【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年11月7日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田　賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長　民野　誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ＤＣ外国株式インデックスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

ＤＣ外国株式インデックスファンド

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

①追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

②三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

③当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（3）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（※）とします。

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

（5）【申込手数料】

ありません。

（6）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（7）【申込期間】

2022年11月 8日から2023年 5月 2日までとします。

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

（８）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

＜振替受益権について＞
当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。
当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。
＜受益権の取得申込みの方法＞
販売会社所定の方法でお申込みください。
取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。
＜申込みコース＞
当ファンドは「分配金再投資コース」（自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）専用ファンドです。
＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞
収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引所（金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第８項第３号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融

商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第８項第５号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむをえない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

＜受付不可日＞

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

当ファンドは、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

＜信託金限度額＞

上限　3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス	特殊型

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。
なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でもご覧いただけます。

◆一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

(1)単位型投信…当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
(2)追加型投信…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

［投資対象地域による区分］

(1)国内…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(2)海外…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(3)内外…目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［投資対象資産(収益の源泉)による区分］

(1)株式…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(2)債券…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(3)不動産投信(リート)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(4)その他資産…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
(5)資産複合…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［独立した区分］

(1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
(2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
(3)ETF…投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

［補足分類］

(1)インデックス型…目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
(2)特殊型…目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］

(1)株式
①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
②大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをい

う。

③中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

②公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

③社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

④その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

⑤格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

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

①資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

②資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

(1)グローバル…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

(2)日本…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)北米…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)欧州…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(5)アジア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の

資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(6)オセアニア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(7)中南米…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(8)アフリカ…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(9)中近東(中東)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(10)エマージング…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

［投資形態による属性区分］

(1)ファミリーファンド…目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。

(2)ファンド・オブ・ファンズ…「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

［為替ヘッジによる属性区分］

(1)為替ヘッジあり…目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

(2)為替ヘッジなし…目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

［インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分］

(1)日経225

(2)TOPIX

(3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

［特殊型］

(1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。

(2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。

(3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

(4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

＜ファンドの特色＞

日本を除く世界の主要国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）とは

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

マザーファンドの投資プロセス

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

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

分配方針

●年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。

●分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入及び売買益(評価益を含みます。)等の合計額とします。

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

●収益分配金は、自動的にファンドの受益権に再投資されます。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●株式への実質投資割合には、制限を設けません。

●外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

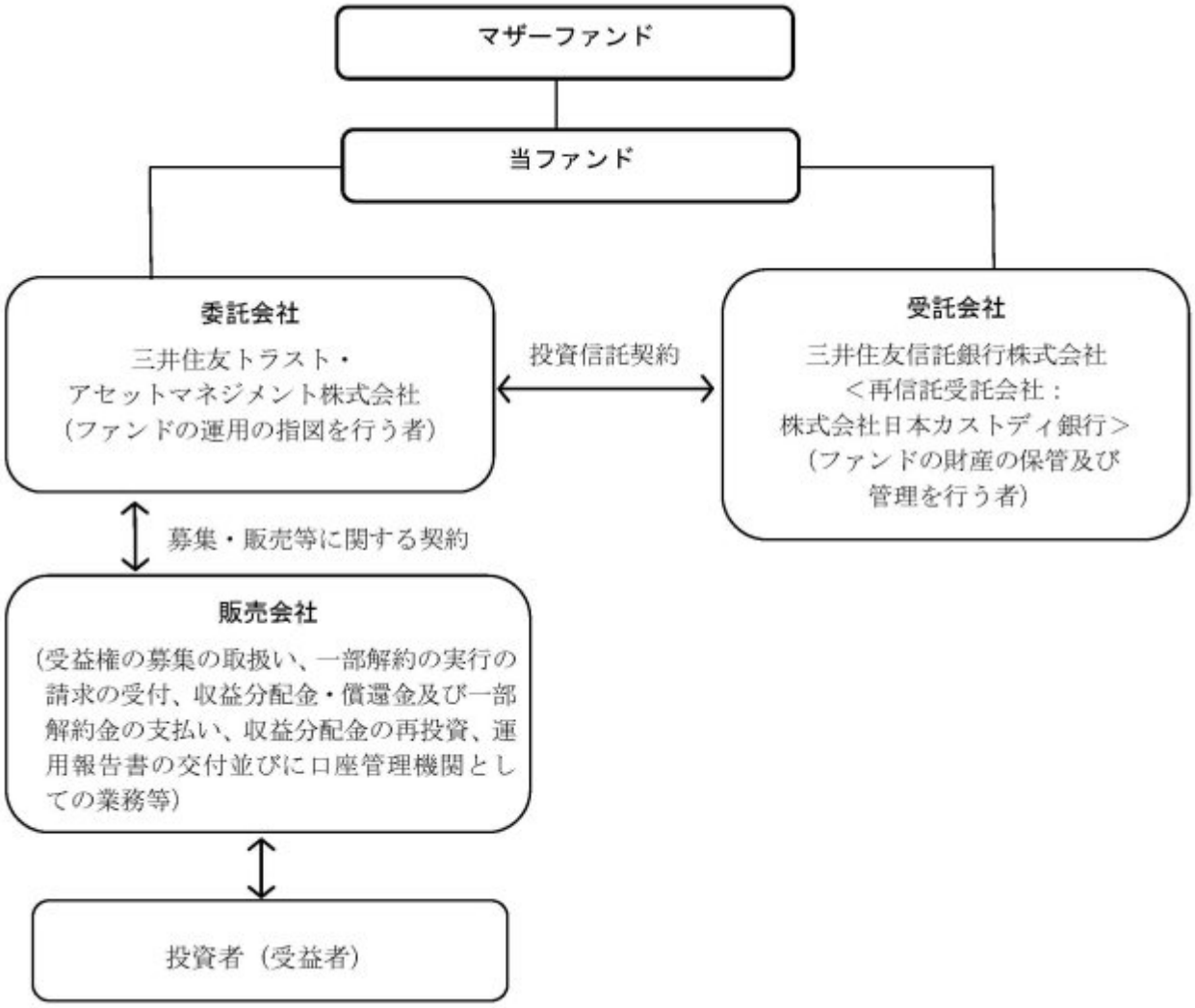
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（２）【ファンドの沿革】

2002年１月25日	**信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始**
2012年４月１日	**当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継** **当ファンドの名称を中央三井ＤＣ外国株式インデックスファンドからＤＣ外国株式インデックスファンドに変更** **当ファンドの主要投資対象である中央三井外国株式マザーファンドの名称を外国株式マザーファンドに変更**

（3）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2022年 8月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

株　主　名	住　　所	持株数	持株比率

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

① 運用方針

当ファンドは、日本を除く世界の主要国の株式等に投資する外国株式マザーファンド（以下「マザーファンド」という場合があります。）の受益証券を主要投資対象とし、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。なお、株式等に直接投資することもあります。

② 投資態度

A．株式への実質投資は、日本を除く世界の主要国の株式に分散投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

B．株式の実質投資割合は、原則として高位（90%以上）とします。

C．外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

D．運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

E．資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき等、並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

F．国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

G．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。

H．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

（2）【投資対象】

① 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

A．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）

１．有価証券

２．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条、第24条及び第25条に定めるものに限ります。）

３．金銭債権（上記１．、２．及び下記４．に掲げるものに該当するものを除きます。）

４．約束手形（上記１．に掲げるものに該当するものを除きます。）

Ｂ．次に掲げる特定資産以外の資産

１．為替手形

②　運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「外国株式マザーファンド」の受益証券及び次に掲げる有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．株券又は新株引受権証書
２．国債証券
３．地方債証券
４．特別の法律により法人の発行する債券
５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
６．資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
８．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証書
９．資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
10．コマーシャル・ペーパー
11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
12．外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記１．から11．までの証券又は証書の性質を有するもの
13．投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。）
14．投資証券又は外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）
15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
16．オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
17．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
18．外国法人が発行する譲渡性預金証書
19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20．抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます。）
21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22．外国の者に対する権利で上記21．の有価証券の性質を有するもの

なお、上記１．の証券又は証書並びに上記12．及び17．の証券又は証書のうち上記１．の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記２．から６．までの証券並びに上記12．及び17．の証券又は証書のうち上記２．から６．までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記13．の証券及び上記14．の証券を以下「投資信託証券」といいます。

③　運用指図できる金融商品

Ａ．委託会社は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

１．預金
２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３．コール・ローン
４．手形割引市場において売買される手形
５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
６．外国の者に対する権利で上記５．の権利の性質を有するもの

Ｂ．金融商品による運用の特例

上記②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記Ａ．に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(参考)マザーファンドの概要

「外国株式マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

２．運用方法

（１）投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

（２）投資態度

①　ＭＳＣＩコクサイ・インデックスに採用されている国の株式に投資を行い、同インデックス（配当込み、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
②　株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。
③　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。
④　運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
⑤　ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
⑥　国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。
⑦　信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことができます。
⑧　信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

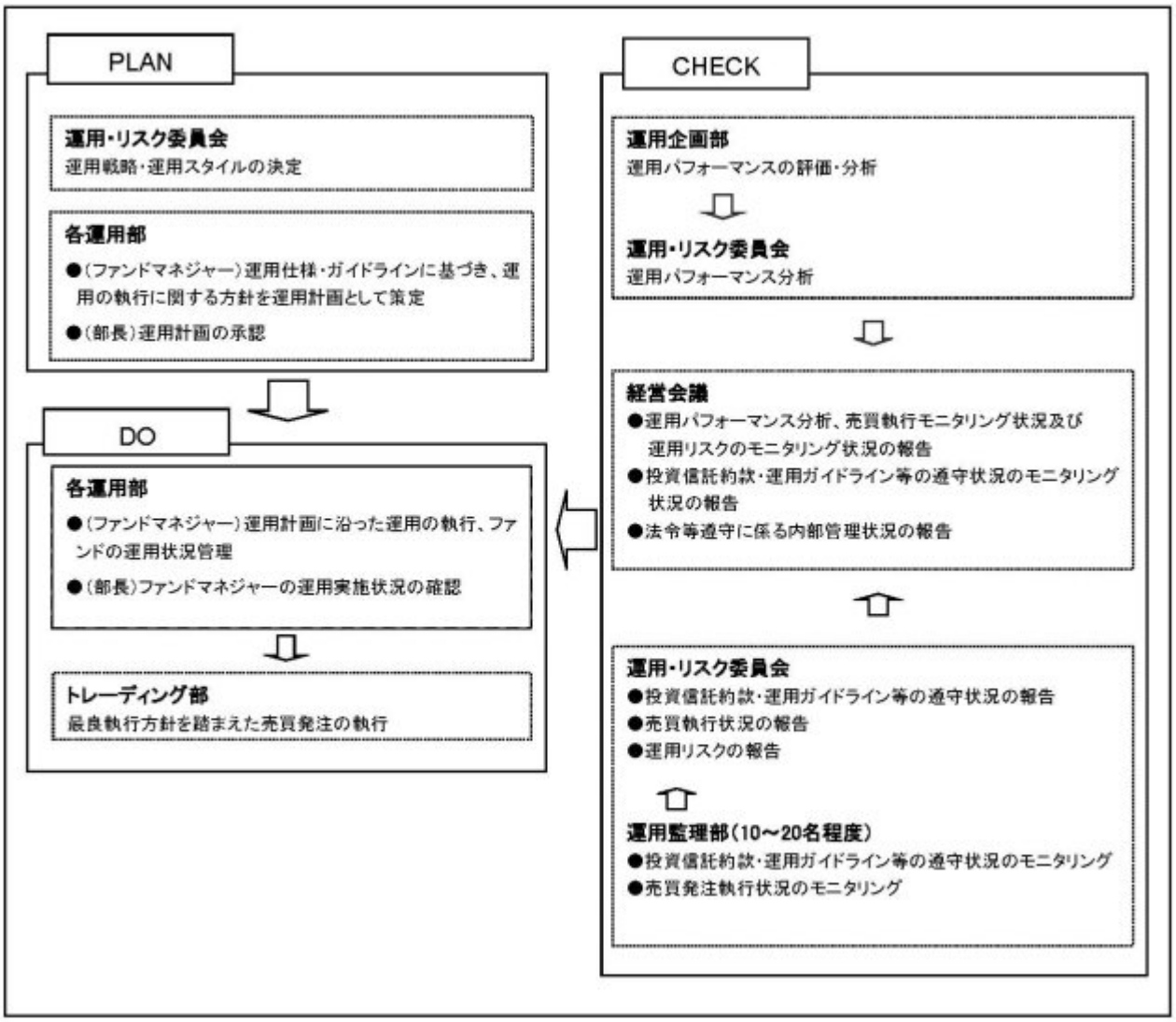
３．投資制限

①　外貨建資産への投資には、制限を設けません。
②　株式への投資割合には制限を設けません。
③　新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④　同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
⑤　同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑥　投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑦　同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑧　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
⑨　デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

（３）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

年１回の毎決算時（決算日は２月７日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

・分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入及び売買益（評価益を含みます。）等の合計額とします。
・分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合は分配を行わないことがあります。
・収益分配に充てず信託財産に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

Ａ．外貨建資産への投資割合

委託会社は、外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

Ｂ．株式への投資割合

委託会社は、株式への実質投資割合には、制限を設けません。

Ｃ．新株引受権証券等への投資割合

委託会社は、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

Ｄ．投資信託証券への投資割合

委託会社は、投資信託証券（マザーファンドを除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

Ｅ．同一銘柄の株式への投資割合

委託会社は、同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

Ｆ．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

委託会社は、同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。

Ｇ．同一銘柄の転換社債等への投資割合

委託会社は、同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号及び第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型

新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。

H．投資する株式等の範囲

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等（金融商品取引所（金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第８項第３号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第８項第５号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

ロ．上記イ．の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

Ⅰ．信用取引の指図範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

ロ．上記イ．の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

J．先物取引等の運用指図

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

ロ．委託会社は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことの指図をすることができます。

ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

K．スワップ取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

L．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

M．有価証券の貸付の指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次のａ．及びｂ．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

ａ．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

ｂ．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．ａ．及びｂ．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

ハ．委託会社は、有価証券の貸付にあたり、担保の受入れが必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

N．公社債の空売りの指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算において信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

O．公社債の借入れの指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

P．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

Q．外国為替予約取引の指図

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

ロ．上記イ．の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

R．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

S．再投資の指図

委託会社は、上記R．の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。

T．資金の借入れ

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券の売却代金、有価証券等の解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

ハ．収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

U．受託会社による資金の立替え

イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。

ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議により

そのつど別にこれを定めます。

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

Ⅵ．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

＜関連法令に基づく投資制限＞

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

●当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 株価変動リスク

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

② 為替変動リスク

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

③ 信用リスク

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

④ 流動性リスク

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

⑤ カントリーリスク

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

要因となる可能性があります。

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

① ファンドは、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。

② 同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

③ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

④ 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。

⑤ ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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

⑥ 確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

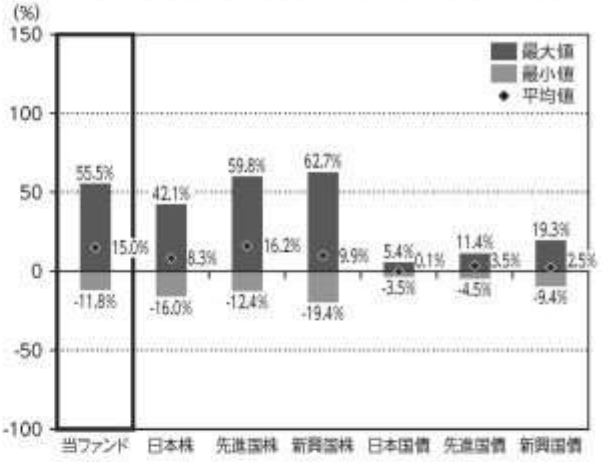
〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2017年9月～2022年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、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ます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数値の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる場合に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・ インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、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及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又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・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.2%の率を乗じて得た額を信託財産留保額（※）として当該基準価額から控除します。また、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率　0.88%（税抜　0.8%）（※）を乗じて得た額とします（信託報酬 ＝ 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	**年率　0.418%　（税抜　0.38%）**	**委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価**
販売会社	**年率　0.385%　（税抜　0.35%）**	**運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価**
受託会社	**年率　0.077%　（税抜　0.07%）**	**運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価**

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

②信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

（４）【その他の手数料等】

①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、先物取引・オプション取引に要する費用（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、投資信託財産から収受する信託報酬中より委託会社が支弁します。

⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料
先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料
組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。
確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。
受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。
※上記は、2022年 8月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。
※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

５【運用状況】

以下は、2022年8月31日現在の状況について記載してあります。

【ＤＣ外国株式インデックスファンド】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	22,798,846,844	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	11,512,981	0.05
合計(純資産総額)		22,810,359,825	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)

日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	4,925,327,150	4.3931	21,637,454,703	4.6289	22,798,846,844	99.95

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第11期計算期間末 (2013年 2月 7日)	5,770,254,311	5,770,254,311	11,619	11,619
第12期計算期間末 (2014年 2月 7日)	7,072,283,361	7,072,283,361	14,618	14,618
第13期計算期間末 (2015年 2月 9日)	9,861,558,912	9,861,558,912	18,730	18,730
第14期計算期間末 (2016年 2月 8日)	8,764,296,233	8,764,296,233	16,459	16,459
第15期計算期間末 (2017年 2月 7日)	10,004,402,144	10,004,402,144	18,888	18,888
第16期計算期間末 (2018年 2月 7日)	11,416,562,436	11,416,562,436	21,907	21,907
第17期計算期間末 (2019年 2月 7日)	11,687,587,129	11,687,587,129	21,880	21,880
第18期計算期間末 (2020年 2月 7日)	14,251,089,248	14,251,089,248	26,342	26,342
第19期計算期間末 (2021年 2月 8日)	16,154,363,242	16,154,363,242	29,303	29,303
第20期計算期間末 (2022年 2月 7日)	20,741,841,221	20,741,841,221	36,045	36,045
2021年 8月末日	19,690,868,052	—	35,191	—
9月末日	19,284,041,186	—	34,348	—
10月末日	20,697,772,160	—	36,839	—
11月末日	20,864,447,711	—	36,672	—
12月末日	21,863,536,910	—	38,141	—
2022年 1月末日	20,417,701,526	—	35,444	—
2月末日	20,388,233,086	—	35,185	—

3月末日	22,759,003,805	—	38,904	—
4月末日	21,923,500,089	—	37,218	—
5月末日	22,084,323,286	—	37,089	—
6月末日	21,733,856,466	—	36,194	—
7月末日	22,631,710,187	—	37,593	—
8月末日	22,810,359,825	—	37,823	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第11期計算期間	2012年 2月 8日～2013年 2月 7日	0
第12期計算期間	2013年 2月 8日～2014年 2月 7日	0
第13期計算期間	2014年 2月 8日～2015年 2月 9日	0
第14期計算期間	2015年 2月10日～2016年 2月 8日	0
第15期計算期間	2016年 2月 9日～2017年 2月 7日	0
第16期計算期間	2017年 2月 8日～2018年 2月 7日	0
第17期計算期間	2018年 2月 8日～2019年 2月 7日	0
第18期計算期間	2019年 2月 8日～2020年 2月 7日	0
第19期計算期間	2020年 2月 8日～2021年 2月 8日	0
第20期計算期間	2021年 2月 9日～2022年 2月 7日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第11期計算期間	2012年 2月 8日～2013年 2月 7日	38.3
第12期計算期間	2013年 2月 8日～2014年 2月 7日	25.8
第13期計算期間	2014年 2月 8日～2015年 2月 9日	28.1
第14期計算期間	2015年 2月10日～2016年 2月 8日	△12.1
第15期計算期間	2016年 2月 9日～2017年 2月 7日	14.8
第16期計算期間	2017年 2月 8日～2018年 2月 7日	16.0
第17期計算期間	2018年 2月 8日～2019年 2月 7日	△0.1
第18期計算期間	2019年 2月 8日～2020年 2月 7日	20.4
第19期計算期間	2020年 2月 8日～2021年 2月 8日	11.2
第20期計算期間	2021年 2月 9日～2022年 2月 7日	23.0
第21期中間計算期間	2022年 2月 8日～2022年 8月 7日	5.1

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第11期計算期間	2012年 2月 8日～2013年 2月 7日	1,461,084,790	695,793,671	4,966,263,372
第12期計算期間	2013年 2月 8日～2014年 2月 7日	1,362,532,445	1,490,619,759	4,838,176,058
第13期計算期間	2014年 2月 8日～2015年 2月 9日	1,442,657,315	1,015,677,832	5,265,155,541
第14期計算期間	2015年 2月10日～2016年 2月 8日	1,105,917,447	1,046,111,430	5,324,961,558
第15期計算期間	2016年 2月 9日～2017年 2月 7日	1,001,532,639	1,029,767,974	5,296,726,223
第16期計算期間	2017年 2月 8日～2018年 2月 7日	910,067,396	995,492,076	5,211,301,543
第17期計算期間	2018年 2月 8日～2019年 2月 7日	1,072,050,742	941,742,393	5,341,609,892
第18期計算期間	2019年 2月 8日～2020年 2月 7日	1,046,770,872	978,261,188	5,410,119,576
第19期計算期間	2020年 2月 8日～2021年 2月 8日	1,518,044,498	1,415,379,478	5,512,784,596
第20期計算期間	2021年 2月 9日～2022年 2月 7日	1,316,623,173	1,074,994,752	5,754,413,017
第21期中間計算期間	2022年 2月 8日～2022年 8月 7日	681,401,701	422,142,389	6,013,672,329

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

（参考）

外国株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	229,889,636,932	66.31
	イギリス	14,010,800,825	4.04
	カナダ	12,542,225,704	3.62
	スイス	10,677,943,075	3.08
	フランス	9,618,770,495	2.77
	オーストラリア	7,103,285,405	2.05
	ドイツ	6,915,454,570	1.99
	アイルランド	5,702,659,450	1.64
	オランダ	5,596,907,200	1.61
	スウェーデン	2,961,104,727	0.85
	デンマーク	2,547,125,114	0.73
	スペイン	2,261,332,173	0.65
	香港	2,075,963,688	0.60
	イタリア	1,501,868,241	0.43
	フィンランド	1,153,217,645	0.33
	シンガポール	1,084,335,022	0.31
	ジャージー	1,018,720,109	0.29

	ノルウェー	808,639,143	0.23
	イスラエル	775,124,443	0.22
	ベルギー	743,096,041	0.21
	ケイマン	695,706,590	0.20
	バミューダ	472,326,136	0.14
	キュラソー	373,633,319	0.11
	ルクセンブルク	242,982,608	0.07
	ニュージーランド	226,037,418	0.07
	ポルトガル	169,897,218	0.05
	オーストリア	156,240,703	0.05
	リベリア	61,457,526	0.02
	パナマ	57,967,612	0.02
	マン島	55,758,506	0.02
	小計	321,500,217,638	92.74
投資信託受益証券	オーストラリア	102,692,647	0.03
	香港	49,734,092	0.01
	アメリカ	17,938,999	0.01
	小計	170,365,738	0.05
投資証券	アメリカ	6,883,141,261	1.99
	オーストラリア	407,237,390	0.12
	イギリス	160,027,165	0.05
	シンガポール	149,539,399	0.04
	フランス	116,968,419	0.03
	香港	116,890,127	0.03
	カナダ	43,677,516	0.01
	ベルギー	30,699,520	0.01
	小計	7,908,180,797	2.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	17,105,288,360	4.93
合計(純資産総額)		346,684,052,533	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	12,465,349,668	3.60
	買建	カナダ	872,905,572	0.25
	買建	ドイツ	2,778,400,300	0.80
	買建	イギリス	333,324,180	0.10
	買建	オーストラリア	526,542,816	0.15

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	1,022,975,191	0.30
	売建	—	289,863,064	△0.08

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	809,683	23,854.63	19,314,691,712	22,029.69	17,837,068,160	5.15
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	353,374	42,323.99	14,956,200,134	36,455.53	12,882,436,847	3.72
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	454,960	21,729.82	9,886,201,228	17,845.83	8,119,143,321	2.34
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	130,857	42,265.53	5,530,741,193	38,497.55	5,037,674,031	1.45
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	298,600	19,784.29	5,907,590,817	15,102.35	4,509,562,367	1.30
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	282,060	19,777.12	5,578,336,197	15,236.82	4,297,698,380	1.24

アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	46,721	67,007.90	3,130,676,434	72,481.30	3,386,399,247	0.98
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	130,558	23,804.67	3,107,890,911	22,517.67	2,939,862,077	0.85
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	210,256	11,331.38	2,382,491,848	13,351.45	2,807,223,586	0.81
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	124,147	33,572.91	4,167,976,200	21,443.28	2,662,119,925	0.77
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	64,127	43,668.49	2,800,329,692	39,567.77	2,537,362,682	0.73
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	114,468	32,867.78	3,762,309,808	21,787.09	2,493,924,710	0.72
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	146,660	21,088.45	3,092,833,238	15,860.65	2,326,124,146	0.67
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	119,071	22,371.09	2,663,748,475	19,433.15	2,313,925,008	0.67
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	82,381	31,624.98	2,605,297,841	27,917.30	2,299,855,866	0.66
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	139,868	16,955.21	2,371,491,731	16,398.78	2,293,665,120	0.66
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	96,745	18,997.87	1,837,949,413	22,266.75	2,154,196,787	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	52,079	49,641.83	2,585,296,942	40,632.45	2,116,097,520	0.61
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	43,362	52,911.01	2,294,327,342	45,444.30	1,970,555,750	0.57
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	279,392	7,347.56	2,052,850,371	6,356.18	1,775,867,379	0.51
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	204,683	8,459.52	1,731,521,678	8,615.85	1,763,518,947	0.51
アメリカ	株式	LILLY (ELI) & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	40,232	33,727.05	1,356,906,871	42,564.95	1,712,473,278	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	360,929	6,682.78	2,412,012,067	4,725.89	1,705,713,170	0.49
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	87,899	19,532.24	1,716,864,828	18,791.29	1,651,736,171	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	68,768	23,879.46	1,642,143,037	23,981.60	1,649,166,923	0.48
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	22,048	71,895.70	1,585,156,520	72,661.52	1,602,041,374	0.46
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	34,930	49,124.59	1,715,922,276	45,055.36	1,573,783,725	0.45
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	125,650	10,920.46	1,372,155,807	12,044.17	1,513,350,513	0.44
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	19,450	82,338.63	1,601,486,354	76,841.22	1,494,561,781	0.43
イギリス	株式	SHELL PLC-NEW	エネルギー	379,061	3,306.44	1,253,343,281	3,785.31	1,434,863,772	0.41

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	エネルギー	5.28
		素材	3.96
		資本財	5.72
		商業・専門サービス	1.16
		運輸	1.91
		自動車・自動車部品	2.24
		耐久消費財・アパレル	1.53
		消費者サービス	1.69
		メディア・娯楽	5.32
		小売	4.79
		食品・生活必需品小売り	1.50
		食品・飲料・タバコ	4.14
		家庭用品・パーソナル用品	1.69
		ヘルスケア機器・サービス	4.58
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.20
		銀行	5.46
		各種金融	4.45
		保険	2.97
		不動産	0.38
		ソフトウェア・サービス	10.54
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.54
		電気通信サービス	1.43
		公益事業	3.16
		半導体・半導体製造装置	4.10
		小計	92.74
投資信託受益証券	—	—	0.05
投資証券	—	—	2.28
合計			95.07

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額(現地通貨)	帳簿価額(円)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	451	アメリカドル	86,191,194.5	11,948,685,293	89,918,125	12,465,349,668	3.60
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	35	カナダドル	8,222,161.5	870,973,568	8,240,400	872,905,572	0.25
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	72	スイスフラン	7,763,214	1,105,481,674	7,845,840	1,117,247,616	0.32
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	336	ユーロ	11,790,829.5	1,639,279,025	11,948,160	1,661,152,684	0.48
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	32	オーストラリアドル	5,314,599	505,630,949	5,534,400	526,542,816	0.15
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	28	イギリスポンド	2,012,385	325,603,893	2,060,100	333,324,180	0.10

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	5,833,100.00	786,918,438	807,680,191	0.23
	ユーロ	買建	1,200,000.00	165,678,000	166,800,000	0.05
	イギリスポンド	買建	300,000.00	48,885,510	48,495,000	0.01
	アメリカドル	売建	1,693,500.00	234,651,106	234,748,048	△0.07
	カナダドル	売建	138,500.00	14,755,111	14,670,016	△0.00
	イギリスポンド	売建	250,000.00	40,445,500	40,445,000	△0.01

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

≪参考情報≫

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2002年1月25日
作成基準日：2022年8月31日

基準価額・純資産の推移

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	37,823円
純資産総額	228.10億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年2月	0円
2019年2月	0円
2020年2月	0円
2021年2月	0円
2022年2月	0円
設定来分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

銘柄名	国／地域	種類	業種	実質投資比率
APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	5.1%
MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	3.7%
AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	2.3%
TESLA INC	アメリカ	株式	自動車・自動車部品	1.5%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	メディア・娯楽	1.3%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	メディア・娯楽	1.2%
UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア機器・サービス	1.0%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.8%
EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	0.8%
NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	0.8%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※2022年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

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

規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。
受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

＜申込コース＞
当ファンドは、「分配金再投資コース」（※）専用ファンドです。
※「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

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

＜申込単位＞
1円以上1円単位とします。

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

＜申込手数料＞
ありません。

＜申込代金の支払い＞
販売会社が定める期日までにお支払いください。

＜受付不可日＞
収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。
ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドン証券取引所の休業日

＜申込受付の中止等＞
収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむをえない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

＜その他＞
取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファン

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

＜一部解約手続＞

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

＜一部解約の受付＞

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

＜一部解約単位＞

1口以上1口単位とします。

＜解約価額＞

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（https://www.smtam.jp/）でご覧いただけます。

＜一部解約代金の支払い＞

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

益者に支払われます。
なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに拠ることとなります。

＜受付不可日＞
一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドン証券取引所の休業日

＜一部解約受付の中止等＞
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。
一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記＜解約価額＞の規定に準じて計算された価額とします。

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

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

＜問い合わせ先＞
上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口当たりに換算した価額で表示することがあります。

＜基準価額の算出頻度＞

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

A．親投資信託受益証券（外国株式マザーファンド）の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

B．外国上場株式、外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）の評価方法

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

外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2002年 1月25日設定）

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

（４）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年２月８日から翌年２月７日までとすることを原則とします。ただ

し、第１計算期間は2002年１月25日から2003年２月７日までとします。
なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

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

②委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

③委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

①委託会社は、ファンドの繰上償還について、あらかじめ、ファンドを繰上償還しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

②上記①の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

③上記②の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、ファンドの繰上償還を行いません。

④委託会社は、このファンドの繰上償還を行わないこととしたときは、ファンドの繰上償還を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑤ファンドの繰上償還において、上記②から④までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記②の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

＜投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き＞

(1)投資信託約款の変更

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

・受益者の利益のため必要と認めるとき
・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

①委託会社は、ファンドの重大な約款変更について、あらかじめ、変更をしようとする旨及びその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

②上記①の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

③上記②の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、当該約款変更を行いません。

④委託会社は、当該約款変更を行わないこととしたときは、約款変更を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き＞に従い、新受託会社を選任します。

②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

＜反対者の買取請求権＞

ファンドの償還又は重大な約款変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、販売会社を経由して受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

①信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

②上記①ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

③投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

①受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

②収益分配金は、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

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

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

④受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることにより換金する権利を有します。

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第20期計算期間(2021年2月9日から2022年2月7日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【ＤＣ外国株式インデックスファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第19期 （2021年 2月 8日現在）	第20期 （2022年 2月 7日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	88,013,650	124,352,811
親投資信託受益証券	16,146,328,758	20,731,525,024
未収入金	3,432,761	4,680,921
流動資産合計	16,237,775,169	20,860,558,756
資産合計	16,237,775,169	20,860,558,756
負債の部		
流動負債		
未払解約金	18,381,793	28,746,533
未払受託者報酬	5,690,138	7,872,458
未払委託者報酬	59,339,966	82,098,366
未払利息	30	178
流動負債合計	83,411,927	118,717,535
負債合計	83,411,927	118,717,535
純資産の部		
元本等		
元本	5,512,784,596	5,754,413,017
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	10,641,578,646	14,987,428,204
（分配準備積立金）	5,556,057,464	7,866,129,301
元本等合計	16,154,363,242	20,741,841,221
純資産合計	16,154,363,242	20,741,841,221
負債純資産合計	16,237,775,169	20,860,558,756

