

【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】	2023年3月24日提出
【発行者名】	三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 横川 直
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【電話番号】	03-6250-4740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン（ラップ向け）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【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】

ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン（ラップ向け）（「ファンド」といいます。）

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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また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。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関およ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、「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載また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。）。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】

1兆円を上限とします。

（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。

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

（注）基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。

なお、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。

（5）【申込手数料】

ありません。

（6）【申込単位】

販売会社が定める単位

申込単位は販売会社にご確認ください。

（7）【申込期間】

2023年 3月25日から2023年 9月25日まで

申込期間は、前記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新される予定です。

（8）【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：営業日の9:00～17:00）

（9）【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。
各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

（10）【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

（11）【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

（12）【その他】

当ファンドは、ラップ口座に係る契約に基づいてラップ口座の資金を運用するためのファンドであり、当ファンドの取得申込者は、販売会社にラップ口座を開設のうえ申込みを行うものとします。

同様の権利義務関係を規定する契約の名称は販売会社によって異なります。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

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

信託金の限度額は、5,000億円です。

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

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

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式	年1回	グローバル (日本を除く)	ファミリー ファンド	あり (フルヘッジ)	日経225	ブル・ベア型
一般	年2回					
大型株	年4回	日本				
中小型株	年6回 (隔月)	北米				
債券	年12回 (毎月)	欧州				
一般		アジア				
公債		オセアニア				
社債		中南米				
その他債券		アフリカ				
クレジット		中近東 (中東)				
属性 ()		エマージング				
不動産投信						
その他資産 (投資信託証券(株式一般))						
資産複合 ()						

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

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

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

商品分類の定義

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

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

属性区分の定義

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

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

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

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

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

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

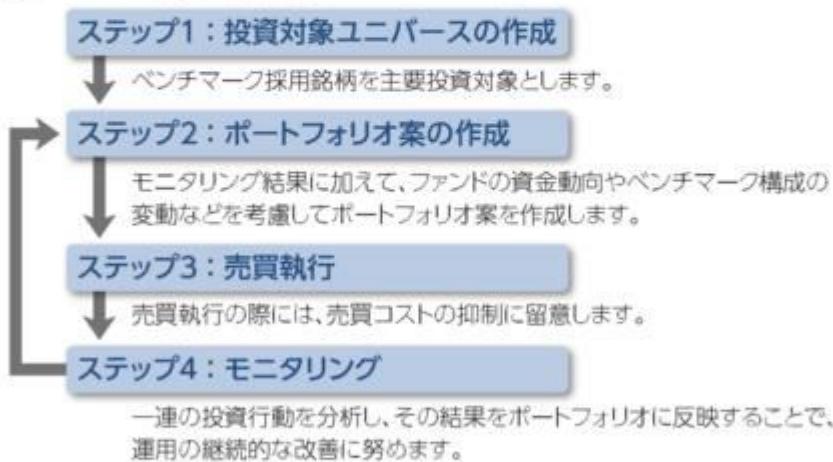
ファンドの特色

特色1

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

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

<運用プロセスのイメージ>



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

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

特色2

主として日本を除く先進国の株式に投資を行います。

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

※実際の運用はヘッジ付外国株式インデックスマザーファンドを通じて行います。

特色3

原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をはかります。

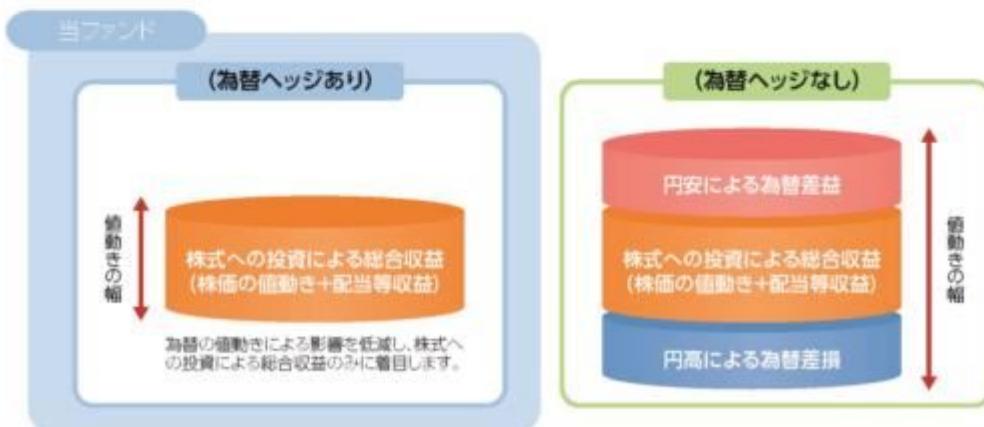
- 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をはかります。

