|
| 債券  | 62.7 %                | 62.0 %                |
| 株式  | 35.4                  | 36.3                  |
| その他 | 1.9                   | 1.7                   |
| 合計  | 100                   | 100                   |

#### 長期期待運用収益率の設定方法

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

#### (6)数理計算上の計算基礎に関する事項

##### 主要な数理計算上の計算基礎

|           | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) | 第37期<br>(令和4年3月31日現在) |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| 割引率       | 0.051～0.59%           | 0.078～0.72%           |
| 長期期待運用収益率 | 1.5～1.8%              | 1.5～1.8%              |

#### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度151,880千円、当事業年度151,370千円であります。

#### (税効果会計関係)

##### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

|               | 第36期<br>(令和3年3月31日現在) | 第37期<br>(令和4年3月31日現在) |
|---------------|-----------------------|-----------------------|
| 繰延税金資産        |                       |                       |
| 減損損失          | 418,394千円             | 410,082千円             |
| 投資有価証券評価損     | 188,859               | 65,490                |
| 未払事業税         | 180,263               | 165,702               |
| 賞与引当金         | 285,801               | 288,528               |
| 役員賞与引当金       | 25,472                | 25,799                |
| 役員退職慰労引当金     | 36,112                | 36,112                |
| 退職給付引当金       | 350,756               | 381,617               |
| 減価償却超過額       | 68,024                | 145,316               |
| 委託者報酬         | 209,938               | -                     |
| 長期差入保証金       | 48,639                | 52,869                |
| 時効後支払損引当金     | 75,149                | 76,615                |
| 連結納税適用による時価評価 | 38,873                | 35,311                |
| その他           | 87,023                | 76,257                |
| 繰延税金資産 小計     | 2,013,308             | 1,759,702             |
| 評価性引当額        | -                     | -                     |
| 繰延税金資産 合計     | 2,013,308             | 1,759,702             |
| 繰延税金負債        |                       |                       |
| 前払年金費用        | 79,225                | 58,088                |
| 連結納税適用による時価評価 | 1,203                 | 1,149                 |
| その他有価証券評価差額金  | 1,015,785             | 717,957               |
| その他           | 101                   | 101                   |
| 繰延税金負債 合計     | 1,096,346             | 777,296               |
| 繰延税金資産の純額     | 916,962               | 982,406               |

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

第36期（令和3年3月31日現在）及び第37期（令和4年3月31日現在）

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

## （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

収益及び契約から生じるキャッシュ・フローの性質、金額、時期及び不確実性に影響を及ぼす主要な要因に基づく区分に当該収益を分解した情報については、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

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）の6. 収益および費用の計上基準」に記載のとおりであります。

## 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]

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）及び第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## [関連情報]

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）及び第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## （1）営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

## （2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

## [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## （関連当事者情報）

## 1. 関連当事者との取引

## （1）財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係 | 取引の内容 | 取引金額<br>(注4) | 科目 | 期末残高<br>(注4) |
|----|--------|-----|-----|-------|------------------------|---------------|-------|--------------|----|--------------|
|----|--------|-----|-----|-------|------------------------|---------------|-------|--------------|----|--------------|

|     |                            |                 |                  |             |                     |                                                                         |                                                            |                                      |                   |                                    |
|-----|----------------------------|-----------------|------------------|-------------|---------------------|-------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|--------------------------------------|-------------------|------------------------------------|
| 親会社 | ㈱三菱UFJ<br>フィナンシャル・<br>グループ | 東京都<br>千代田<br>区 | 2,141,513<br>百万円 | 銀行持株<br>会社業 | 被所有<br>間接<br>100.0% | 連結納税                                                                    | 連結納税に<br>伴う支払<br>（注1）                                      | 3,492,898<br>千円                      | その他未払金            | 3,425,136<br>千円                    |
| 親会社 | 三菱UFJ<br>信託銀行㈱             | 東京都<br>千代田<br>区 | 324,279<br>百万円   | 信託業、<br>銀行業 | 被所有<br>直接<br>100.0% | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等<br><br>投資の助言<br><br>役員の兼任 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料の<br>支払<br>（注2）<br><br>投資助言料<br>（注3） | 5,128,270<br>千円<br><br>523,327<br>千円 | 未払手数料<br><br>未払費用 | 772,495<br>千円<br><br>290,120<br>千円 |