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期 自　2020年 2月 8日 至　2021年 2月 8日	第20期 自　2021年 2月 9日 至　2022年 2月 7日
営業収益		
受取利息	399	371
有価証券売買等損益	1,810,779,535	3,866,988,050
営業収益合計	1,810,779,934	3,866,988,421
営業費用		
支払利息	23,118	31,087
受託者報酬	10,463,930	14,652,711
委託者報酬	109,123,792	152,806,703
その他費用	96	-
営業費用合計	119,610,936	167,490,501
営業利益又は営業損失（△）	1,691,168,998	3,699,497,920
経常利益又は経常損失（△）	1,691,168,998	3,699,497,920
当期純利益又は当期純損失（△）	1,691,168,998	3,699,497,920
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（△）	△228,476,773	418,812,007
期首剰余金又は期首欠損金（△）	8,840,969,672	10,641,578,646
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,125,647,670	3,173,016,128
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,125,647,670	3,173,016,128
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,244,684,467	2,107,852,483
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,244,684,467	2,107,852,483
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	10,641,578,646	14,987,428,204

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年2月8日から翌年2月7日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第20期計算期間は2021年 2月 9日から2022年 2月 7日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第19期 (2021年 2月 8日現在)	第20期 (2022年 2月 7日現在)
１． 計算期間の末日における受益権の総数	5,512,784,596口	5,754,413,017口
２． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.9303円 (1万口当たり純資産額) (29,303円)	1口当たり純資産額 3.6045円 (1万口当たり純資産額) (36,045円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第19期
自 2020年 2月 8日
至 2021年 2月 8日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	219,091,368円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,700,554,403円
収益調整金額	C	8,275,937,914円
分配準備積立金額	D	3,636,411,693円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	13,831,995,378円
当ファンドの期末残存口数	F	5,512,784,596口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	25,090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

第20期
自 2021年 2月 9日
至 2022年 2月 7日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	275,552,144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	3,005,133,769円
収益調整金額	C	9,862,480,399円
分配準備積立金額	D	4,585,443,388円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	17,728,609,700円
当ファンドの期末残存口数	F	5,754,413,017口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	30,808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

	第20期 自 2021年 2月 9日 至 2022年 2月 7日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第20期 (2022年 2月 7日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	第19期 自 2020年 2月 8日 至 2021年 2月 8日	第20期 自 2021年 2月 9日 至 2022年 2月 7日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	5,410,119,576円	5,512,784,596円
期中追加設定元本額	1,518,044,498円	1,316,623,173円
期中一部解約元本額	1,415,379,478円	1,074,994,752円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第19期 (2021年 2月 8日現在)	第20期 (2022年 2月 7日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,901,125,023	3,726,007,572
合計	1,901,125,023	3,726,007,572

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	4,722,443,058	20,731,525,024	
合計		4,722,443,058	20,731,525,024	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。
なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	2022年 2月 7日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	7,100,102,402
コール・ローン	1,152,277,753
株式	301,134,233,782
投資信託受益証券	172,453,996
投資証券	6,880,359,563
派生商品評価勘定	59,111,284
未収入金	1
未収配当金	179,432,538
前払金	271,188,476
差入委託証拠金	2,981,179,473
流動資産合計	319,930,339,268
資産合計	319,930,339,268
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	325,102,593
未払解約金	44,312,678
未払利息	1,658
流動負債合計	369,416,929
負債合計	369,416,929
純資産の部	
元本等	
元本	72,792,232,380
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	246,768,689,959

	2022年 2月 7日現在
項目	金額（円）
元本等合計	319,560,922,339
純資産合計	319,560,922,339
負債純資産合計	319,930,339,268

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 2月 7日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。

	2022年 2月 7日現在
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 2月 7日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		72,792,232,380口
2． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額	4.3900円
	(1万口当たり純資産額)	(43,900円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2022年 2月 7日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2022年 2月 7日現在
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 2月 7日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 2月 7日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月 9日
期首元本額	78,359,437,234円
期中追加設定元本額	9,673,627,074円
期中一部解約元本額	15,240,831,928円
期末元本額	72,792,232,380円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,517,690,159円
ＤＣ外国株式インデックスファンド	4,722,443,058円
ＤＣ外国株式インデックスファンドＬ	25,119,377,880円
ＤＣバランスファンド３０	604,489,946円
ＤＣバランスファンド５０	1,237,612,068円
ＤＣバランスファンド７０	808,371,801円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	280,489,676円
外国株式インデックスｅ	4,690,240,176円
インデックスコレクション（外国株式）	14,122,202,361円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	3,260,355,561円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	943,528,562円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	927,015,464円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,505,853,591円
外国株式パッシブファンド私募Ａ（適格機関投資家専用）	1,473,996,234円
私募外国株式パッシブファンド２（適格機関投資家専用）	121,285,061円
外国株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	457,531,336円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	25,570,432円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	290,303,046円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	35,701,624円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	67,430,436円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	361,300,076円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	261,943,247円

区分	2022年 2月 7日現在
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	195,560,200円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	3,856,186,784円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	427,965,278円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	115,359,993円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	634,453,830円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	14,250,779円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	79,907,016円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	88,361,837円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	264,687,161円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	11,107,841円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	64,532,239円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	196,213,882円
私募外国株式インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	8,913,745円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 2月 7日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	32,402,010,843
投資信託受益証券	11,138,252
投資証券	1,106,832,619
合計	33,519,981,714

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 2月 7日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	11,754,474,908	－	11,483,286,432	△271,188,476
合計		11,754,474,908	－	11,483,286,432	△271,188,476

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2022年 2月 7日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,264,842,010	－	1,270,039,177	5,197,167
	アメリカドル	1,021,344,160	－	1,025,924,412	4,580,252
	ユーロ	196,367,790	－	197,324,635	956,845
	イギリスポンド	47,130,060	－	46,790,130	△339,930
合計		1,264,842,010	－	1,270,039,177	5,197,167

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	42,790	26.59	1,137,786.10	
	CHENIERE ENERGY INC	11,266	114.05	1,284,887.30	
	CHEVRON CORP	92,886	135.88	12,621,349.68	
	CONOCOPHILLIPS	65,567	91.87	6,023,640.29	
	COTERRA ENERGY INC	37,000	23.42	866,540.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	33,379	52.87	1,764,747.73	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	8,890	132.06	1,174,013.40	
	EOG RESOURCES INC	28,920	113.70	3,288,204.00	
	EXXON MOBIL	205,529	81.41	16,732,115.89	
	HALLIBURTON CO	41,018	31.94	1,310,114.92	
	HESS CORP	12,829	95.63	1,226,837.27	
	KINDER MORGAN INC	95,062	17.35	1,649,325.70	
	MARATHON PETROLEUM CORP	30,365	78.19	2,374,239.35	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	43,347	40.80	1,768,557.60	
	ONEOK INC	20,659	62.89	1,299,244.51	

PHILLIPS 66	20,389	88.84	1,811,358.76	
PIONEER NATURAL RESOURCES	11,583	227.85	2,639,186.55	
SCHLUMBERGER	69,679	38.51	2,683,338.29	
VALERO ENERGY CORP	19,008	86.70	1,647,993.60	
WILLIAMS COS	56,474	30.58	1,726,974.92	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	10,917	263.08	2,872,044.36	
ALBEMARLE CORP	5,885	216.02	1,271,277.70	
AMCOR PLC	72,748	11.56	840,966.88	
AVERY DENNISON CORP	4,144	189.31	784,500.64	
BALL CORP	15,147	93.68	1,418,970.96	
CELANESE CORP-SERIES A	5,419	156.51	848,127.69	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	75.06	779,047.74	
CORTEVA INC	34,769	50.25	1,747,142.25	
CROWN HOLDINGS INC	6,218	113.01	702,696.18	
DOW INC	36,681	60.60	2,222,868.60	
DUPONT DE NEMOURS INC	25,064	76.06	1,906,367.84	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,266	119.22	747,032.52	
ECOLAB INC	12,620	187.48	2,365,997.60	
FMC CORP	5,984	110.23	659,616.32	
FREEPORT-MCMORAN INC	72,123	38.42	2,770,965.66	
INT'L PAPER CO	17,345	46.79	811,572.55	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,577	127.10	1,471,436.70	
LINDE PLC	25,072	297.98	7,470,954.56	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,432	100.22	1,245,935.04	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,894	372.05	1,076,712.70	
MOSAIC CO/THE	16,566	43.83	726,087.78	
NEWMONT CORPORATION	37,562	60.93	2,288,652.66	
NUCOR CORP	14,049	111.26	1,563,091.74	
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,374	146.67	641,534.58	
PPG INDUSTRIES INC	11,026	152.99	1,686,867.74	
RPM INTERNATIONAL INC	5,987	86.44	517,516.28	
SEALED AIR CORP	7,368	64.36	474,204.48	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	12,375	281.73	3,486,408.75	
STEEL DYNAMICS INC	9,667	58.94	569,772.98	
VULCAN MATERIALS CO	6,162	184.04	1,134,054.48	
WESTROCK CO	12,132	45.37	550,428.84	
3 M COMPANY	28,021	160.73	4,503,815.33	
ALLEGION PLC	4,638	119.25	553,081.50	
AMETEK INC	10,723	134.49	1,442,136.27	
BOEING CO	26,832	206.45	5,539,466.40	
CARRIER GLOBAL CORP	41,014	45.84	1,880,081.76	
CATERPILLAR	26,471	198.41	5,252,111.11	

CUMMINS INC	6,913	228.60	1,580,311.80	
DEERE&CO	14,394	369.49	5,318,439.06	
DOVER CORP	6,691	163.15	1,091,636.65	
EATON CORP	19,500	151.00	2,944,500.00	
EMERSON ELECTRIC CO	29,379	95.38	2,802,169.02	
FASTENAL CO	26,712	54.99	1,468,892.88	
FORTIVE CORP	16,407	64.39	1,056,446.73	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,412	89.41	573,296.92	
GENERAC HOLDINGS INC	2,918	279.93	816,835.74	
GENERAL DYNAMICS CORP	11,401	212.29	2,420,318.29	
GENERAL ELECTRIC CO	53,042	99.01	5,251,688.42	
GRAINGER (WW) INC	2,116	487.68	1,031,930.88	
HEICO CORP	2,252	135.96	306,181.92	
HEICO CORP-CLASS A	3,318	113.47	376,493.46	
HONEYWELL INTL INC	33,430	191.50	6,401,845.00	
HOWMET AEROSPACE INC	18,227	32.18	586,544.86	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	182.61	363,941.73	
IDEX CORP	3,505	197.48	692,167.40	
ILLINOIS TOOL WORKS	15,483	228.92	3,544,368.36	
INGERSOLL-RAND INC	20,847	54.62	1,138,663.14	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,600	60.15	577,440.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	33,831	67.47	2,282,577.57	
KORNIT DIGITAL LTD	2,600	99.10	257,660.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	9,818	213.24	2,093,590.32	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,584	266.98	422,896.32	
LOCKHEED MARTIN CORP	12,232	389.33	4,762,284.56	
MASCO CORP	12,110	61.46	744,280.60	
NORDSON CORP	2,536	230.69	585,029.84	
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,408	369.75	2,739,108.00	
OTIS WORLDWIDE CORP	19,169	82.44	1,580,292.36	
OWENS CORNING	4,965	88.23	438,061.95	
PACCAR INC	16,159	94.53	1,527,510.27	
PARKER HANNIFIN CORP	6,017	302.97	1,822,970.49	
PENTAIR PLC	7,637	59.81	456,768.97	
PLUG POWER INC	23,605	21.43	505,855.15	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	73,112	93.01	6,800,147.12	
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,418	280.68	1,520,724.24	
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,201	447.95	2,329,787.95	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,602	55.29	420,314.58	
SMITH (A.O.) CORP	6,846	73.58	503,728.68	
SNAP-ON INC	2,372	213.70	506,896.40	
STANLEY BLACK&DECKER	8,223	166.47	1,368,882.81	

SUNRUN INC	7,884	25.11	197,967.24	
TEXTRON	10,911	67.24	733,655.64	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	11,217	158.74	1,780,586.58	
TRANSDIGM GROUP INC	2,661	619.63	1,648,835.43	
UNITED RENTALS INC	3,357	312.29	1,048,357.53	
WABTEC CORP	8,356	87.94	734,826.64	
XYLEM INC	8,363	90.51	756,935.13	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	6,342	76.65	486,114.30	
CINTAS CORP	4,399	381.81	1,679,582.19	
CLARIVATE PLC	15,370	14.80	227,476.00	
COPART INC	9,881	128.12	1,265,953.72	
COSTAR GROUP INC	18,390	68.55	1,260,634.50	
EQUIFAX INC	5,655	234.07	1,323,665.85	
IHS MARKIT LTD	18,807	116.76	2,195,905.32	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,004	127.67	766,530.68	
LEIDOS HOLDINGS	6,238	89.07	555,618.66	
REPUBLIC SERVICES INC	10,373	126.46	1,311,769.58	
ROBERT HALF INTL INC	5,212	118.36	616,892.32	
ROLLINS INC	10,710	30.45	326,119.50	
TRANSUNION	8,818	100.26	884,092.68	
VERISK ANALYTICS INC	7,189	197.75	1,421,624.75	
WASTE CONNECTIONS INC	12,201	123.02	1,500,967.02	
WASTE MANAGEMENT INC	20,741	145.03	3,008,067.23	
AMERCO	564	595.68	335,963.52	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,274	88.73	556,692.02	
CSX CORP	107,460	34.30	3,685,878.00	
DELTA AIR LINES INC	7,841	39.85	312,463.85	
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,850	109.74	861,459.00	
FEDEX CORP	12,306	244.11	3,004,017.66	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,907	189.60	740,767.20	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,000	55.79	390,530.00	
LYFT INC-A	11,829	37.68	445,716.72	
NORFOLK SOUTHERN CORP	11,893	270.42	3,216,105.06	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,619	309.58	1,429,950.02	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,754	43.66	294,879.64	
UBER TECHNOLOGIES INC	59,921	37.05	2,220,073.05	
UNION PACIFIC CORP	31,614	242.39	7,662,917.46	
UNITED PARCEL SERVICE B	34,869	224.79	7,838,202.51	
APTIV PLC	13,457	132.20	1,779,015.40	
BORGWARNER INC	11,533	43.31	499,494.23	
FORD MOTOR COMPANY	192,833	17.96	3,463,280.68	
GENERAL MOTORS CO	63,834	51.29	3,274,045.86	

LEAR CORP	2,989	167.63	501,046.07	
LUCID GROUP INC	20,820	27.55	573,591.00	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	8,920	60.87	542,960.40	
TESLA INC	40,697	923.32	37,576,354.04	
DR HORTON INC	16,141	84.02	1,356,166.82	
GARMIN LTD	7,784	124.76	971,131.84	
HASBRO INC	6,002	93.92	563,707.84	
LENNAR CORP-CL A	12,818	90.30	1,157,465.40	
LULULEMON ATHLETICA INC	5,782	336.37	1,944,891.34	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,830	150.08	424,726.40	
NEWELL BRANDS INC	17,598	21.33	375,365.34	
NIKE B	62,119	145.39	9,031,481.41	
NVR INC	164	5,275.03	865,104.92	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	12,862	24.60	316,405.20	
PULTE GROUP INC	12,386	48.74	603,693.64	
VF CORP	16,318	63.12	1,029,992.16	
WHIRLPOOL CORP	3,060	202.00	618,120.00	
AIRBNB INC-CLASS A	11,744	155.56	1,826,896.64	
ARAMARK	11,643	35.76	416,353.68	
BOOKING HOLDINGS INC	1,990	2,442.93	4,861,430.70	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	9,663	78.83	761,734.29	
CARNIVAL CORPORATION	42,799	19.96	854,268.04	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,390	1,483.44	2,061,981.60	
DARDEN RESTAURANTS INC	6,041	137.86	832,812.26	
DOMINO'S PIZZA INC	1,797	438.07	787,211.79	
DRAFTKINGS INC - CL A	16,662	21.89	364,731.18	
EXPEDIA GROUP INC	7,394	185.31	1,370,182.14	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	12,946	145.50	1,883,643.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	15,969	44.20	705,829.80	
MARRIOTT INTL A	13,789	162.74	2,244,021.86	
MCDONALD'S CORP	35,880	260.06	9,330,952.80	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	10,511	10.37	108,999.07	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	18,299	44.54	815,037.46	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,621	75.58	802,735.18	
STARBUCKS CORP	56,825	95.00	5,398,375.00	
VAIL RESORTS INC	1,853	275.33	510,186.49	
WYNN RESORTS LTD	5,210	85.50	445,455.00	
YUM BRANDS INC	14,073	125.27	1,762,924.71	
ACTIVISION BLIZZARD INC	38,655	79.25	3,063,408.75	
ALPHABET INC-CL A	14,563	2,865.86	41,735,519.18	
ALPHABET INC-CL C	13,900	2,860.32	39,758,448.00	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	24,885	15.35	381,984.75	