為替ヘッジの活用

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

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

<投資リターンのイメージ>



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

特色4

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

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

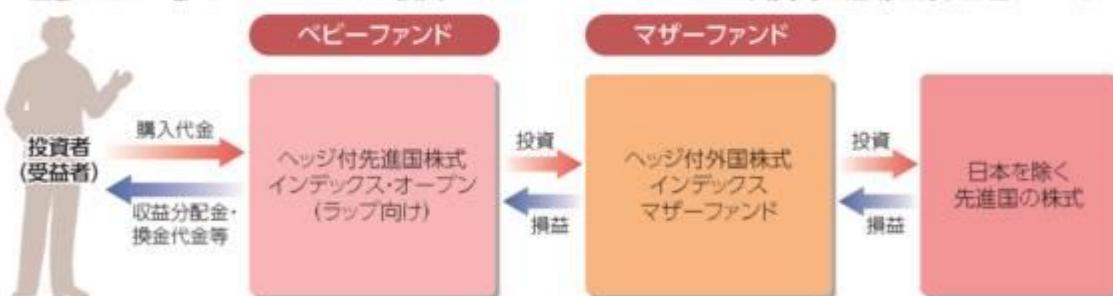
分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ファンドの仕組み

ファミリーファンド方式により運用を行います。

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



■主な投資制限

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

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

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

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

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（2）【ファンドの沿革】

2022年1月27日 設定日、信託契約締結、運用開始

（3）【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割

投資家（受益者）

お申込金 収益分配金、解約代金等

販売会社	募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。
------	--

お申込金 収益分配金、解約代金等

受託会社(受託者) 三菱UFJ信託銀行株式会社 (再信託受託会社:日本マスタートラスト 信託銀行株式会社)	委託会社(委託者) 三菱UFJ国際投信株式会社
信託財産の保管・管理等を行います。	信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。
投資 損益	
マザーファンド	
投資 損益	
有価証券等	

委託会社と関係法人との契約の概要

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

委託会社の概況(2022年12月末現在)

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

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く先進国の株式に直接投資することができます。
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を除く先進国の株式に投資を行います。

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款に定める次のものに限ります。)

ア. 有価証券先物取引等

ブ. スワップ取引

ハ. 約束手形

二. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券(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。)は、三菱UFJ国際投信株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社とするヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド(「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。)の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

1. 株券または新株引受権証書

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. 資産の流動化に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)

8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)

9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)

10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。)

11. コマーシャル・ペーパー

12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券

13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.から12.の証券または証書の性質を有するもの

14. 投資信託また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ます。)

15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16.において同じ。)で16.で定めるもの以外のもの

16. 投資法人債券(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。以下16.において同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

17. 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。)
18. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
19. 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。)
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの
23. 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。)

なお、1.の証券または証書ならびに13.および19.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに16.の証券ならびに13.および19.の証券または証書のうち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、14.および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品(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。)は、次に掲げるものとします。

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号で定め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5.の権利の性質を有するもの
7. 信託の受益権(金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、1.から6.に該当するものを除きます。)
8. 外国の者に対する権利で7.の権利の性質を有するもの
9. 合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権(金融商品取引法第2条第2項第3号で定めるものをいいます。)
10. 外国法人の社員権で9.の権利の性質を有するもの
11. 投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利(金融商品取引法第2条第2項第5号で定めるものをいいます。)
12. 外国の法令に基づく権利であって、11.の権利に類するもの

その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

<ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンドの概要>

(基本方針)

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

(運用方法)

投資対象

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ヘッジ・円ベース)に採用されている株式を主要投資対象とします。

投資態度

主として対象インデックスに採用されている株式に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。

投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

- ・株式の実質投資比率(組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

- ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。
- ・組入外貨建資産については、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、為替ヘッジ比率を引き下げる、あるいは為替ヘッジ比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

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

(投資制限)