## 第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日）

| 種類  | 会社等の<br>名称                 | 所在地             | 資本金              | 事業の<br>内容   | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                                                           | 取引の内容                                                      | 取引金額<br>(注4)                         | 科目                | 期末残高<br>(注4)                       |
|-----|----------------------------|-----------------|------------------|-------------|----------------------------|-------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|--------------------------------------|-------------------|------------------------------------|
| 親会社 | ㈱三菱UFJ<br>フィナンシャル・<br>グループ | 東京都<br>千代田<br>区 | 2,141,513<br>百万円 | 銀行持株<br>会社業 | 被所有<br>間接<br>100.0%        | 連結納税                                                                    | 連結納税に<br>伴う支払<br>（注1）                                      | 4,062,765<br>千円                      | その他未払金            | 3,887,520<br>千円                    |
| 親会社 | 三菱UFJ<br>信託銀行㈱             | 東京都<br>千代田<br>区 | 324,279<br>百万円   | 信託業、<br>銀行業 | 被所有<br>直接<br>100.0%        | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等<br><br>投資の助言<br><br>役員の兼任 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料の<br>支払<br>（注2）<br><br>投資助言料<br>（注3） | 5,153,589<br>千円<br><br>499,388<br>千円 | 未払手数料<br><br>未払費用 | 836,105<br>千円<br><br>272,264<br>千円 |

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- （注）１．連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。
- ２．投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。
- ３．投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。
- ４．上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

## (2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

## 第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

| 種類          | 会社等の<br>名称   | 所在地             | 資本金              | 事業の<br>内容 | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                                 | 取引の内容                                 | 取引金額<br>(注2)    | 科目    | 期末残高<br>(注2)  |
|-------------|--------------|-----------------|------------------|-----------|----------------------------|-----------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|---------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | ㈱三菱UFJ<br>銀行 | 東京都<br>千代田<br>区 | 1,711,958<br>百万円 | 銀行業       | なし                         | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料<br>の支払<br>（注1） | 3,729,785<br>千円 | 未払手数料 | 764,501<br>千円 |

|             |                                |                 |               |     |    |                                               |                                       |                 |       |                 |
|-------------|--------------------------------|-----------------|---------------|-----|----|-----------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|-----------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ<br>モルガン・<br>スタンレー<br>証券㈱ | 東京都<br>千代田<br>区 | 40,500<br>百万円 | 証券業 | なし | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料<br>の支払<br>(注1) | 5,655,482<br>千円 | 未払手数料 | 1,193,245<br>千円 |
|-------------|--------------------------------|-----------------|---------------|-----|----|-----------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|-----------------|

## 第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日）

| 種類          | 会社等の<br>名称                     | 所在地             | 資本金              | 事業の<br>内容 | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                                 | 取引の内容                                 | 取引金額<br>(注2)    | 科目    | 期末残高<br>(注2)    |
|-------------|--------------------------------|-----------------|------------------|-----------|----------------------------|-----------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|-----------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | ㈱三菱UFJ<br>銀行                   | 東京都<br>千代田<br>区 | 1,711,958<br>百万円 | 銀行業       | なし                         | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料<br>の支払<br>(注1) | 4,097,951<br>千円 | 未払手数料 | 838,058<br>千円   |
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ<br>モルガン・<br>スタンレー<br>証券㈱ | 東京都<br>千代田<br>区 | 40,500<br>百万円    | 証券業       | なし                         | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料<br>の支払<br>(注1) | 7,025,984<br>千円 | 未払手数料 | 1,319,958<br>千円 |

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 1. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

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

## 2. 親会社に関する注記

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

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

## （1株当たり情報）

|              | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) | 第37期<br>(自 令和3年4月1日<br>至 令和4年3月31日) |
|--------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 1株当たり純資産額    | 393,827.09円                         | 400,322.84円                         |
| 1株当たり当期純利益金額 | 49,916.36円                          | 57,424.97円                          |

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

2. 「会計方針の変更」に記載のとおり、「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 令和2年3月31日）等を適用し、「収益認識に関する会計基準」第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当事業年度の1株当たり純資産額は2,248.25円増加し、1株当たり純利益金額は658.24円減少しております。

3. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

|                        | 第36期<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和3年3月31日) | 第37期<br>(自 令和3年4月1日<br>至 令和4年3月31日) |
|------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 当期純利益金額 (千円)           | 10,561,354                          | 12,150,032                          |
| 普通株主に帰属しない金額 (千円)      | -                                   | -                                   |
| 普通株式に係る当期純利益金額<br>(千円) | 10,561,354                          | 12,150,032                          |
| 普通株式の期中平均株式数 (株)       | 211,581                             | 211,581                             |

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<更新後>

(1) 受託会社

名称：三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円(2022年3月末現在)