CABLE ONE INC	247	1,567.41	387,150.27	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	6,332	608.92	3,855,681.44	
COMCAST CORP-CL A	219,639	49.33	10,834,791.87	
DISCOVERY INC - A	7,886	28.90	227,905.40	
DISCOVERY INC-C	14,119	28.62	404,085.78	
DISH NETWORK CORPORATION-A	12,603	30.65	386,281.95	
ELECTRONIC ARTS INC	13,548	137.71	1,865,695.08	
FOX CORP - CLASS A	15,560	40.69	633,136.40	
FOX CORP- CLASS B	6,975	37.25	259,818.75	
IAC/INTERACTIVECORP	3,853	132.04	508,750.12	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	17,946	36.32	651,798.72	
LIBERTY BROADBAND-A	1,450	149.35	216,557.50	
LIBERTY BROADBAND-C	7,402	152.97	1,132,283.94	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,885	60.81	601,106.85	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,928	49.78	394,655.84	
LIBERTY SIRIUSXM-A	3,171	49.66	157,471.86	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	7,518	108.36	814,650.48	
MATCH GROUP INC	13,189	115.98	1,529,660.22	
META PLATFORMS INC-CLASS A	115,331	237.09	27,343,826.79	
NETFLIX INC	21,478	410.17	8,809,631.26	
NEWS CORP-CLASS A	17,936	22.50	403,560.00	
OMNICOM GROUP	9,954	76.74	763,869.96	
PINTEREST INC- CLASS A	27,343	27.25	745,096.75	
ROKU INC	5,586	158.73	886,665.78	
SEA LTD-ADR	6,817	155.02	1,056,771.34	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,096	6.78	319,310.88	
SNAP INC - A	52,578	38.91	2,045,809.98	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	5,342	175.00	934,850.00	
THE WALT DISNEY CO	88,209	142.02	12,527,442.18	
TWITTER INC	37,195	36.94	1,373,983.30	
VIACOMCBS INC-CLASS B	30,808	33.41	1,029,295.28	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	11,800	52.00	613,600.00	
ADVANCE AUTO PARTS	3,129	226.99	710,251.71	
AMAZON.COM	22,027	3,152.79	69,446,505.33	
AUTOZONE INC	1,082	2,018.70	2,184,233.40	
BATH & BODY WORKS INC	13,789	56.13	773,976.57	
BEST BUY COMPANY INC	10,832	96.83	1,048,862.56	
BURLINGTON STORES INC	3,076	223.40	687,178.40	
CARMAX INC	7,628	106.25	810,475.00	
CARVANA CO	3,698	150.31	555,846.38	
CHEWY INC - CLASS A	3,947	49.29	194,547.63	
DOLLAR GENERAL CORP	11,647	202.36	2,356,886.92	

DOLLAR TREE INC	10,956	133.49	1,462,516.44	
DOORDASH INC - A	5,536	98.49	545,240.64	
EBAY	32,206	59.29	1,909,493.74	
ETSY INC	5,869	133.67	784,509.23	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	1,800	81.43	146,574.00	
GENUINE PARTS CO	6,685	129.82	867,846.70	
HOME DEPOT	51,131	359.67	18,390,286.77	
LKQ CORP	13,325	55.02	733,141.50	
LOWES COMPANIES	33,595	229.07	7,695,606.65	
MERCADOLIBRE INC	2,180	1,035.33	2,257,019.40	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,383	646.43	2,186,872.69	
POOL CORP	1,855	448.62	832,190.10	
ROSS STORES INC	16,636	94.16	1,566,445.76	
TARGET (DAYTON HUDSON)	23,475	214.04	5,024,589.00	
TJX COMPANIES INC	58,528	69.18	4,048,967.04	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,411	216.93	1,173,808.23	
ULTA BEAUTY INC	2,478	365.73	906,278.94	
WAYFAIR INC- CLASS A	3,788	142.57	540,055.16	
COSTCO WHOLESALE CORP	21,257	519.77	11,048,750.89	
KROGER CO	33,615	44.77	1,504,943.55	
SYSCO CORP	25,975	78.76	2,045,791.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	34,374	48.60	1,670,576.40	
WALMART INC	74,251	139.33	10,345,391.83	
ALTRIA GROUP INC	90,586	50.19	4,546,511.34	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	28,451	75.71	2,154,025.21	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14,377	67.15	965,415.55	
BUNGE LIMITED	6,422	98.10	629,998.20	
CAMPBELL SOUP CO (US)	9,742	43.09	419,782.78	
COCA-COLA CO	199,430	60.96	12,157,252.80	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	9,216	57.12	526,417.92	
CONAGRA BRANDS INC	22,663	34.73	787,085.99	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,917	237.33	1,878,941.61	
GENERAL MILLS INC	28,545	67.92	1,938,776.40	
HERSHEY FOODS CORPORATION	6,862	202.78	1,391,476.36	
HORMEL FOODS CORP	13,714	46.98	644,283.72	
JM SMUCKER CO	5,275	136.87	721,989.25	
KELLOGG CO	11,938	61.58	735,142.04	
KEURIG DR PEPPER INC	32,694	38.24	1,250,218.56	
KRAFT HEINZ CO/THE	32,632	34.75	1,133,962.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,562	101.73	1,176,202.26	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	8,727	47.71	416,365.17	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	67,011	67.02	4,491,077.22	

MONSTER BEVERAGE CORP	18,482	84.29	1,557,847.78	
PEPSICO INC	66,328	172.49	11,440,916.72	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	75,028	103.59	7,772,150.52	
TYSON FOODS INC	13,674	88.29	1,207,277.46	
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,548	100.98	1,166,117.04	
CLOROX COMPANY	5,866	141.41	829,511.06	
COLGATE-PALMOLIVE CO	38,122	81.12	3,092,456.64	
ESTEE LAUDER CO-CL A	11,283	313.35	3,535,528.05	
KIMBERLY-CLARK CORP	15,902	132.66	2,109,559.32	
PROCTER & GAMBLE CO	117,178	161.53	18,927,762.34	
ABBOTT LABORATORIES	85,273	129.71	11,060,760.83	
ABIOMED INC	2,088	295.65	617,317.20	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,719	489.86	1,821,789.34	
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,105	136.61	970,614.05	
ANTHEM INC	11,878	446.26	5,300,676.28	
BAXTER INTERNATIONAL	23,872	86.71	2,069,941.12	
BECTON DICKINSON & CO	13,583	268.85	3,651,789.55	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	66,997	42.77	2,865,461.69	
CARDINAL HEALTH	13,608	51.96	707,071.68	
CENTENE CORP	29,043	80.57	2,339,994.51	
CERNER CORP	14,251	91.46	1,303,396.46	
CIGNA CORP	16,426	221.37	3,636,223.62	
CVS HEALTH CORP	63,675	108.49	6,908,100.75	
DAVITA INC	3,582	109.34	391,655.88	
DENTSPLY SIRONA INC	10,094	52.30	527,916.20	
DEXCOM INC	4,780	420.35	2,009,273.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	30,691	112.18	3,442,916.38	
HCA HEALTHCARE INC	12,661	239.08	3,026,991.88	
HENRY SCHEIN INC	6,547	76.13	498,423.11	
HOLOGIC INC	11,926	74.74	891,349.24	
HUMANA INC	6,360	429.85	2,733,846.00	
IDEXX LABORATORIES INC	4,215	526.44	2,218,944.60	
INMODE LTD	3,100	48.17	149,327.00	
INSULET CORP	3,546	243.49	863,415.54	
INTUITIVE SURGICAL INC	17,151	285.73	4,900,555.23	
LABORATORY CRP OF AMER	4,533	277.48	1,257,816.84	
MASIMO CORP	2,735	222.35	608,127.25	
MCKESSON CORP	7,488	265.56	1,988,513.28	
MEDTRONIC PLC	64,812	102.73	6,658,136.76	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,739	298.77	818,331.03	
NOVOCURE LTD	4,504	71.24	320,864.96	
OAK STREET HEALTH INC	4,376	16.80	73,516.80	

QUEST DIAGNOSTICS	6,246	134.05	837,276.30	
RESMED INC	6,751	239.01	1,613,556.51	
STERIS PLC	5,122	225.94	1,157,264.68	
STRYKER CORP	16,646	250.95	4,177,313.70	
TELADOC HEALTH INC	6,270	74.55	467,428.50	
TELEFLEX INC	2,162	313.29	677,332.98	
THE COOPER COS INC	2,279	388.66	885,756.14	
UNITEDHEALTH GROUP INC	45,683	483.17	22,072,655.11	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	129.81	505,999.38	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,903	232.81	1,607,087.43	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,671	122.83	1,187,888.93	
10X GENOMICS INC-CLASS A	3,216	90.29	290,372.64	
ABBVIE INC	84,795	140.65	11,926,416.75	
AGILENT TECHNOLOGIES	14,398	141.12	2,031,845.76	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,417	145.42	787,740.14	
AMGEN	27,728	222.11	6,158,666.08	
AVANTOR INC	24,065	37.14	893,774.10	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,027	626.69	643,610.63	
BIO-TECHNE CORP	1,796	410.07	736,485.72	
BIOGEN INC	7,191	221.53	1,593,022.23	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,381	88.63	742,808.03	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	107,603	64.99	6,993,118.97	
CATALENT INC	8,308	102.65	852,816.20	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,324	335.65	780,050.60	
DANAHER CORP	30,829	287.63	8,867,345.27	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,778	24.97	518,826.66	
EXACT SCIENCES CORP	9,063	77.72	704,376.36	
GILEAD SCIENCES INC	61,511	63.90	3,930,552.90	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	10,243	92.55	947,989.65	
ILLUMINA INC	7,260	358.38	2,601,838.80	
INCYTE CORP	8,608	72.69	625,715.52	
IQVIA HOLDINGS INC	9,501	249.89	2,374,204.89	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,663	140.94	375,323.22	
JOHNSON & JOHNSON	127,558	171.63	21,892,779.54	
LILLY (ELI) & CO	39,135	242.27	9,481,236.45	
MERCK & CO	121,654	78.56	9,557,138.24	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,109	1,491.90	1,654,517.10	
MODERNA INC	16,456	163.01	2,682,492.56	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,708	81.14	382,007.12	
NOVAVAX INC	3,227	89.33	288,267.91	
PERKINELMER INC	5,174	182.95	946,583.30	
PFIZER	272,114	53.00	14,422,042.00	

REGENERON PHARMACEUTICALS	5,174	622.96	3,223,195.04	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,093	39.97	723,177.21	
SEAGEN INC	6,223	137.93	858,338.39	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	56,857	8.51	483,853.07	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	19,105	594.42	11,356,394.10	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,167	241.96	2,943,927.32	
VIATRIS INC	57,073	15.13	863,514.49	
WATERS CORP	2,876	325.91	937,317.16	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,434	400.75	1,376,175.50	
ZOETIS INC	23,191	199.54	4,627,532.14	
BANK OF AMERICA CORP	366,345	48.28	17,687,136.60	
CITIGROUP	97,674	66.08	6,454,297.92	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,818	54.05	1,071,162.90	
FIFTH THIRD BANCORP	33,182	47.34	1,570,835.88	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	578	786.69	454,706.82	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,838	175.91	1,554,692.58	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	69,030	15.83	1,092,744.90	
JPMORGAN CHASE & CO	144,686	152.56	22,073,296.16	
KEY CORP	44,974	26.17	1,176,969.58	
M & T BANK CORP	5,956	179.56	1,069,459.36	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	20,656	210.35	4,344,989.60	
REGIONS FINL CORP	46,064	24.25	1,117,052.00	
SIGNATURE BANK	3,120	320.87	1,001,114.40	
SVB FINANCIAL GROUP	2,803	613.31	1,719,107.93	
TRUIST FINANCIAL CORP	65,536	63.98	4,192,993.28	
US BANCORP	69,143	59.70	4,127,837.10	
WEBSTER FINANCIAL CORP	8,680	60.78	527,570.40	
WELLS FARGO & CO	198,525	56.33	11,182,913.25	
ALLY FINANCIAL INC	18,129	48.57	880,525.53	
AMERICAN EXPRESS	33,082	185.85	6,148,289.70	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,496	308.10	1,693,317.60	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,489	70.33	1,089,341.37	
BANK NEW YORK CO	38,892	61.81	2,403,914.52	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	64,242	314.99	20,235,587.58	
BLACKROCK INC	7,350	809.82	5,952,177.00	
BLACKSTONE INC	33,248	132.25	4,397,048.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	21,406	150.35	3,218,392.10	
CARLYLE GROUP INC/THE	7,865	49.82	391,834.30	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,962	120.25	596,680.50	
CME GROUP INC	17,634	246.17	4,340,961.78	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	2,030	194.44	394,713.20	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,285	117.23	1,674,630.55	

EQUITABLE HOLDINGS INC	18,461	34.59	638,565.99	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,750	420.28	735,490.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	31.12	458,957.76	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,286	41.83	95,623.38	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,151	367.60	5,937,107.60	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	27,704	129.76	3,594,871.04	
INVESCO LTD	19,405	22.83	443,016.15	
KKR & CO INC	24,952	70.93	1,769,845.36	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,762	366.71	646,143.02	
MOODY'S CORP	7,905	346.88	2,742,086.40	
MORGAN STANLEY	65,965	104.11	6,867,616.15	
MSCI INC	3,869	554.71	2,146,172.99	
NASDAQ INC	5,320	178.62	950,258.40	
NORTHERN TRUST CORP	9,186	121.58	1,116,833.88	
PRICE T ROWE GROUP INC	10,575	148.70	1,572,502.50	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,550	110.96	948,708.00	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	11,150	15.18	169,257.00	
S&P GLOBAL INC	11,657	414.39	4,830,544.23	
SCHWAB (CHARLES) CORP	69,946	91.90	6,428,037.40	
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	59.56	374,572.84	
SOFI TECHNOLOGIES INC	28,600	11.89	340,054.00	
STATE STREET CORP	17,185	98.89	1,699,424.65	
SYNCHRONY FINANCIAL	27,139	42.50	1,153,407.50	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,522	83.98	379,757.56	
UPSTART HOLDINGS INC	1,260	98.63	124,273.80	
AFLAC	31,141	64.69	2,014,511.29	
ALLEGHANY CORP	647	687.23	444,637.81	
ALLSTATE CORP	14,193	122.12	1,733,249.16	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,803	132.14	502,528.42	
AMERICAN INT'L GROUP	40,246	60.99	2,454,603.54	
AON PLC	10,695	291.31	3,115,560.45	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	18,793	47.64	895,298.52	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,383	156.28	1,622,655.24	
ASSURANT INC	2,684	153.07	410,839.88	
BROWN & BROWN INC	11,065	67.53	747,219.45	
CHUBB LTD	21,140	206.59	4,367,312.60	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,076	121.69	861,078.44	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,444	183.58	265,089.52	
EVEREST RE GROUP LTD	1,834	285.99	524,505.66	
FNF GROUP	12,836	50.29	645,522.44	
GLOBE LIFE INC	4,559	103.87	473,543.33	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	16,673	70.52	1,175,779.96	