株式への投資割合に制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

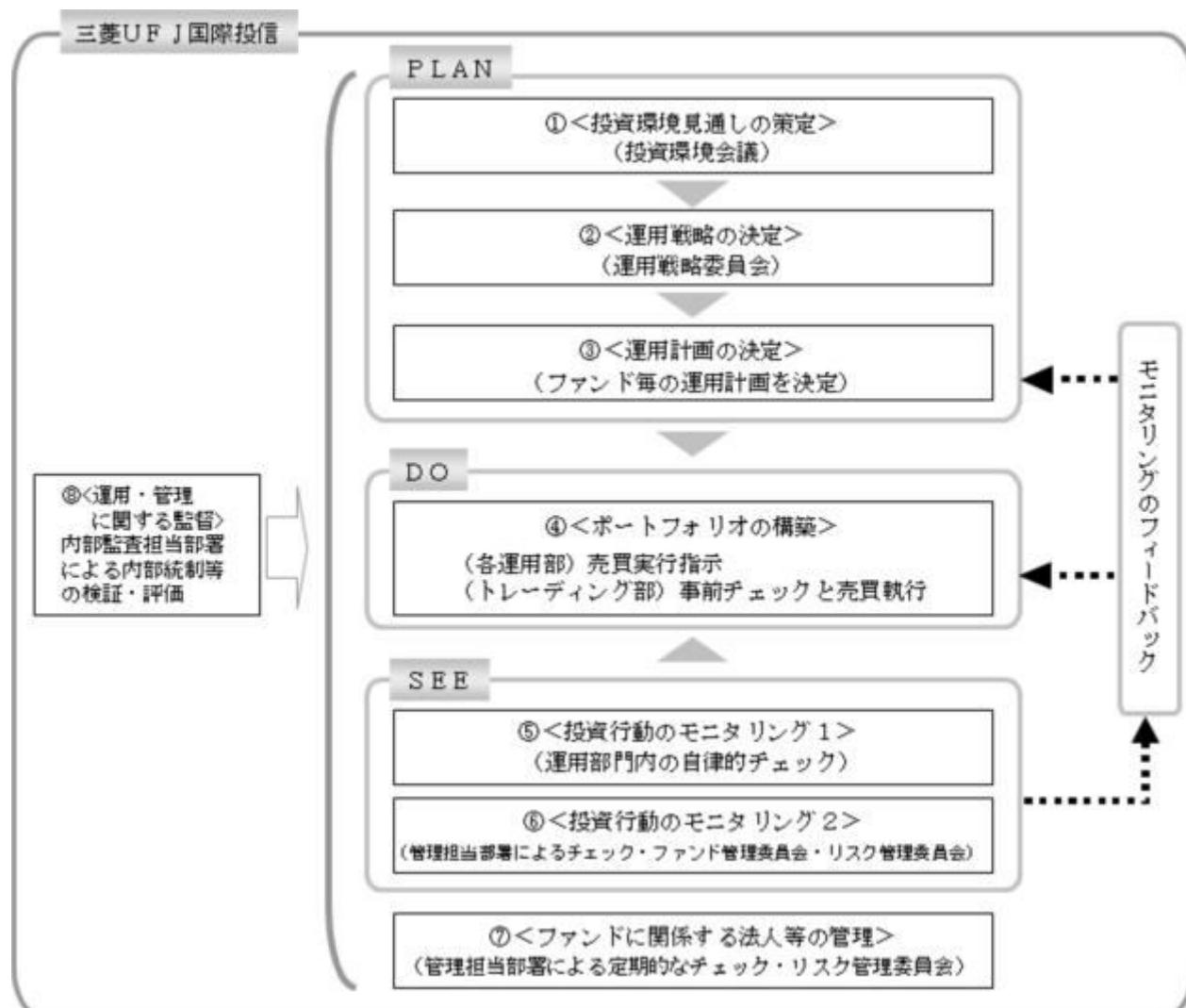
スワップ取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

(3)【運用体制】



投資環境見通しの策定

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

投資行動のモニタリング 1

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

投資行動のモニタリング 2

運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、ファンド管理委員会およびリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

ファンドに係る法人等の管理

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

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（10名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

なお、委託会社に関する「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページでご覧いただけます。

「運用担当者に係る事項」 <https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>

(4) 【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

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

収益の分配にあてなかった利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(5) 【投資制限】**<信託約款に定められた投資制限>****新株引受権証券および新株予約権証券**

- a . 委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
- b . a . において信託財産に属するとみなした額とは、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新株引受権証券および新

株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

投資信託証券

- a . 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券（金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券をいいます。）を除きます。以下a . およびb . において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- b . a . において信託財産に属するとみなした額とは、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投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

同一銘柄の転換社債等

- a . 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債（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ならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- b . a . において信託財産に属するとみなした額とは、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転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

スワップ取引

- a . 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、異なった通貨、異なった受取金利または異なる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。）を行うことの指図をすることができます。
- b . 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。
- c . スワップ取引の評価は、原則として、当該取引契約の相手方が提示する価額または価格情報会社の提供する価額によるものとします。
- d . 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。

信用取引

- a . 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り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- b . a . の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - 1 . 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
 - 2 . 株式分割により取得する株券
 - 3 . 有償増資により取得する株券
 - 4 . 売出しにより取得する株券
 - 5 . 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（ に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
 - 6 . 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（ 5 . に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

外国為替予約取引

- a . 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。
- b . a . 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時価総額のうち信託

財産に属するとみなした額を含みます。)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。

- c . b .において信託財産に属するとみなした額とは、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とします。
- d . b .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。

公社債の借入れ

- a . 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。
- b . a .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。
- c . 信託財産の一部解約等の事由により、b .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り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。

資金の借入れ

- a . 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、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り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、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。
- b . 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等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から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、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c . 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。

投資する株式等の範囲

- a . 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。
- b . a .の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができます。

有価証券の貸付

- a . 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および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
 - 1 . 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - 2 . 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、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。
- b . a .に規定す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。
- c . 委託会社は、有価証券の貸付にあたって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。

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、制限されることがあります。

デリバティブ取引等

デリバティブ取引等(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。)については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、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ないこととします。