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

| 名称             | 資本金の額<br>(2021年9月末現在) | 事業の内容               |
|----------------|-----------------------|---------------------|
| 三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社  | 324,279 百万円           | 銀行業務および信託業務を営んでいます。 |
| 農林中央金庫         | 4,040,198 百万円         | 金融業務を営んでいます。        |
| 東京都信用農業協同組合連合会 | 131,300 百万円           | 金融業務を営んでいます。        |
| 石川県信用農業協同組合連合会 | 33,047 百万円            | 金融業務を営んでいます。        |
| 福井県信用農業協同組合連合会 | 23,373 百万円            | 金融業務を営んでいます。        |
| 兵庫県信用農業協同組合連合会 | 253,300 百万円           | 金融業務を営んでいます。        |
| 徳島県信用農業協同組合連合会 | 32,500 百万円            | 金融業務を営んでいます。        |
| はが野農業協同組合      | 3,959 百万円             | 金融業務を営んでいます。        |
| 下野農業協同組合       | 2,019 百万円             | 金融業務を営んでいます。        |
| 那須南農業協同組合      | 1,168 百万円             | 金融業務を営んでいます。        |
| あさか野農業協同組合     | 864 百万円               | 金融業務を営んでいます。        |
| いるま野農業協同組合     | 5,718 百万円             | 金融業務を営んでいます。        |
| くまがや農業協同組合     | 2,702 百万円             | 金融業務を営んでいます。        |
| さいかつ農業協同組合     | 1,833 百万円             | 金融業務を営んでいます。        |
| 東京中央農業協同組合     | 1,152 百万円             | 金融業務を営んでいます。        |
| 横浜農業協同組合       | 11,872 百万円            | 金融業務を営んでいます。        |
| セレサ川崎農業協同組合    | 2,495 百万円             | 金融業務を営んでいます。        |
| よこすか葉山農業協同組合   | 1,378 百万円             | 金融業務を営んでいます。        |
| さがみ農業協同組合      | 5,090 百万円             | 金融業務を営んでいます。        |
| 湘南農業協同組合       | 3,239 百万円             | 金融業務を営んでいます。        |

|              |            |              |
|--------------|------------|--------------|
| 秦野市農業協同組合    | 1,669 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| かながわ西湘農業協同組合 | 2,411 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| 厚木市農業協同組合    | 2,457 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| 県央愛川農業協同組合   | 464 百万円    | 金融業務を営んでいます。 |
| 相模原市農業協同組合   | 849 百万円    | 金融業務を営んでいます。 |
| 神奈川つくい農業協同組合 | 778 百万円    | 金融業務を営んでいます。 |
| 信州うえだ農業協同組合  | 4,103 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| 信州諏訪農業協同組合   | 6,290 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| 上伊那農業協同組合    | 8,074 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| みなみ信州農業協同組合  | 4,407 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| 中野市農業協同組合    | 2,554 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| 金沢市農業協同組合    | 3,125 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| ぎふ農業協同組合     | 7,168 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| ハイナン農業協同組合   | 831 百万円    | 金融業務を営んでいます。 |
| あいち尾東農業協同組合  | 1,193 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| 愛知北農業協同組合    | 748 百万円    | 金融業務を営んでいます。 |
| あいち中央農業協同組合  | 3,579 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| 鈴鹿農業協同組合     | 1,555 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| 伊賀ふるさと農業協同組合 | 3,779 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| 越前たけふ農業協同組合  | 2,970 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| 兵庫六甲農業協同組合   | 5,720 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| あかし農業協同組合    | 420 百万円    | 金融業務を営んでいます。 |
| 兵庫南農業協同組合    | 3,741 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| みのり農業協同組合    | 4,304 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| 兵庫みらい農業協同組合  | 3,442 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| 加古川市南農業協同組合  | 513 百万円    | 金融業務を営んでいます。 |
| 兵庫西農業協同組合    | 12,594 百万円 | 金融業務を営んでいます。 |
| 相生市農業協同組合    | 102 百万円    | 金融業務を営んでいます。 |
| 丹波ひかみ農業協同組合  | 2,184 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| 丹波ささやま農業協同組合 | 2,096 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| 淡路日の出農業協同組合  | 1,852 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| 晴れの国岡山農業協同組合 | 25,738 百万円 | 金融業務を営んでいます。 |
| 徳島市農業協同組合    | 3,604 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| 長崎西彼農業協同組合   | 3,314 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |
| 長崎県央農業協同組合   | 5,739 百万円  | 金融業務を営んでいます。 |

は「出資金」を記載しております。

### 3【資本関係】

#### < 訂正前 >

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2021年10月末現在）

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

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

#### < 訂正後 >

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2022年6月末現在）

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

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

独立監査人の監査報告書

令和４年８月31日

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

取締役会 御 中

P w C あらた有限責任監査法人

東京事務所

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

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているヘッジ付先進国株式インデックス・オープン（ラップ向け）の令和４年１月27日から令和４年６月27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、ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン（ラップ向け）の令和４年６月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

---

（注）１． 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

２． XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

令和4年6月10日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ  
東京事務所

|                    |       |      |
|--------------------|-------|------|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 青木裕晃 |
|--------------------|-------|------|

|                    |       |      |
|--------------------|-------|------|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 伊藤鉄也 |
|--------------------|-------|------|

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱ＵＦＪ国際投信株式会社の令和3年4月1日から令和4年3月31日までの第37期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱ＵＦＪ国際投信株式会社の令和4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並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

---

（注）１． 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

２． XBRLデータは監査の対象には含まれていません。