LINCOLN NATIONAL CORP	8,416	71.55	602,164.80	
LOEWS CORP	10,482	61.27	642,232.14	
MARKEL CORP	639	1,260.61	805,529.79	
MARSH & MCLENNAN COS	24,739	153.25	3,791,251.75	
METLIFE INC	35,762	68.99	2,467,220.38	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,725	74.77	951,448.25	
PROGRESSIVE CORP	28,960	109.07	3,158,667.20	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,486	118.34	2,187,633.24	
TRAVELERS COS INC/THE	11,830	171.90	2,033,577.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,009	237.86	1,429,300.74	
WR BERKLEY CORP	6,553	89.76	588,197.28	
CBRE GROUP INC-A	16,391	101.23	1,659,260.93	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	64,300	5.59	359,437.00	
WEYERHAEUSER CO	36,674	40.49	1,484,930.26	
ZILLOW GROUP INC-A	3,140	47.74	149,903.60	
ZILLOW GROUP INC-C	7,537	48.94	368,860.78	
ACCENTURE PLC-CL A	30,517	347.50	10,604,657.50	
ADOBE INC	22,891	513.54	11,755,444.14	
AFFIRM HOLDINGS INC	4,720	62.75	296,180.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	7,539	114.12	860,350.68	
ANSYS INC	4,382	326.79	1,431,993.78	
ASANA INC - CL A	3,840	48.11	184,742.40	
AUTODESK INC	10,882	241.24	2,625,173.68	
AUTOMATIC DATA PROCESS	20,090	206.25	4,143,562.50	
AVALARA INC	4,011	105.30	422,358.30	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,879	38.68	304,759.72	
BILL.COM HOLDINGS INC	3,830	231.67	887,296.10	
BLACK KNIGHT INC	8,009	72.27	578,810.43	
BLOCK INC	18,977	108.87	2,066,025.99	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	5,360	149.88	803,356.80	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	13,022	147.51	1,920,875.22	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,963	77.21	537,613.23	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,676	128.26	728,003.76	
CITRIX SYSTEMS INC	5,416	102.36	554,381.76	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	11,647	103.19	1,201,853.93	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	24,980	86.82	2,168,763.60	
COUPA SOFTWARE INC	3,189	129.79	413,900.31	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,298	177.21	1,647,698.58	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,100	135.68	284,928.00	
DATADOG INC - CLASS A	8,853	150.26	1,330,251.78	
DOCUSIGN INC	9,538	118.46	1,129,871.48	
DROPBOX INC-CLASS A	16,505	24.26	400,411.30	

DYNATRACE INC	8,780	47.24	414,767.20	
EPAM SYSTEMS INC	2,842	453.68	1,289,358.56	
FAIR ISAAC CORP	1,345	502.06	675,270.70	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	30,439	113.76	3,462,740.64	
FISERV INC	28,111	104.88	2,948,281.68	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,879	236.19	916,181.01	
FORTINET INC	6,902	314.33	2,169,505.66	
GARTNER INC	4,134	294.64	1,218,041.76	
GLOBAL PAYMENTS INC	14,011	145.79	2,042,663.69	
GODADDY INC - CLASS A	8,747	76.45	668,708.15	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	3,640	96.95	352,898.00	
HUBSPOT INC	2,233	472.13	1,054,266.29	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	43,137	137.15	5,916,239.55	
INTUIT INC	13,160	544.02	7,159,303.20	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,514	168.00	590,352.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	42,363	382.20	16,191,138.60	
MICROSOFT CORP	345,008	305.94	105,551,747.52	
MONGODB INC	2,666	403.54	1,075,837.64	
NORTONLIFELOCK INC	25,891	27.59	714,332.69	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	15,640	55.37	865,986.80	
OKTA INC	6,285	188.86	1,186,985.10	
ORACLE CORP	81,320	82.11	6,677,185.20	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	74,206	12.94	960,225.64	
PALO ALTO NETWORKS INC	4,839	515.50	2,494,504.50	
PAYCHEX INC	15,091	119.91	1,809,561.81	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,306	325.76	751,202.56	
PAYPAL HOLDINGS INC	54,270	126.08	6,842,361.60	
PTC INC	5,381	115.76	622,904.56	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,503	161.49	565,699.47	
SALESFORCE.COM INC	47,514	219.23	10,416,494.22	
SERVICENOW INC	9,533	577.52	5,505,498.16	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	10,361	275.72	2,856,734.92	
SPLUNK INC	7,452	117.82	877,994.64	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10,662	80.34	856,585.08	
SYNOPSYS INC	7,555	308.89	2,333,663.95	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	21,590	73.04	1,576,933.60	
TWILIO INC - A	7,960	192.00	1,528,320.00	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,028	470.75	954,681.00	
UNITY SOFTWARE INC	2,516	108.66	273,388.56	
VERISIGN INC	4,769	218.43	1,041,692.67	
VISA INC-CLASS A SHARES	81,833	228.39	18,689,838.87	
VMWARE INC-CLASS A	10,056	131.07	1,318,039.92	

WESTERN UNION CO	20,387	18.14	369,820.18	
WIX.COM LTD	2,353	119.99	282,336.47	
WORKDAY INC-CLASS A	9,326	236.79	2,208,303.54	
ZENDESK INC	5,395	97.68	526,983.60	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	10,363	144.10	1,493,308.30	
ZSCALER INC	4,184	258.98	1,083,572.32	
AMPHENOL CORPORATION	27,943	78.76	2,200,790.68	
APPLE INC	798,812	172.39	137,707,200.68	
ARISTA NETWORKS INC	11,492	122.32	1,405,701.44	
ARROW ELECTRONICS INC	3,851	126.23	486,111.73	
CDW CORP/DE	6,651	192.30	1,278,987.30	
CISCO SYSTEMS	202,087	55.15	11,145,098.05	
COGNEX CORP	8,069	65.18	525,937.42	
CORNING	40,515	42.19	1,709,327.85	
DELL TECHNOLOGIES -C	14,009	58.74	822,888.66	
F5 INC	2,841	203.16	577,177.56	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	59,737	16.84	1,005,971.08	
HP INC	58,057	37.60	2,182,943.20	
IPG PHOTONICS CORP	1,782	149.95	267,210.90	
JUNIPER NETWORKS INC	16,308	35.13	572,900.04	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	8,628	166.21	1,434,059.88	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,906	235.57	1,862,416.42	
NETAPP INC	10,843	87.63	950,172.09	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	9,880	108.72	1,074,153.60	
TE CONNECTIVITY LTD	15,454	144.62	2,234,957.48	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,150	417.71	898,076.50	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	11,609	70.47	818,086.23	
WESTERN DIGITAL CORP	15,203	51.81	787,667.43	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,482	503.09	1,248,669.38	
AT&T INC	342,473	24.08	8,246,749.84	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,831	27.66	216,605.46	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,877	27.69	522,704.13	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	42,975	12.51	537,617.25	
T-MOBILE US INC	30,205	120.94	3,652,992.70	
VERIZON COMMUNICATIONS	201,261	53.31	10,729,223.91	
AES CORP	30,838	21.91	675,660.58	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	12,663	59.13	748,763.19	
AMEREN CORPORATION	13,199	86.88	1,146,729.12	
AMERICAN ELECTRIC POWER	24,953	89.17	2,225,059.01	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,442	155.50	1,312,731.00	
ATMOS ENERGY CORP	6,189	105.76	654,548.64	
CENTERPOINT ENERGY INC	27,008	27.89	753,253.12	

CMS ENERGY CORP	13,272	64.68	858,432.96	
CONSOLIDATED EDISON INC	17,915	86.09	1,542,302.35	
CONSTELLATION ENERGY	16,151	50.14	809,811.14	
DOMINION ENERGY INC	38,186	80.18	3,061,753.48	
DTE ENERGY COMPANY	9,012	120.00	1,081,440.00	
DUKE ENERGY CORP	37,403	104.25	3,899,262.75	
EDISON INTL	17,598	61.16	1,076,293.68	
ENTERGY CORP	9,296	110.90	1,030,926.40	
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,385	47.27	538,168.95	
EVERGY INC	10,471	65.23	683,023.33	
EVERSOURCE ENERGY	15,980	87.74	1,402,085.20	
EXELON CORP	48,454	43.52	2,108,718.08	
FIRSTENERGY CORP	25,172	41.36	1,041,113.92	
NEXTERA ENERGY INC	94,384	76.01	7,174,127.84	
NISOURCE INC	20,005	29.35	587,146.75	
NRG ENERGY INC	12,298	39.36	484,049.28	
PG&E CORP	68,966	12.08	833,109.28	
PPL CORPORATION	35,742	29.41	1,051,172.22	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	23,582	66.64	1,571,504.48	
SEMPRA ENERGY	15,948	136.27	2,173,233.96	
SOUTHERN CO	51,635	68.69	3,546,808.15	
UGI CORP	9,579	41.75	399,923.25	
VISTRA CORP	23,603	21.83	515,253.49	
WEC ENERGY GROUP INC	14,672	94.64	1,388,558.08	
XCEL ENERGY INC	26,807	68.78	1,843,785.46	
ADVANCED MICRO DEVICES	58,620	123.60	7,245,432.00	
ANALOG DEVICES	26,323	161.03	4,238,792.69	
APPLIED MATERIALS	44,314	135.57	6,007,648.98	
BROADCOM INC	19,933	590.16	11,763,659.28	
ENPHASE ENERGY INC	6,604	141.23	932,682.92	
ENTEGRIS INC	6,990	128.56	898,634.40	
INTEL CORP	197,298	48.01	9,472,276.98	
KLA CORP	7,254	377.38	2,737,514.52	
LAM RESEARCH CORP	6,748	579.07	3,907,564.36	
MARVELL TECHNOLOGY INC	40,684	71.10	2,892,632.40	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	27,084	73.18	1,982,007.12	
MICRON TECHNOLOGY	54,679	81.17	4,438,294.43	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,981	400.12	792,637.72	
NVIDIA CORP	120,952	243.19	29,414,316.88	
NXP SEMICONDUCTORS NV	13,089	198.12	2,593,192.68	
ON SEMICONDUCTOR CORP	21,863	57.42	1,255,373.46	
QORVO INC	5,297	131.45	696,290.65	

	QUALCOMM	54,258	179.47	9,737,683.26	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,742	135.10	1,045,944.20	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	2,629	238.26	626,385.54	
	TERADYNE INC	7,707	114.01	878,675.07	
	TEXAS INSTRUMENTS	44,415	171.42	7,613,619.30	
	XILINX INC	12,235	209.02	2,557,359.70	
アメリカドル 小計		15,317,132		1,907,471,801.51 (219,855,199,842)	
カナダドル	CAMECO CORP	19,186	25.37	486,748.82	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	58,757	68.30	4,013,103.10	
	CENOVUS ENERGY INC	65,155	19.73	1,285,508.15	
	ENBRIDGE	98,735	54.72	5,402,779.20	
	IMPERIAL OIL	11,645	54.82	638,378.90	
	KEYERA CORP	10,963	30.50	334,371.50	
	PARKLAND CORP	8,544	34.48	294,597.12	
	PEMBINA PIPELINE CORP	25,294	41.09	1,039,330.46	
	SUNCOR ENERGY	70,924	36.64	2,598,655.36	
	TC ENERGY CORP	48,340	64.53	3,119,380.20	
	TOURMALINE OIL CORP	16,810	49.41	830,582.10	
	AGNICO EAGLE MINES	11,143	61.46	684,848.78	
	BARRICK GOLD CORP	82,748	24.46	2,024,016.08	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	64.50	470,979.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	26,720	32.87	878,286.40	
	FRANCO-NEVADA CORP	9,313	170.91	1,591,684.83	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	26,291	11.12	292,355.92	
	KINROSS GOLD CORP	56,706	6.92	392,405.52	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	11,734	48.75	572,032.50	
	LUNDIN MINING CORP	30,173	10.93	329,790.89	
	NUTRIEN LTD	28,517	92.38	2,634,400.46	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	9,343	27.20	254,129.60	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	20,669	42.36	875,538.84	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,500	122.32	550,440.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	20,697	51.10	1,057,616.70	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	10,643	12.41	132,079.63	
	CAE INC	16,864	31.74	535,263.36	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,269	107.43	458,618.67	
	WSP GLOBAL INC	5,400	169.89	917,406.00	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	6,920	40.27	278,668.40	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,665	77.24	437,564.60	
	THOMSON REUTERS CORP	7,995	134.53	1,075,567.35	
	AIR CANADA	6,737	23.33	157,174.21	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	34,564	156.04	5,393,366.56	

CP RAILWAY LIMITED	44,278	90.10	3,989,447.80	
TFI INTERNATIONAL INC	4,630	125.49	581,018.70	
MAGNA INTERNATIONAL INC	13,183	101.53	1,338,469.99	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	51.67	516,700.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	13,329	71.09	947,558.61	
QUEBECOR INC -CL B	5,999	30.49	182,909.51	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	21,310	37.62	801,682.20	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,586	185.30	479,185.80	
DOLLARAMA INC	13,514	66.90	904,086.60	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	39,890	53.38	2,129,328.20	
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	39.59	290,194.70	
LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	101.30	918,588.40	
METRO INC	11,419	68.03	776,834.57	
WESTON (GEORGE) LTD	3,705	140.64	521,071.20	
SAPUTO INC	11,041	28.24	311,797.84	
BAUSCH HEALTH COS INC	14,544	31.27	454,790.88	
CANOPY GROWTH CORP	9,718	10.01	97,277.18	
BANK MONTREAL	31,608	148.36	4,689,362.88	
BANK NOVA SCOTIA	59,175	93.35	5,523,986.25	
CANADIAN IMPERIAL BANK	22,299	163.81	3,652,799.19	
NATIONAL BANK OF CANADA	16,160	102.99	1,664,318.40	
ROYAL BANK OF CANADA	68,610	146.87	10,076,750.70	
TORONTO-DOMINION BANK	87,827	105.62	9,276,287.74	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	69,288	69.71	4,830,066.48	
IGM FINANCIAL INC	3,890	45.27	176,100.30	
ONEX CORP	3,361	91.23	306,624.03	
TMX GROUP LTD	2,508	123.11	308,759.88	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,198	630.78	755,674.44	
GREAT-WEST LIFECO INC	12,491	40.72	508,633.52	
IA FINANCIAL CORP INC	5,415	83.11	450,040.65	
INTACT FINANCIAL CORP	8,967	175.13	1,570,390.71	
MANULIFE FINANCIAL CORP	90,426	26.45	2,391,767.70	
POWER CORP OF CANADA	25,684	41.90	1,076,159.60	
SUN LIFE FINANCIAL INC	27,175	72.89	1,980,785.75	
FIRSTSERVICE CORP	2,028	199.19	403,957.32	
BLACKBERRY LIMITED	25,075	9.40	235,705.00	
CGI INC - CL A	11,043	111.47	1,230,963.21	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	932	2,169.54	2,022,011.28	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	5,859	40.17	235,356.03	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,153	74.25	159,860.25	
OPEN TEXT CORP	12,469	56.72	707,241.68	
SHOPIFY INC - CLASS A	5,424	1,118.24	6,065,333.76	

	BCE INC	3,102	67.93	210,718.86	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	16,322	65.26	1,065,173.72	
	TELUS CORP	23,120	30.82	712,558.40	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	37,267	17.90	667,079.30	
	ALTAGAS INCOME LTD	14,516	26.41	383,367.56	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,264	42.30	264,967.20	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	35.86	214,371.08	
	EMERA INC	11,366	59.78	679,459.48	
	FORTIS INC	22,342	59.75	1,334,934.50	
	HYDRO ONE LTD	14,776	32.68	482,879.68	
	NORTHLAND POWER INC	9,907	35.57	352,391.99	
カナダドル 小計		1,880,835		123,945,449.91 (11,204,668,671)	
ユーロ	ENI	126,764	13.48	1,708,778.72	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	23,722	9.99	237,125.11	
	NESTE OIL OYJ	19,525	38.82	757,960.50	
	OMV AG	5,822	54.88	319,511.36	
	REPSOL SA	68,089	11.48	782,206.43	
	TENARIS SA	19,529	11.42	223,021.18	
	TOTALENERGIES SE	122,539	50.97	6,245,812.83	
	AIR LIQUIDE	23,018	147.26	3,389,630.68	
	AKZO NOBEL	9,224	88.72	818,353.28	
	ARCELORMITTAL	35,308	27.18	959,671.44	
	ARKEMA	2,799	128.20	358,831.80	
	BASF SE	44,781	66.71	2,987,340.51	
	COVESTRO AG	10,438	52.60	549,038.80	
	CRH PLC	36,478	44.48	1,622,541.44	
	EVONIK INDUSTRIES AG	9,603	28.96	278,102.88	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	3,246	37.82	122,763.72	
	HEIDELBERGCEMENT AG	6,738	64.68	435,813.84	
	KONINKLIJKE DSM NV	8,702	163.10	1,419,296.20	
	LANXESS	3,921	52.78	206,950.38	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,335	47.17	534,671.95	
	SOLVAY SA	3,676	107.70	395,905.20	
	STORA ENSO OYJ R	26,361	17.97	473,838.97	
	SYMRISE AG	5,851	104.05	608,796.55	
	UMICORE	9,946	31.93	317,575.78	
	UPM KYMMENE OYJ	24,581	32.60	801,340.60	
	VOESTALPINE AG	5,948	29.66	176,417.68	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	10,716	22.41	240,145.56	
	ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	10,716	0.44	4,773.97	
	AIRBUS SE	28,672	110.32	3,163,095.04	