信用リスクの分散規制

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポートジャー、債券等エクスポートジャーおよびデリバティブ等エクスポート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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、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。

<その他法令等に定められた投資制限>

- 同一の法人の発行する株式への投資制限

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すべ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の率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) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

(主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。)

価格変動 リスク

株式の価格は、株式市場全体の動向のほか、発行企業の業績や業績に対する市場の見通しなどの影響を受けて変動します。組入株式の価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

為替変動 リスク

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

信用リスク

株式の発行企業の経営、財務状況が悪化したり、市場においてその懸念が高まった場合には、株式の価格が下落すること、配当金が減額あるいは支払いが停止されること、倒産等によりその価値がなくなることがあります。

流動性 リスク

株式を売買しようとする際に、その株式の取引量が十分でない場合や規制等により取引が制限されている場合には、売買が成立しなかったり、十分な数量の売買が出来なかったり、ファンドの売買自体によって市場価格が動き、結果として不利な価格での取引となる場合があります。

留意事項

- ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリングオフ)の適用はありません。
- ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てる必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これ

により、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。

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

収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。

・ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響する場合があります。

・ファンドは、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動することをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、株価指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因によりカイ離を生じることがあります。

（2）投資リスクに対する管理体制

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

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

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

トレーディング担当部署

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

コンプライアンス担当部署

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

リスク管理担当部署

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

内部監査担当部署

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

*組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

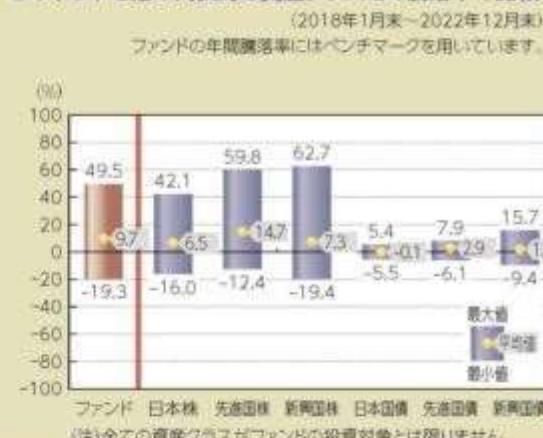
■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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

● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移



● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- ・基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものとして計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- ・年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。

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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

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

(注)海外の指數は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

申込手数料の対価として提供する役務の内容は、ファンドおよび投資環境の説明・情報提供、購入に関する事務手続等です。

(2) 【換金（解約）手数料】

かかりません。

換金（解約）手数料の対価として提供する役務の内容は、商品の換金に関する事務手続等です。

(3) 【信託報酬等】

・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年0.1023%（税抜0.093%）以内の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

1万口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額×信託報酬率×（保有日数／365）
上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

・信託報酬は、毎計算期間の6カ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

・信託報酬率ならびに各支払先への配分は、以下の通りです。

ファンドの純資産総額に応じて	信託報酬率 (税込 年率)	配分（税抜 年率）			
		合計	委託会社	販売会社	受託会社
500億円未満の部分	0.102300%	0.09300%	0.05300%	0.01%	0.03%
500億円以上 1,000億円未満の部分	0.100595%	0.09145%	0.05145%	0.01%	0.03%
1,000億円以上の部分	0.098890%	0.08990%	0.04990%	0.01%	0.03%

上記各支払先への配分には、別途消費税等相当額がかかります。

各支払先が信託報酬の対価として提供する役務の内容は以下の通りです。

支払先	対価として提供する役務の内容
委託会社	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出等
販売会社	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

(4) 【その他の手数料等】

委託会社は、信託財産に係る以下の費用（当該費用に係る消費税等相当額を含みます。）について毎計算期間の6カ月終了日、および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁することができるものとします。委託会社は以下の費用の支払いを信託財産のために行い、支払金額の支弁を信託財産から受けることができ、また、現に信託財産のために支払った金額の支弁を受ける際に、あらかじめ受領する金額に上限を付することができます。この場合において、委託会社は、信託財産の規模等を考慮して、係る上限額を信託期間中に見直すことができます。

前記に基づいて実際に支払った金額の支弁を受ける代わりに、委託会社は、係る費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、実際の費用額にかかわらず合理的な見積率により計算した金額を係る費用の金額とみなして、その支弁を信託財産から受けることもできます。この場合において、委託会社は、係る見積率に上限を付することとし、その上限の範囲内で、係る見積率を信託期間中に見直すことができるものとします。