ALSTOM	16,908	27.09	458,037.72	
BOUYGUES ORD	11,344	31.28	354,840.32	
BRENNTAG SE	6,989	74.62	521,519.18	
CNH INDUSTRIAL NV	46,753	12.88	602,412.40	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	20,876	31.72	662,291.10	
DASSAULT AVIATION SA	1,210	106.20	128,502.00	
EIFFAGE	3,659	93.92	343,653.28	
FERROVIAL SA	22,126	24.11	533,457.86	
GEA GROUP AG	7,649	41.58	318,045.42	
IMCD NV	3,050	150.45	458,872.50	
KINGSPAN GROUP PLC	7,694	82.66	635,986.04	
KION GROUP AG	3,430	78.56	269,460.80	
KNORR-BREMSE AG	3,221	87.40	281,515.40	
KONE OYJ-B	15,737	55.46	872,774.02	
LEGRAND SA	13,075	90.44	1,182,503.00	
MTU AERO ENGINES AG	2,396	183.70	440,145.20	
PRYSMIAN SPA	11,275	28.23	318,293.25	
RATIONAL AG	268	715.40	191,727.20	
SAFRAN SA	17,120	106.16	1,817,459.20	
SAINT-GOBAIN	25,279	59.18	1,496,011.22	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	26,108	146.66	3,828,999.28	
SIEMENS	36,928	132.84	4,905,515.52	
SIEMENS ENERGY AG	18,121	19.29	349,644.69	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	12,322	17.52	215,943.05	
THALES SA	4,746	78.44	372,276.24	
VINCI S.A.	26,015	98.19	2,554,412.85	
WARTSILA OYJ	18,738	10.47	196,280.55	
BUREAU VERITAS SA	12,892	24.36	314,049.12	
RANDSTAD NV	5,866	60.00	351,960.00	
TELEPERFORMANCE	2,688	325.30	874,406.40	
WOLTERS KLUWER	12,334	88.70	1,094,025.80	
ADP	1,532	121.60	186,291.20	
AENA SME SA	3,518	143.70	505,536.60	
ATLANTIA SPA	26,089	16.13	420,815.57	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	38,499	6.84	263,410.15	
DEUTSCHE POST AG-REG	48,367	52.18	2,523,790.06	
GETLINK	18,993	13.70	260,204.10	
INPOST SA	7,867	6.87	54,054.15	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	16,643	89.66	1,492,211.38	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,582	74.70	192,875.40	
CONTINENTAL AG	4,993	83.94	419,112.42	
FAURECIA	5,347	38.65	206,661.55	

FERRARI NV	6,331	200.00	1,266,200.00	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	41,753	67.83	2,832,105.99	
MICHELIN	8,304	146.65	1,217,781.60	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	6,979	78.92	550,782.68	
RENAULT SA	8,441	34.29	289,484.09	
STELLANTIS NV	95,050	16.46	1,564,713.10	
VALEO SA	10,032	24.51	245,884.32	
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,638	176.14	1,521,497.32	
VOLKSWAGEN STAMM	1,657	246.20	407,953.40	
ADIDAS AG	9,292	240.10	2,231,009.20	
ESSILORLUXOTTICA	14,035	171.92	2,412,897.20	
HERMES INTERNATIONAL	1,565	1,310.00	2,050,150.00	
KERING	3,523	652.20	2,297,700.60	
LVMH	13,333	706.10	9,414,431.30	
MONCLER SPA	9,963	58.00	577,854.00	
PUMA SE	4,644	91.46	424,740.24	
SEB SA	1,310	133.50	174,885.00	
ACCOR	7,911	31.63	250,224.93	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8,339	124.15	1,035,286.85	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,332	35.35	188,486.20	
SODEXO	3,888	81.24	315,861.12	
BOLLORE	37,200	4.86	180,866.40	
PUBLICIS GROUPE	10,059	63.94	643,172.46	
SCOUT24 SE	4,128	52.60	217,132.80	
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,969	50.76	252,226.44	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	33,016	21.14	697,958.24	
VIVENDI SE	33,016	11.50	379,684.00	
DELIVERY HERO SE	7,305	65.20	476,286.00	
INDITEX	50,337	25.04	1,260,438.48	
JUST EAT TAKEAWAY	8,459	40.24	340,390.16	
PROSUS	45,879	70.89	3,252,362.31	
ZALANDO SE	11,285	65.98	744,584.30	
CARREFOUR	30,831	16.77	517,035.87	
COLRUYT SA	2,228	35.30	78,648.40	
HELLOFRESH SE	7,756	54.68	424,098.08	
JERONIMO MARTINS	13,062	20.27	264,766.74	
KESKO OYJ-B SHS	14,326	27.22	389,953.72	
KONINKLIJKE AHOLD NV	50,995	28.54	1,455,397.30	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	37,611	53.23	2,002,033.53	
DANONE (GROUPE)	32,878	54.73	1,799,412.94	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	26,648	11.03	293,927.44	
HEINEKEN HOLDING NV	5,127	75.90	389,139.30	

HEINEKEN NV	11,984	92.50	1,108,520.00	
JDE PEET'S BV	4,123	26.62	109,754.26	
KERRY GROUP PLC-A	7,323	108.40	793,813.20	
PERNOD-RICARD	10,396	190.25	1,977,839.00	
REMY COINTREAU	1,020	184.90	188,598.00	
BEIERSDORF AG	4,515	87.66	395,784.90	
HENKEL AG & CO KGAA	4,647	68.00	315,996.00	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	8,553	70.82	605,723.46	
LOREAL	12,190	367.75	4,482,872.50	
AMPLIFON SPA	6,606	36.31	239,863.86	
BIOMERIEUX	2,374	104.05	247,014.70	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,091	136.60	285,630.60	
DIASORIN SPA	1,418	131.60	186,608.80	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	9,705	60.76	589,675.80	
FRESENIUS SE&CO KGAA	20,026	36.99	740,761.74	
KONINKLIJKE PHILIPS	42,449	28.90	1,226,776.10	
ORPEA	2,344	33.71	79,016.24	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,216	463.50	563,616.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,577	57.06	831,763.62	
ARGENX SE	2,207	243.10	536,521.70	
BAYER	48,711	52.62	2,563,172.82	
EUROFINS SCIENTIFIC	6,490	90.38	586,566.20	
GRIFOLS SA	14,240	15.15	215,736.00	
IPSEN	1,866	88.60	165,327.60	
MERCK KGAA	5,937	191.15	1,134,857.55	
ORION OYJ-CLASS B	5,393	35.27	190,211.11	
QIAGEN N.V.	11,006	43.43	477,990.58	
RECORDATI SPA	5,195	47.35	245,983.25	
SANOFI	54,817	90.29	4,949,426.93	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,235	390.90	482,761.50	
UCB (GROUPE)	6,718	88.30	593,199.40	
ABN AMRO BANK NV-CVA	19,718	15.02	296,203.79	
BANCO BILBAO VIZCAYA	328,517	5.68	1,867,947.66	
BANCO SANTANDER SA	847,548	3.25	2,757,921.19	
BNP PARIBAS	54,846	64.30	3,526,597.80	
CAIXABANK	190,947	3.21	613,321.76	
COMMERZBANK AG	46,222	8.70	402,131.40	
CREDIT AGRICOLE SA	64,475	13.57	875,441.55	
ERSTE GROUP BANK AG	18,119	42.78	775,130.82	
FINECOBANK SPA	27,362	14.91	408,104.23	
ING GROEP NV-CVA	193,144	13.15	2,539,843.60	
INTESA SANPAOLO	823,869	2.66	2,197,258.62	

KBC GROEP NV	12,855	77.72	999,090.60	
MEDIOBANCA	29,447	10.02	295,206.17	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,866	25.94	204,044.04	
SOCIETE GENERALE	38,744	34.03	1,318,652.04	
UNICREDIT SPA	97,909	14.97	1,465,697.73	
AMUNDI SA	2,812	66.50	186,998.00	
DEUTSCHE BANK NAMEN	95,207	13.57	1,292,720.64	
DEUTSCHE BOERSE	8,787	155.95	1,370,332.65	
EURAZEO SA	2,340	68.95	161,343.00	
EURONEXT NV	4,500	85.55	384,975.00	
EXOR NV	4,845	70.78	342,929.10	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,582	93.20	520,242.40	
SOFINA	752	345.20	259,590.40	
WENDEL	1,047	93.30	97,685.10	
AEGON	79,881	5.21	416,339.77	
AGEAS	8,621	42.64	367,599.44	
ALLIANZ SE-REG	19,980	222.25	4,440,555.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	50,794	18.40	934,863.57	
AXA SA	95,834	27.47	2,632,559.98	
CNP ASSURANCES	8,406	21.83	183,502.98	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,976	165.15	491,486.40	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	6,508	267.00	1,737,636.00	
NN GROUP NV	13,557	50.44	683,815.08	
POSTE ITALIANE SPA	25,777	11.19	288,573.51	
SAMPO OYJ-A SHS	22,572	43.36	978,721.92	
AROUNDTOWN SA	52,418	5.41	283,581.38	
LEG IMMOBILIEN SE	3,774	112.75	425,518.50	
VONOVIA SE	36,313	48.75	1,770,258.75	
ADYEN NV	967	1,664.80	1,609,861.60	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	20,738	61.20	1,269,165.60	
BECHTLE AG	4,296	52.58	225,883.68	
CAPGEMINI SA	7,448	193.15	1,438,581.20	
DASSAULT SYSTEMES SA	33,230	42.61	1,416,096.45	
EDENRED	12,673	36.45	461,930.85	
NEMETSCHEK SE	3,320	80.84	268,388.80	
NEXI SPA	19,721	13.03	257,063.23	
SAP SE	50,282	109.18	5,489,788.76	
WORLDLINE SA	10,832	42.51	460,468.32	
NOKIA OYJ	272,288	5.00	1,363,073.72	
CELLNEX TELECOM SA	25,019	39.21	980,994.99	
DEUTSCHE TELEKOM	164,526	17.02	2,801,548.72	
ELISA A	6,367	51.52	328,027.84	

	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,877	9.22	137,195.69	
	KPN (KON.)	173,861	2.96	514,802.42	
	ORANGE	97,536	10.48	1,022,762.49	
	PROXIMUS	7,531	17.84	134,390.69	
	TELECOM ITALIA ORD	489,749	0.41	204,176.35	
	TELEFONICA	251,947	4.16	1,049,107.30	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	2.59	106,203.64	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,889	35.13	206,880.57	
	E.ON SE	109,829	12.15	1,335,081.32	
	EDP RENOVAVEIS SA	11,245	18.21	204,771.45	
	ELECTRICITE DE FRANCE	21,082	8.25	173,926.50	
	ELIA GROUP SA/NV	1,959	114.00	223,326.00	
	ENAGAS	11,944	18.96	226,517.96	
	ENDESA	17,138	19.17	328,621.15	
	ENEL	398,046	6.63	2,642,627.39	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	139,324	4.36	608,149.26	
	ENGIE	83,973	14.10	1,184,355.19	
	FORTUM OYJ	20,155	24.67	497,223.85	
	IBERDROLA SA	284,072	9.70	2,755,498.40	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	9,726	27.79	270,285.54	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,296	17.49	407,447.04	
	RWE STAMM	31,648	36.87	1,166,861.76	
	SNAM SPA	90,959	4.83	439,331.97	
	SUEZ	17,194	19.83	340,957.02	
	TERNA SPA	63,339	6.75	428,044.96	
	UNIPER SE	4,137	39.81	164,693.97	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	31,290	32.36	1,012,544.40	
	VERBUND AG	3,100	94.30	292,330.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	2,248	287.50	646,300.00	
	ASML HOLDING NV	20,078	564.20	11,328,007.60	
	INFINEON TECHNOLOGIES	64,521	33.49	2,161,130.89	
	STMICROELECTRONICS	31,427	38.78	1,218,739.06	
ユーロ 小計		8,938,679		230,647,710.22 (30,440,884,794)	
イギリスポンド	BP PLC	986,438	4.05	4,003,951.84	
	SHELL PLC-NEW	381,017	20.37	7,761,316.29	
	ANGLO AMERICAN PLC	63,630	33.22	2,114,106.75	
	ANTOFAGASTA PLC	17,358	12.27	212,982.66	
	BHP GROUP LIMITED	104,515	24.20	2,529,263.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,013	77.30	542,104.90	
	EVRAZ PLC	34,299	4.88	167,482.01	
	GLENCORE PLC	495,828	4.02	1,994,468.13	

JOHNSON MATTHEY PLC	8,824	17.81	157,155.44	
MONDI PLC	22,378	18.54	415,000.01	
RIO TINTO PLC REG	54,588	53.67	2,929,737.96	
ASHTEAD GROUP PLC	22,405	50.08	1,122,042.40	
BAE SYSTEMS PLC	156,168	5.72	894,217.96	
BUNZL PLC	15,472	27.19	420,683.68	
DCC PLC	4,499	63.34	284,966.66	
FERGUSON PLC	10,338	112.60	1,164,058.80	
MELROSE INDUSTRIES PLC	215,001	1.48	318,523.98	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	385,471	1.13	437,895.05	
SMITHS GROUP PLC	20,046	15.43	309,309.78	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,672	130.45	479,012.40	
EXPERIAN PLC	46,007	30.37	1,397,232.59	
INTERTEK GROUP PLC	7,435	52.38	389,445.30	
RELX PLC	95,541	22.66	2,164,959.06	
RENTOKIL INITIAL PLC	85,410	5.12	437,470.02	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	6.13	312,495.14	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,048	41.44	250,629.12	
BURBERRY GROUP PLC	18,587	18.70	347,669.83	
PERSIMMON PLC	14,327	23.61	338,260.47	
TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	1.49	247,992.68	
COMPASS GROUP PLC	83,254	17.34	1,443,624.36	
ENTAIN PLC	26,944	15.72	423,694.40	
INTERCONTINENTAL HOTELS	7,987	48.44	386,890.28	
WHITBREAD PLC	10,170	29.68	301,845.60	
AUTO TRADER GROUP PLC	43,890	6.54	287,040.60	
INFORMA PLC	69,112	5.55	383,986.27	
PEARSON	34,302	6.09	209,104.99	
WPP PLC	56,693	11.83	670,961.65	
JD SPORTS FASHION PLC	114,330	1.82	208,080.60	
KINGFISHER PLC	96,593	3.13	302,722.46	
NEXT PLC	6,143	71.42	438,733.06	
OCADO GROUP PLC	23,500	14.10	331,350.00	
SAINSBURY (J) PLC	82,018	2.87	236,129.82	
TESCO PLC	359,660	2.95	1,062,975.13	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	15,871	18.84	299,088.99	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	105,999	32.11	3,403,627.89	
COCA-COLA HBC AG-CDI	9,115	24.78	225,869.70	
DIAGEO	113,071	37.49	4,239,597.14	
IMPERIAL BRANDS PLC	45,617	17.44	795,560.48	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	35,301	58.10	2,050,988.10	
UNILEVER PLC	126,231	38.15	4,815,712.65	

	SMITH & NEPHEW PLC	42,096	12.47	524,937.12	
	ASTRAZENECA	74,467	82.82	6,167,356.94	
	GLAXOSMITHKLINE	243,607	16.35	3,982,974.45	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	8,586	20.05	172,149.30	
	BARCLAYS	811,088	2.00	1,627,042.52	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	987,703	5.45	5,382,981.35	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,308,712	0.51	1,700,016.22	
	NATWEST GROUP PLC	302,525	2.46	744,211.50	
	STANDARD CHARTERED PLC	124,429	5.55	690,580.95	
	3I GROUP PLC	45,010	13.52	608,760.25	
	ABRDN PLC	100,722	2.39	241,531.35	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,246	13.07	238,475.22	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	16,399	71.44	1,171,544.56	
	M&G PLC	118,170	2.13	252,529.29	
	SCHRODERS PLC	5,525	33.14	183,098.50	
	ST JAMES'S PLACE PLC	26,728	15.11	403,860.08	
	ADMIRAL GROUP PLC	9,872	29.59	292,112.48	
	AVIVA PIC	182,528	4.35	794,361.85	
	LEGAL & GENERAL GROUP	289,782	2.86	830,225.43	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	29,063	6.54	190,304.52	
	PRUDENTIAL	122,059	12.20	1,489,730.09	
	AVEVA GROUP PLC	4,523	28.93	130,850.39	
	SAGE GROUP PLC	48,541	7.11	345,223.59	
	HALMA PLC	17,484	24.32	425,210.88	
	BT GROUP PLC	413,941	1.92	796,629.45	
	VODAFONE GROUP PLC	1,374,547	1.34	1,844,916.98	
	NATIONAL GRID PLC	179,691	10.74	1,930,600.10	
	SEVERN TRENT PLC	11,927	28.32	337,772.64	
	SSE PLC	50,382	15.58	785,203.47	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	10.35	359,310.60	
イギリスポンド 小計		13,968,211		91,306,520.15 (14,242,904,078)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	8,748	19.60	171,504.54	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	310	933.50	289,385.00	
	GIVAUDAN-REG	454	3,732.00	1,694,328.00	
	HOLCIM LTD	24,228	50.02	1,211,884.56	
	SIKA AG-BR	6,975	311.50	2,172,712.50	
	ABB LTD	79,686	31.35	2,498,156.10	
	GEBERIT AG-REG	1,777	606.80	1,078,283.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	911	229.40	208,983.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,021	229.70	464,223.70	
	VAT GROUP AG	1,440	352.80	508,032.00	

	ADECCO GROUP AG-REG	6,959	44.61	310,440.99	
	SGS SA	277	2,608.00	722,416.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,730	255.30	696,969.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	25,653	130.55	3,348,999.15	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,285	264.80	340,268.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	51.35	154,255.40	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	149	2,124.00	316,476.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	108,000.00	540,000.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	55	10,620.00	584,100.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	136,031	119.10	16,201,292.10	
	ALCON INC	24,786	70.76	1,753,857.36	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,490	323.00	804,270.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	468	1,456.00	681,408.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	390	543.00	211,770.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,643	623.40	2,271,046.20	
	NOVARTIS	106,634	79.84	8,513,658.56	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,599	366.60	586,193.40	
	ROCHE HOLDING GENUSS	33,666	345.25	11,623,186.50	
	VIFOR PHARMA AG	2,126	163.15	346,856.90	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	129,034	8.80	1,135,757.26	
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,425	55.98	583,591.50	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,050	1,272.50	1,336,125.00	
	UBS GROUP AG	170,843	18.69	3,193,055.67	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	160.10	373,673.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,676	593.80	995,208.80	
	SWISS RE LTD	13,932	99.10	1,380,661.20	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,419	438.50	3,253,231.50	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,622	88.00	318,736.00	
	TEMENOS AG - REG	3,520	108.35	381,392.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,298	72.80	604,094.40	
	SWISSCOM	1,176	537.80	632,452.80	
スイスフラン 小計		831,829		74,492,936.49 (9,284,054,674)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	9,250	362.50	3,353,125.00	
	BOLIDEN AB	13,081	384.80	5,033,568.80	
	SCA SV CELLULOSA B	26,880	160.70	4,319,616.00	
	ALFA LAVAL AB	14,260	295.40	4,212,404.00	
	ASSA ABLOY AB-B	50,678	265.00	13,429,670.00	
	ATLAS COPCO A	33,072	527.00	17,428,944.00	
	ATLAS COPCO B	17,773	458.20	8,143,588.60	
	EPIROC AB-A	29,649	196.95	5,839,370.55	
	EPIROC AB-B	17,442	166.95	2,911,941.90	

	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	123.40	2,695,179.40	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,081	284.40	2,298,236.40	
	LIFCO AB-B SHS	13,590	211.40	2,872,926.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	65,860	86.18	5,675,814.80	
	SANDVIK AB	51,973	234.30	12,177,273.90	
	SKANSKA B	14,869	239.70	3,564,099.30	
	SKF AB-B	18,340	189.50	3,475,430.00	
	VOLVO AB-A SHS	8,748	207.40	1,814,335.20	
	VOLVO B	71,980	204.65	14,730,707.00	
	SECURITAS B	15,577	111.90	1,743,066.30	
	ELECTROLUX AB-SER B	12,053	186.00	2,241,858.00	
	EVOLUTION AB	7,849	1,068.60	8,387,441.40	
	EMBRACER GROUP AB	22,878	87.02	1,990,843.56	
	HENNES & MAURITZ B	33,524	170.74	5,723,887.76	
	SWEDISH MATCH AB	74,128	72.60	5,381,692.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	31,655	261.10	8,265,120.50	
	GETINGE AB-B SHS	12,650	368.40	4,660,260.00	
	NORDEA BANK ABP	161,977	108.84	17,629,576.68	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	74,165	118.00	8,751,470.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	70,420	98.68	6,949,045.60	
	SWEDBANK AB-A	40,897	168.78	6,902,595.66	
	EQT AB	15,478	350.20	5,420,395.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,848	279.80	1,916,070.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	275.60	2,378,703.60	
	INVESTOR AB-A SHS	23,000	210.00	4,830,000.00	
	INVESTOR AB-B SHS	90,842	198.30	18,013,968.60	
	KINNEVIK AB - B	10,757	247.05	2,657,516.85	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,093	458.90	1,878,277.70	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	5,413	600.00	3,247,800.00	
	SAGAX AB-B	9,400	260.80	2,451,520.00	
	SINCH AB	27,717	95.32	2,641,984.44	
	ERICSSON (LM) B	134,930	113.76	15,349,636.80	
	HEXAGON AB-B SHS	90,307	128.60	11,613,480.20	
	TELE2 AB-B SHS	24,520	136.80	3,354,336.00	
	TELIA CO AB	138,487	36.85	5,103,245.95	
スウェーデンクローナ 小計		1,635,563		273,460,025.25 (3,448,330,918)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	8,070	303.60	2,450,052.00	
	EQUINOR ASA	43,502	260.00	11,310,520.00	
	NORSK HYDRO	61,358	71.26	4,372,371.08	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,882	468.90	4,633,669.80	
	ADEVINTA ASA	16,857	91.06	1,534,998.42	

	SCHIBSTED ASA-B SHS	4,706	236.00	1,110,616.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	4,047	262.80	1,063,551.60	
	MOWI ASA	23,314	225.70	5,261,969.80	
	ORKLA	39,803	84.10	3,347,432.30	
	DNB BANK ASA	41,479	213.70	8,864,062.30	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	214.30	2,390,087.90	
	TELENOR ASA	30,180	137.45	4,148,241.00	
ノルウェークローネ 小計		294,351		50,487,572.20 (660,882,320)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,314	489.70	2,602,265.80	
	NOVOZYMES A/S	10,786	415.60	4,482,661.60	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	428	2,350.00	1,005,800.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	48,316	166.30	8,034,950.80	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	152	20,680.00	3,143,360.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	301	21,930.00	6,600,930.00	
	DSV A/S	10,182	1,324.00	13,480,968.00	
	PANDORA A/S	4,249	674.20	2,864,675.80	
	CARLSBERG AS-B	4,526	1,070.00	4,842,820.00	
	AMBU A/S-B	8,639	136.05	1,175,335.95	
	COLOPLAST-B	5,263	960.40	5,054,585.20	
	DEMANT A/S	4,463	286.50	1,278,649.50	
	GN STORE NORD A/S	6,740	388.00	2,615,120.00	
	GENMAB A/S	3,223	2,251.00	7,254,973.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	81,951	646.50	52,981,321.50	
	DANSKE BANK A/S	31,666	122.80	3,888,584.80	
	TRYG A/S	16,972	151.95	2,578,895.40	
	ORSTED A/S	9,594	680.00	6,523,920.00	
デンマーククローネ 小計		252,765		130,409,817.35 (2,312,166,061)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	12,821	30.37	389,373.77	
	SANTOS	153,046	7.45	1,140,192.70	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,345	27.36	283,039.20	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	48,027	26.27	1,261,669.29	
	BHP GROUP LTD	142,775	46.81	6,683,297.75	
	BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	19.16	412,878.84	
	EVOLUTION MINING LTD	88,310	3.64	321,448.40	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	78,225	21.34	1,669,321.50	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	20,170	47.64	960,898.80	
	NEWCREST MINING LIMITED	37,270	22.54	840,065.80	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	58,122	8.54	496,361.88	
	ORICA LTD	19,570	14.84	290,418.80	
	RIO TINTO LTD	17,196	114.61	1,970,833.56	

	SOUTH32 LTD	217,613	4.11	894,389.43	
	REECE LTD	12,870	20.56	264,607.20	
	BRAMBLES LTD	66,936	9.55	639,238.80	
	AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	3.66	342,590.64	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	39,948	5.19	207,330.12	
	TRANSURBAN GROUP	153,930	12.95	1,993,393.50	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	27,473	41.40	1,137,382.20	
	CROWN RESORTS LTD	18,801	12.47	234,448.47	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,685	104.06	279,401.10	
	IDP EDUCATION LTD	12,550	29.46	369,723.00	
	TABCORP HOLDINGS LTD	98,817	5.20	513,848.40	
	REA GROUP LTD	3,000	143.45	430,350.00	
	SEEK LTD	17,113	28.31	484,469.03	
	WESFARMERS LTD	56,329	53.72	3,025,993.88	
	COLES GROUP LTD	60,959	16.74	1,020,453.66	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	58,785	6.35	373,284.75	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	63,525	35.05	2,226,551.25	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	10.67	367,901.60	
	COCHLEAR LIMITED	3,460	194.71	673,696.60	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,641	64.55	622,326.55	
	SONIC HEALTHCARE LTD	20,560	38.36	788,681.60	
	CSL LIMITED	22,037	258.79	5,702,955.23	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	140,921	27.09	3,817,549.89	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	85,598	94.10	8,054,771.80	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	161,135	27.91	4,497,277.85	
	WESTPAC BANKING	178,990	21.52	3,851,864.80	
	ASX LTD	8,713	84.56	736,771.28	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	17,378	192.34	3,342,484.52	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	6,690	18.51	123,831.90	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	114,505	4.38	501,531.90	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	129,252	3.16	408,436.32	
	QBE INSURANCE GROUP	66,253	12.22	809,611.66	
	SUNCORP GROUP LIMITED	57,398	11.26	646,301.48	
	BLOCK INC - CDI	3,663	147.08	538,754.04	
	COMPUTERSHARE LIMITED	21,970	20.53	451,044.10	
	WISETECH GLOBAL LTD	6,445	43.64	281,259.80	
	XERO LTD	7,073	111.45	788,285.85	
	TELSTRA CORP	199,810	4.05	809,230.50	
	AUSNET SERVICES	80,543	2.59	208,606.37	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	87,883	5.90	518,509.70	
オーストラリアドル 小計		3,176,762		69,698,941.06 (5,680,463,696)	

ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	64,661	7.41	479,138.01	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	24,554	29.50	724,343.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,000	9.91	218,020.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	104,543	4.50	470,443.50	
	MERCURY NZ LTD	19,343	5.80	112,189.40	
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	4.79	306,722.86	
ニュージーランドドル 小計		299,135		2,310,856.77 (176,041,068)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	121,448	55.55	6,746,436.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	69,000	138.40	9,549,600.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	102,000	21.40	2,182,800.00	
	MTR CORP	82,500	42.90	3,539,250.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	81,000	29.45	2,385,450.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	97,000	46.00	4,462,000.00	
	SANDS CHINA LTD	127,000	22.35	2,838,450.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	89,600	13.98	1,252,608.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	83,000	21.60	1,792,800.00	
	WH GROUP LTD	446,619	5.15	2,300,087.85	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	161,500	31.10	5,022,650.00	
	HANG SENG BANK	33,600	159.20	5,349,120.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	58,600	442.60	25,936,360.00	
	AIA GROUP LTD	582,800	85.00	49,538,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	111,948	52.35	5,860,477.80	
	ESR CAYMAN LTD	92,400	26.65	2,462,460.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	115,000	16.78	1,929,700.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	79,761	35.00	2,791,635.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	76,250	32.35	2,466,687.50	
	SINO LAND CO	116,600	10.10	1,177,660.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	58,500	96.70	5,656,950.00	
	SWIRE PACIFIC A	20,000	47.90	958,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,000	21.55	1,486,950.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	81,000	37.85	3,065,850.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	48.65	1,556,800.00	
	CLP HOLDINGS	72,500	78.80	5,713,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	519,990	12.16	6,323,078.40	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	48.80	3,586,800.00	
香港ドル 小計		3,654,116		167,931,660.95 (2,485,388,582)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	80,200	5.90	473,180.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	3.73	279,004.00	
	SINGAPORE AIRLINES	54,650	5.10	278,715.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	0.75	239,775.00	

	WILMAR INTERNATIONAL LTD	81,700	4.37	357,029.00	
	DBS GROUP	89,600	35.95	3,221,120.00	
	OCBC BANK	171,350	12.80	2,193,280.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	53,600	31.30	1,677,680.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	9.40	399,500.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	118,900	3.51	417,339.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	7.14	157,080.00	
	UOL GROUP LIMITED	24,800	7.26	180,048.00	
	VENTURE CORP LTD	14,300	17.60	251,680.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	364,580	2.51	915,095.80	
シンガポールドル 小計		1,512,680		11,040,525.80 (945,952,250)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	28,484	30.30	863,065.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,248	538.00	671,424.00	
	BANK HAPOALIM BM	63,371	32.95	2,088,074.45	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,692	33.08	2,338,491.36	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,227	20.87	1,340,417.49	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,272	121.50	762,048.00	
	AZRIELI GROUP	1,471	280.80	413,056.80	
	NICE LTD	3,165	811.90	2,569,663.50	
イスラエルシェケル 小計		238,930		11,046,240.80 (397,296,828)	
合　計		52,000,988		301,134,233,782 (301,134,233,782)	

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	63,405	644,194.80	
		LENDLEASE GROUP	36,448	370,311.68	
		SYDNEY AIRPORT	64,383	560,775.93	
	オーストラリアドル 小計		164,236	1,575,282.41 (128,385,516)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	130,000	1,016,600.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	1,961,000.00	
	香港ドル 小計		315,000	2,977,600.00 (44,068,480)	
投資信託受益証券合計			479,236	172,453,996 (172,453,996)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	24,811	353,308.64	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,074	1,348,375.14	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	21,941	5,406,920.63	

	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	71,103	538,249.71	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,501	1,607,697.30	
	BOSTON PROPERTIES	6,840	770,868.00	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	5,093	846,660.32	
	CROWN CASTLE INTL CORP	21,001	3,786,480.30	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	14,046	2,038,917.36	
	DUKE REALTY CORP	17,311	998,498.48	
	EQUINIX INC	4,363	3,063,480.45	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,979	698,386.62	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	16,454	1,482,834.48	
	ESSEX PROPERTY TRUST	3,024	988,787.52	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	6,789	1,367,711.94	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	24,947	823,749.94	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,496	567,380.16	
	INVITATION HOMES INC	27,833	1,180,954.19	
	IRON MOUNTAIN INC	13,240	604,273.60	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	27,097	593,424.30	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,299	1,126,196.47	
	PROLOGIS INC	35,850	5,502,616.50	
	PUBLIC STORAGE	7,808	2,833,132.80	
	REALTY INCOME CORP	27,563	1,879,520.97	
	REGENCY CENTERS CORP	7,026	493,576.50	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5,181	1,665,950.55	
	SIMON PROPERTY GROUP	16,262	2,360,917.16	
	SUN COMMUNITIES INC	5,410	1,029,685.30	
	UDR INC	14,820	844,740.00	
	VENTAS INC	20,307	1,015,959.21	
	VICI PROPERTIES INC	29,321	825,092.94	
	VORNADO REALTY TRUST	7,639	309,761.45	
	WELLTOWER INC	21,176	1,703,185.68	
	WP CAREY INC	8,887	670,790.76	
アメリカドル 小計		573,492	51,328,085.37 (5,916,075,119)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,069	283,255.72	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	202,514.80	
カナダドル 小計		14,014	485,770.52 (43,913,655)	
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	—	
	COVIVIO(FP)	3,076	220,795.28	
	GECINA SA	1,966	221,273.30	
	KLEPIERRE	8,356	188,177.12	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,185	388,232.45	