委託会社は、上記いずれの方法を用いるかについて、信託期間中に見直すことができます。

1. 法律顧問・税務顧問への報酬
 2. 受益権の管理事務に関連する費用等
 3. 有価証券届出書、有価証券報告書、半期報告書および臨時報告書(これらの訂正に係る書類を含みます。)の作成および届出または提出に係る費用
 4. 目論見書(訂正事項分を含みます。)の作成、印刷および交付に係る費用
 5. 受益者に対する公告に係る費用、ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用
 6. 運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用
- ・信託財産に係る監査費用(当該監査費用に係る消費税等相当額を含みます。)の金額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。
- ・上記1. ~ 6. の費用および信託財産に係る監査費用の金額については、日々の純資産総額に以下の率を乗じて得た額を上限とします。
- | | |
|-----|----------------------------|
| 上限率 | 純資産総額に対して年率0.11% (税抜0.10%) |
|-----|----------------------------|

信託財産に関する以下の費用・報酬およびそれに付随する消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払います。

1. 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用(に該当する部分を除きます。)、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
2. 信託財産(投資している投資信託を含みます。)の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等(消費税等相当額を含みます。)、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

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

(注)手数料等については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。なお、ファンドが負担する費用(手数料等)の支払い実績は、交付運用報告書に開示されていますのでご参照ください。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

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

1. 収益分配金の課税

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

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

2. 解約時および償還時の課税

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

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

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

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

通算が可能となる仕組みがあります。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

個別元本について

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

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

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

収益分配金について

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

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

上記は2022年12月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5 【運用状況】

【ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン（ラップ向け）】

（1）【投資状況】

令和4年12月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国 / 地域	時価合計	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	1,114,002,433	100.00
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		51,754	0.00
純資産総額		1,114,054,187	100.00

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

令和4年12月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	486,187,943	2.3153	1,125,711,324	2.2913	1,114,002,433	100.00

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和4年12月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和4年12月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位:円)

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末日 (令和4年6月27日)	271,694,777	271,694,777	8,970	8,970
令和4年1月末日	1,014,065		10,141	
2月末日	1,005,048		10,050	
3月末日	1,049,975		10,500	
4月末日	14,887,958		9,621	

5月末日	107,919,305	9,599	
6月末日	290,593,678	8,802	
7月末日	519,936,431	9,272	
8月末日	600,472,060	9,091	
9月末日	698,852,023	8,291	
10月末日	908,424,545	8,841	
11月末日	1,018,150,300	9,043	
12月末日	1,114,054,187	8,807	

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	10.30
第2中間計算期間	2.04

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

(4)【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	302,884,425		302,884,425
第2中間計算期間	961,560,809	2,072,554	1,262,372,680

(参考)

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

令和4年12月30日現在
(単位:円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率(%)
株式	アメリカ	11,304,238,910	63.73
	イギリス	742,355,182	4.19
	カナダ	580,383,450	3.27

フランス	518,270,155	2.92	
スイス	495,822,554	2.80	
ドイツ	396,183,163	2.23	
オーストラリア	363,061,521	2.05	
オランダ	278,367,792	1.57	
スウェーデン	162,935,810	0.92	
デンマーク	145,226,681	0.82	
香港	134,011,819	0.76	
スペイン	121,591,699	0.69	
イタリア	85,122,043	0.48	
シンガポール	58,231,365	0.33	
フィンランド	48,607,741	0.27	
ベルギー	41,400,118	0.23	
ノルウェー	36,380,502	0.21	
アイルランド	32,565,385	0.18	
イスラエル	21,433,773	0.12	
ルクセンブルグ	11,093,750	0.06	
オーストリア	10,924,796	0.06	
ポルトガル	8,741,080	0.05	
ニュージーランド	7,875,168	0.04	
小計	15,604,824,457	87.97	
投資証券			
アメリカ	319,831,165	1.80	
オーストラリア	19,662,211	0.11	
イギリス	6,908,963	0.04	
シンガポール	6,396,188	0.04	
フランス	5,911,307	0.03	
香港	5,220,374	0.03	
ベルギー	1,563,051	0.01	
カナダ	1,248,684	0.01	
小計	366,741,943	2.07	
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		1,766,723,090	9.96
純資産総額		17,738,289,490	100.00

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

その他の資産の投資状況

令和4年12月30日現在
(単位:円)

資産の種類	建別	国 / 地域	時価合計	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	796,360,898	4.49
	買建	カナダ	46,149,261	0.26

買建	ドイツ	147,172,655	0.83
買建	オーストラリア	46,762,257	0.26
買建	イギリス	48,012,800	0.27
買建	スイス	46,463,955	0.26

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

令和4年12月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	41,278	19,430.19	802,039,484	17,199.24	709,950,518	4.00
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	18,218	34,465.68	627,895,840	31,982.02	582,648,568	3.28
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	23,592	13,847.38	326,687,446	11,170.68	263,538,824	1.49
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	15,538	14,883.88	231,265,797	11,737.31	182,374,400	1.03
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	2,422	65,255.80	158,049,551	70,315.07	170,303,114	0.96
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	14,216	14,974.55	212,878,220	11,803.66	167,800,902	0.95
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6,749	23,388.76	157,850,776	23,562.21	159,021,369	0.90
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	10,780	11,775.56	126,940,631	14,490.83	156,211,255	0.88
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	3,369	41,382.27	139,416,887	41,012.26	138,170,311	0.78
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	7,581	15,913.35	120,639,151	17,678.29	134,019,147	0.76
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	6,198	20,209.26	125,257,048	20,248.69	125,501,399	0.71
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	6,433	22,072.53	141,992,613	19,378.18	124,659,838	0.70
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	4,220	26,314.67	111,047,948	27,609.56	116,512,352	0.66
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	4,796	21,863.31	104,856,481	23,663.06	113,488,055	0.64
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	2,655	38,087.95	101,123,509	42,518.40	112,886,371	0.64
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	6,877	31,716.53	218,114,595	16,165.51	111,170,240	0.63
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	7,091	17,395.90	123,354,350	15,561.29	110,345,124	0.62
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	2,225	43,584.60	96,975,757	46,207.46	102,811,614	0.58

アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,088	39,188.04	81,824,637	48,703.55	101,693,021	0.57
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,604	20,307.75	93,496,919	21,571.71	99,316,162	0.56
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	14,486	6,573.35	95,221,551	6,811.49	98,671,259	0.56
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6,556	12,116.10	79,433,176	14,705.81	96,411,317	0.54
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	5,922	24,048.17	142,413,310	15,958.50	94,506,249	0.53
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	10,603	8,522.02	90,358,991	8,486.16	89,978,807	0.51
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	3,571	22,812.65	81,463,981	24,148.74	86,235,172	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	18,780	4,720.10	88,643,659	4,397.67	82,588,393	0.47
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	1,047	74,904.53	78,425,052	74,021.38	77,500,392	0.44
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	1,056	73,523.72	77,641,053	73,097.54	77,191,012	0.44
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,307	14,511.71	62,501,963	17,895.91	77,077,719	0.43
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,828	46,812.00	85,572,341	42,094.25	76,948,306	0.43

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和4年12月30日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	エネルギー	5.36
	素材	4.04
	資本財	6.10
	商業・専門サービス	1.13
	運輸	1.69
	自動車・自動車部品	1.37
	耐久消費財・アパレル	1.48
	消費者サービス	1.71
	メディア・娯楽	4.31
	小売	3.97
	食品・生活必需品小売	1.38

食品・飲料・タバコ	4.08
家庭用品・パーソナル用品	1.70
ヘルスケア機器・サービス	4.61
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.77
銀行	5.53
各種金融	4.38
保険	3.14
不動産	0.32
ソフトウェア・サービス	9.42
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.34
電気通信サービス	1.31
公益事業	3.02
半導体・半導体製造装置	3.83
小計	87.97
投資証券	2.07
合計	90.04

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なものの

令和4年12月30日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額(円)	評価金額	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2303	賃建	31	アメリカドル	6,130,535.43	813,522,051	6,001,212.5	796,360,898	4.49
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602303	賃建	2	カナダドル	476,667.5	46,660,981	471,440	46,149,261	0.26
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 2303	賃建	27	ユーロ	1,056,882.8	149,517,209	1,040,310	147,172,655	0.83
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2303	賃建	3	オーストラリアドル	534,533.25	47,878,142	522,075	46,762,257	0.26
	イギリス	インタークンチネンタル取引所	FTSE100 2303	賃建	4	イギリスポンド	299,465	47,914,400	300,080	48,012,800	0.27
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX2303	賃建	3	スイスフラン	324,115.55	46,588,369	323,250	46,463,955	0.26