	ユーロ 小計		1,625,167	1,018,478.15 (134,418,746)	
	イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	39,175	210,526.45	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	255,449.40	
		SEGRO PLC	55,104	700,096.32	
	イギリスポンド 小計		126,411	1,166,072.17 (181,895,597)	
	オーストラリアドル	DEXUS	49,283	504,165.09	
		GOODMAN GROUP	76,627	1,819,124.98	
		GPT GROUP	85,529	425,934.42	
		MIRVAC GROUP	176,235	458,211.00	
		SCENTRE GROUP	234,255	693,394.80	
		STOCKLAND	121,481	495,642.48	
		VICINITY CENTERS	163,023	268,172.83	
	オーストラリアドル 小計		906,433	4,664,645.60 (380,168,616)	
	香港ドル	LINK REIT	107,800	7,227,990.00	
	香港ドル 小計		107,800	7,227,990.00 (106,974,252)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	135,809	378,907.11	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	214,690	444,408.30	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	132,200	240,604.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	174,778	300,618.16	
	シンガポールドル 小計		657,477	1,364,537.57 (116,913,578)	
投資証券合計			4,010,794	6,880,359,563 (6,880,359,563)	
合計				7,052,813,559 (7,052,813,559)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式　609銘柄	97.4%	—	—	71.3%
	投資証券　34銘柄	—	—	2.6%	1.9%

カナダドル	株式　87銘柄	99.6%	—	—	3.6%
	投資証券　2銘柄	—	—	0.4%	0.0%
ユーロ	株式　229銘柄	99.6%	—	—	9.9%
	投資証券　5銘柄	—	—	0.4%	0.0%
イギリスポンド	株式　80銘柄	98.7%	—	—	4.6%
	投資証券　3銘柄	—	—	1.3%	0.1%
スイスフラン	株式　41銘柄	100.0%	—	—	3.0%
スウェーデンクローナ	株式　44銘柄	100.0%	—	—	1.1%
ノルウェークローネ	株式　12銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式　18銘柄	100.0%	—	—	0.8%
オーストラリアドル	株式　53銘柄	91.8%	—	—	1.8%
	投資信託受益証券　3銘柄	—	2.1%	—	0.0%
	投資証券　7銘柄	—	—	6.1%	0.1%
ニュージーランドドル	株式　6銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式　28銘柄	94.3%	—	—	0.8%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.7%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	4.1%	0.0%
シンガポールドル	株式　14銘柄	89.0%	—	—	0.3%
	投資証券　4銘柄	—	—	11.0%	0.0%
イスラエルシェケル	株式　8銘柄	100.0%	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第21期中間計算期間(2022年2月8日から2022年8月7日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【ＤＣ外国株式インデックスファンド】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第20期 （2022年 2月 7日現在）	第21期中間計算期間 （2022年 8月 7日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	124,352,811	135,427,765
親投資信託受益証券	20,731,525,024	22,764,855,774
未収入金	4,680,921	21,155,239
流動資産合計	20,860,558,756	22,921,438,778
資産合計	20,860,558,756	22,921,438,778
負債の部		
流動負債		
未払解約金	28,746,533	47,684,843
未払受託者報酬	7,872,458	8,238,261
未払委託者報酬	82,098,366	85,913,271
未払利息	178	159
流動負債合計	118,717,535	141,836,534
負債合計	118,717,535	141,836,534
純資産の部		
元本等		
元本	5,754,413,017	6,013,672,329
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	14,987,428,204	16,765,929,915
（分配準備積立金）	7,866,129,301	7,325,646,432
元本等合計	20,741,841,221	22,779,602,244
純資産合計	20,741,841,221	22,779,602,244
負債純資産合計	20,860,558,756	22,921,438,778

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第20期中間計算期間 自　2021年 2月 9日 至　2021年 8月 8日	第21期中間計算期間 自　2022年 2月 8日 至　2022年 8月 7日
営業収益		
受取利息	78	227
有価証券売買等損益	3,005,559,777	1,192,300,429
営業収益合計	3,005,559,855	1,192,300,656
営業費用		
支払利息	13,183	10,526
受託者報酬	6,780,253	8,238,261
委託者報酬	70,708,337	85,913,271
営業費用合計	77,501,773	94,162,058
営業利益又は営業損失（△）	2,928,058,082	1,098,138,598
経常利益又は経常損失（△）	2,928,058,082	1,098,138,598
中間純利益又は中間純損失（△）	2,928,058,082	1,098,138,598
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	146,575,141	23,745,739
期首剰余金又は期首欠損金（△）	10,641,578,646	14,987,428,204
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,500,008,277	1,801,672,834
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,500,008,277	1,801,672,834
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,165,968,820	1,097,563,982
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,165,968,820	1,097,563,982
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	13,757,101,044	16,765,929,915

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

	第20期 (2022年 2月 7日現在)	第21期中間計算期間 (2022年 8月 7日現在)
１．計算期間の末日における受益権の総数	5,754,413,017口	6,013,672,329口
２．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.6045円 (1万口当たり純資産額) (36,045円)	1口当たり純資産額 3.7880円 (1万口当たり純資産額) (37,880円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	第21期中間計算期間 (2022年 8月 7日現在)
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	第20期 自 2021年 2月 9日 至 2022年 2月 7日	第21期中間計算期間 自 2022年 2月 8日 至 2022年 8月 7日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	5,512,784,596円	5,754,413,017円
期中追加設定元本額	1,316,623,173円	681,401,701円
期中一部解約元本額	1,074,994,752円	422,142,389円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。
なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	2022年 8月 7日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	12,463,897,639
コール・ローン	1,211,461,888
株式	322,408,037,842
投資信託受益証券	154,303,342
投資証券	7,926,731,551
派生商品評価勘定	1,276,513,251
未収入金	146,731
未収配当金	246,607,744
差入委託証拠金	3,223,530,013
流動資産合計	348,911,230,001

	2022年 8月 7日現在
項目	金額（円）
資産合計	348,911,230,001
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	24,795,983
前受金	1,275,930,044
未払解約金	95,912,025
未払利息	474
流動負債合計	1,396,638,526
負債合計	1,396,638,526
純資産の部	
元本等	
元本	75,005,118,168
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	272,509,473,307
元本等合計	347,514,591,475
純資産合計	347,514,591,475
負債純資産合計	348,911,230,001

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 8月 7日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。

	2022年 8月 7日現在
	(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 8月 7日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	75,005,118,168口
2.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 4.6332円 (1万口当たり純資産額) (46,332円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2022年 8月 7日現在
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 8月 7日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 2月 8日
期首元本額	72,792,232,380円
期中追加設定元本額	5,097,050,167円
期中一部解約元本額	2,884,164,379円
期末元本額	75,005,118,168円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,501,677,077円
ＤＣ外国株式インデックスファンド	4,913,419,618円
ＤＣ外国株式インデックスファンドＬ	26,708,229,809円

区分	2022年 8月 7日現在
ＤＣバランスファンド３０	626,447,115円
ＤＣバランスファンド５０	1,279,696,452円
ＤＣバランスファンド７０	853,145,622円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	281,349,065円
外国株式インデックスｅ	4,640,614,335円
インデックスコレクション（外国株式）	15,593,060,405円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	3,244,855,415円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	1,001,085,584円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	998,026,196円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,180,102,914円
外国株式パッシブファンド私募Ａ（適格機関投資家専用）	1,454,751,759円
私募外国株式パッシブファンド２（適格機関投資家専用）	121,213,297円
外国株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	411,859,570円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	24,271,476円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	251,152,091円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	32,412,865円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	64,365,416円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	209,757,827円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	225,016,168円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	177,326,240円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	3,492,812,024円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	394,559,481円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	98,989,093円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	582,628,105円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	12,273,554円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	69,779,553円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	77,106,007円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	236,619,272円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	10,056,249円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	59,800,815円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	171,614,304円
私募外国株式インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	5,043,395円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 8月 7日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	15,479,586,575	－	16,755,516,619	1,275,930,044

合計	15,479,586,575	－	16,755,516,619	1,275,930,044

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2022年 8月 7日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,121,298,002	－	1,097,083,071	△24,214,931
	アメリカドル	879,123,092	－	856,904,569	△22,218,523
	ユーロ	164,905,560	－	163,320,720	△1,584,840
	イギリスポンド	63,362,250	－	62,935,872	△426,378
	スイスフラン	13,907,100	－	13,921,910	14,810
	売建	220,600,254	－	220,598,099	2,155
	アメリカドル	119,685,060	－	119,684,250	810
	ユーロ	31,304,794	－	31,304,449	345
	スイスフラン	69,610,400	－	69,609,400	1,000
合計		1,341,898,256	－	1,317,681,170	△24,212,776

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

2【ファンドの現況】

【ＤＣ外国株式インデックスファンド】

【純資産額計算書】

（2022年 8月31日現在）

Ⅰ　資産総額	22,836,092,817円
Ⅱ　負債総額	25,732,992円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	22,810,359,825円
Ⅳ　発行済口数	6,030,785,913口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.7823円
（1万口当たり純資産額）	（37,823円）

（参考）

外国株式マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 8月31日現在）

Ⅰ　資産総額	347,345,249,899円
Ⅱ　負債総額	661,197,366円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	346,684,052,533円
Ⅳ　発行済口数	74,895,844,307口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.6289円
（1万口当たり純資産額）	（46,289円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行し

ません。

②受益権の譲渡

イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

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

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

③受益権の譲渡の対抗要件

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

④受益権の再分割

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

⑤償還金

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

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2022年 8月31日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数　：12,000株
発行済株式総数　　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

会社に取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。
取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。
また、監査等委員以外の取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席し、その議決権の３分の２以上をもって行います。
取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。
監査等委員である取締役の任期は、選任後２年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。
取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長１名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。
取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。
取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。
取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

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

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

［DO（実行）］

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

［CHECK（検証・評価）］

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

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

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

委託会社の機構は2022年11月 7日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

2022年8月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	539	14,041,250
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	70	221,703
単位型公社債投資信託	51	216,636
合計	660	14,479,589

3【委託会社等の経理状況】

(1)　委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

（2）【損益計算書】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

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

（3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		

当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					
剰余金の配当	194		△3,857	△3,662	△3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	－	3,136	3,330	3,330
当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

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

当事業年度（自　2021年4月1日　至　2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			△2,797	△2,797	△2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	－	－	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	

当期首残高	791	△65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				△2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	149	△444	△295	△295
当期変動額合計	149	△444	△295	3,394
当期末残高	941	△509	431	64,219

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

２．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

３．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

４．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

（2）無形固定資産

定額法によっております。

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

５．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

６．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

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

（2）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用　　：発生事業年度に損益処理

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

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

７．収益及び費用の計上基準

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

（1）投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応

じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

（2）投資一任業務

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

（3）投資助言業務

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

（4）成功報酬

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

８．ヘッジ会計の会計処理

（1）ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

（2）ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

（3）ヘッジ方針

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

（4）ヘッジ有効性評価の方法

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

９．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

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

（会計方針の変更）

１．「収益認識に関する会計基準」等の適用

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号　2020年3月31日）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

２．「時価の算定に関する会計基準」等の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号　2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号　2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

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

（未適用の会計基準等）

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

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

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

（追加情報）

退職給付債務及び費用の算定方法の変更

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

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

（貸借対照表関係）

※1有形固定資産の減価償却累計額

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2020年4月1日　至 2021年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 2021年4月1日　至 2022年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

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

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

2022年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	利益剰余金	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

（リース取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。

これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針８．ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

２.金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31 号 2019年7月4日。以下、「時価算定適用指針」という。）第26 項に従い経過措置を適用した投資信託、市場価格のない株式等及び、時価算定適用指針第27項に従い経過措置を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）*2、*3及び（注2）参照）。

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

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

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

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

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

（１）時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）（*1）
金銭の信託	10,857
投資有価証券	
その他有価証券	9,950
デリバティブ取引（*2）	
ヘッジ会計が適用されていないもの	(357)
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)
デリバティブ取引計	(431)

(*1) 負債に計上されているものについては、（　　）で示しております。
(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度（2022年3月31日）

区　分	貸借対照表計上額（百万円）(*1、*2)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*3)	－	196	－	196
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(1,333)	(80)	－	(1,413)
ヘッジ会計が適用されているもの	－	(71)	－	(71)
デリバティブ取引計	(1,333)	(151)	－	(1,485)

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
(*2) 投資有価証券のうち、投資信託（貸借対照表計上額6,474百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額133百万円）は上記に含めておりません。
(*3) 金銭の信託の信託財産のうち、投資信託（貸借対照表計上額13,876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額840百万円）は上記に含めておりません。これらも含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,913百万円であります。
(*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

（２）時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位:百万円）

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

（注3） 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2021年3月31日）　　（単位:百万円）

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

当事業年度（2022年3月31日）　　（単位:百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,675	－	－	－
未収委託者報酬	9,067	－	－	－
未収運用受託報酬	6,252	－	－	－
投資有価証券				
投資信託	－	108	1,712	0

（有価証券関係）

１．子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位:百万円）

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

２．その他有価証券

前事業年度（2021年3月31日）　　（単位:百万円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9	10	△1
小計	9	10	△1
合計	9,950	8,809	1,141

当事業年度（2022年3月31日）　　（単位：百万円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,888	3,403	1,485
小計	4,888	3,403	1,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,585	1,711	△126
小計	1,585	1,711	△126
合計	6,474	5,115	1,358

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

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位:百万円）

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

３．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）　（単位:百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	109	1	0

当事業年度（自　2021年4月1日　至　2022年3月31日）　（単位:百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2021年3月31日）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

（2）株式関連

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

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

当事業年度（2022年3月31日）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち1年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	5,498	－	△54	△54
	英ポンド	277	－	△1	△1
	カナダドル	111	－	△1	△1
	スイスフラン	139	－	△2	△2
	香港ドル	190	－	△1	△1
	ユーロ	676	－	△18	△18
	買建				
	ユーロ	21	－	0	0
合計		6,915	－	△80	△80

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

（2）株式関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち1年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	17,197	－	△1,333	△1,333
合計		17,197	－	△1,333	△1,333

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等（百万円）	契約額等のうち1年超（百万円）	時価（百万円）

原則的処理方法	為替予約取引 売建 米ドル	投資有価証券 関係会社株式	4,422	－	△43
	英ポンド		3,297	－	△21
	スイスフラン		79	－	△1
	香港ドル		119	－	△1
	ユーロ		125	－	△3
	人民元		13	－	△0
合計			8,057	－	△71

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。当社が有する退職一時金制度は従来簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しておりましたが、当事業年度より原則法と簡便法の併用により、これら計算を行っております。

2．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

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

（単位：百万円）

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

（単位：百万円）

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

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

(5) 年金資産に関する事項
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

3．確定拠出制度
当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度92百万円、当事業年度100百万円であります。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（収益認識関係）

1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

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

3．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

［関連情報］

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2020年4月1日　至 2021年3月31日）

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

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

当事業年度（自 2021年4月1日　至 2022年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,395百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395百万円

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,365	未収運用受託報酬	5,402
							投信販売代行手数料等	9,124	未払手数料	1,888

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 運用受託報酬

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

② 投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 運用受託報酬

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

② 投信販売代行手数料等

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

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2021年3月31日）

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

当事業年度（2022年3月31日）

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

（１株当たり情報）

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

1株当たり純資産額	20,274,967円09銭	21,406,512円22銭
1株当たり当期純利益金額	2,331,221円85銭	2,162,405円20銭

（注）１．潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
２．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）	当事業年度 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）
当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株主に帰属しない金額	－	－
普通株式に係る当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

４【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2022年11月 7日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2022年3月末日現在）

③事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2022年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社みずほ銀行	1,404,065	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社北陸銀行	140,409	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

２【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

３【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

①名称　　：株式会社日本カストディ銀行
②設立年月日　：2000年6月20日
③資本金の額　：51,000百万円（2022年3月末日現在）
④事業の内容　：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第３【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。
(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。
①ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
②本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
③交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。
④ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
(7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
(8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
(9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
(10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2022年６月２日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　三　上　和　彦
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　藤　澤　　孝

監査意見
　当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年４月１日から2022年３月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

　当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
　その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。
　当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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

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

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年4月7日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　後藤知弘　　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＣ外国株式インデックスファンドの2021年2月9日から2022年2月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣ外国株式インデックスファンドの2022年2月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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

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

以　上

（注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年10月18日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　後藤知弘　印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＣ外国株式インデックスファンドの2022年2月8日から2022年8月7日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ＤＣ外国株式インデックスファンドの2022年8月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年2月8日から2022年8月7日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- **不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。**
- **中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。**

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

利害関係

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

以　上

（注）１．上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。