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

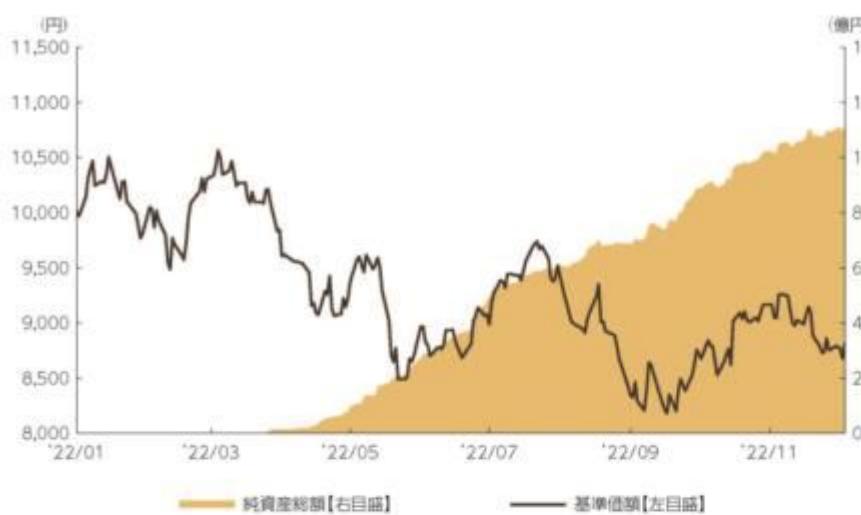
参考情報



運用実績

2022年12月30日現在

■基準価額・純資産の推移 2022年1月27日(設定日)～2022年12月30日



■基準価額・純資産

基準価額	8,807円
純資産総額	11.1億円

•純資産総額は表示枠未満切捨て

■分配の推移

2022年 6月	0円
設定来累計	0円

•分配金は1万口当たり、税引前

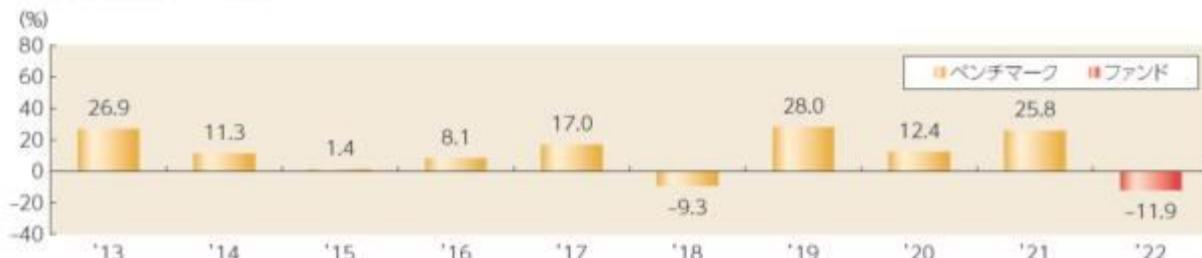
■主要な資産の状況

組入通貨	比率	組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
1 円	99.0%	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	4.0%
その他	1.0%	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	3.3%
		3 AMAZON.COM INC	小売	アメリカ	1.5%
		4 ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	アメリカ	1.0%
		5 UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	アメリカ	1.0%
		6 ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	アメリカ	0.9%
		7 JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	アメリカ	0.9%
		8 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	アメリカ	0.9%
		9 BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	アメリカ	0.8%
		10 JPMORGAN CHASE & CO	銀行	アメリカ	0.8%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (賃貸)	6.4%

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

■年間收益率の推移



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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。
ただし、以下の日は申込みができません。

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

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

申込単位

販売会社が定める単位

申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

申込手数料

ありません。

申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

なお、申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があります。申込みコースの取扱いは販売会社により異なる場合があります。

申込受付時間

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

取得申込みの受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことがあります。

また、信託金の限度額に達しない場合でも、ファンドの運用規模・運用効率等を勘案し、市況動向や資金流入の動向等に応じて、取得申込みの受付を中止することができます。

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

　　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

受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

解約単位

販売会社が定める単位

解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

信託財産留保額

ありません。

解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

支払開始日

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。

解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。

解約請求受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求の受付を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、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解約請求を受け付けたものとします。

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

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 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数

なお、便宜上1万口当たりに換算した価額で表示することができます。

「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入

有価証券を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

(資産の評価方法)

・株式 / 上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場（外国で取引されているものについては、原則として、金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場）で評価します。

・転換社債 / 転換社債型新株予約権付社債

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額（外国で取引されているものについては、原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額）で評価します。

・公社債等

原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。

残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法による評価を適用することができます。

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

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り円換算します。

・外国為替予約取引

原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限(2022年1月27日設定)

ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることができます。

(4) 【計算期間】

毎年6月26日から翌年6月25日まで

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

(5) 【その他】

ファンドの償還条件等

委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。(任意償還)

- ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
- ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃されたときまたはやむを得ない事情が発生したとき

このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。

委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。

信託約款の変更等

委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは受託会社を同一とする他ファンドとの併合を行うことができます。委託会社は、変更または併合しようとするときは、あらかじめその旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。

ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還(信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたとき、また、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、書面決議の手続を行うことが困難な場合を除きます。)、信託約款の変更または併合(変更にあっては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款変更等」といいます。)をしようとする場合には、書面による決議(「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を発します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、受益者が議決権を行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上をもって行います。書面決議の効力は、ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

併合に係るいづれかのファンドにおいて、書面決議が否決された場合、併合を行うことはできません。

反対受益者の受益権買取請求の不適用

委託会社がファンドの任意償還、重大な約款変更等を行う場合、書面決議において反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、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。この規定は、受益者が自己に帰属する受益権についてその全部または一部の償還を請求したときに、委託会社が信託約款の規定に基づいて信託契約の一部解約をする

ことにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。

関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結された「投資信託受益権の取扱に関する契約」の契約期間は、契約締結日から1年とします。ただし双方から契約満了日の3ヵ月前までに別段の意思表示のないときは、さらに1年間延長するものとし、その後も同様とします。

運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更、ファンドの任意償還等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することができます。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることができます。これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることができます。

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

信託事務の再信託

受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について再信託受託会社と再信託契約を締結し、これを委託することができます。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

公告

委託会社が受益者に対する公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.am.mufg.jp/>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

分配金受取コース（一般コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、毎計算期間の終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

分配金再投資コース（累積投資コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、「累積投資契約」に基づいて、決算日の基準価額により自動的に無手数料で全額再投資されます。

(2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。ただし、受益者が、償還金について支払開始日から10年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その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き、換金（解約）請求する権利を有します。

くわしくは「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」を参照してください。

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドの第1計算期間は、約款の規定に従い、令和4年1月27日から令和4年6月27日までとしております。
- 3 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（令和4年1月27日から令和4年6月27日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン(ラップ向け)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

第1期
[令和 4年 6月27日現在]

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

(2) 【損益及び剩余金計算書】

(単位:円)

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

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 令和4年 1月27日 至 令和4年 6月27日		
1. 分配金の計算過程		
項目		
費用控除後の配当等収益額	A	469,282円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	円
収益調整金額	C	281,217円
分配準備積立金額	D	円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	750,499円
当ファンドの期末残存口数	F	302,884,425口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	24円
1万口当たり分配金額	H	円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	円

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

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

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第1期 [令和 4年 6月27日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差 額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項につ いての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

合計	6,105,853
----	-----------

(デリバティブ取引に関する注記)
取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1 口当たり情報)

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

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表
(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位 : 円)

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)	
[令和4年6月27日現在]	
資産の部	
流動資産	
預金	190,891,709
コール・ローン	938,093,816
株式	15,919,866,995
投資証券	400,969,143
派生商品評価勘定	46,774,638
未収入金	159,209
未収配当金	16,419,251
差入委託証拠金	145,799,759
流動資産合計	17,658,974,520
資産合計	17,658,974,520
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	767,087,436
未払解約金	219,087
未払利息	1,160
流動負債合計	767,307,683
負債合計	767,307,683
純資産の部	
元本等	
元本	7,242,821,151
剩余金	
剩余金又は欠損金()	9,648,845,686
元本等合計	16,891,666,837
純資産合計	16,891,666,837
負債純資産合計	17,658,974,520

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[令和4年 6月27日現在]
1. 期首	令和4年 1月27日
期首元本額	6,798,484,217円
期中追加設定元本額	915,559,933円
期中一部解約元本額	471,222,999円
元本の内訳	
つみたて先進国株式(為替ヘッジあり)	416,839,303円
ラップ向けインデックスf 先進国株式(為替ヘッジあり)	352,353円
ラップ向けアクティブラロケーションファンド	3,308,373円
ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン(ラップ向け)	116,488,355円
ヘッジ付先進国株式インデックスオープン	216,583,926円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)	1,087,070,725円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	9,709,931円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,113,070,717円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	1,630,102,400円
MUKAM ヘッジ付外国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	1,013,182,841円
MUKAM ヘッジ付外国株式インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	1,371,947,761円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07(適格機関投資家限定)	22,000,341円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09(適格機関投資家限定)	21,619,842円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11(適格機関投資家限定)	21,436,099円

	[令和4年 6月27日現在]
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01(適格機関投資家限定)	21,465,912円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03(適格機関投資家限定)	21,629,071円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05(適格機関投資家限定)	21,706,862円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07(適格機関投資家限定)	21,477,507円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09(適格機関投資家限定)	21,314,355円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11(適格機関投資家限定)	21,313,817円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01(適格機関投資家限定)	21,935,627円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03(適格機関投資家限定)	23,459,282円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05(適格機関投資家限定)	24,805,751円
合計	7,242,821,151円
2. 受益権の総数	7,242,821,151口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

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

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

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 4年 6月27日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項につ いての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[令和 4年 6月27日現在]

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

(注)時価の算定方法

1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

[令和 4年 6月27日現在]

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引以外の取引	為替予約取引			
		売建		
		アメリカドル	12,307,773,461	12,933,311,088
		カナダドル	666,649,992	688,056,060
		オーストラリアドル	417,588,457	422,345,532
		イギリスポンド	813,014,809	830,845,423
		スイスフラン	524,943,214	552,723,500
		香港ドル	152,439,074	160,152,980
		シンガポールドル	67,642,596	70,285,196
		ニュージーランドドル	20,398,448	20,667,288

スウェーデンクローネ	191,851,896	194,136,294	2,284,398
ノルウェークローネ	46,956,490	47,097,048	140,558
デンマーククローネ	140,170,351	144,454,030	4,283,679
イスラエルシェケル	29,331,717	30,196,336	864,619
ユーロ	1,630,516,386	1,680,676,440	50,160,054
合計	17,009,276,891	17,774,947,215	765,670,324

(注)時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[令和4年6月27日現在]
1口当たり純資産額	2,3322円
(1万口当たり純資産額)	(23,322円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

(単位:円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	876	36.45	31,930.20	
	BAKER HUGHES CO	2,441	28.47	69,495.27	
	CHENIERE ENERGY INC	611	126.58	77,340.38	

CHEVRON CORP	4,967	144.77	719,072.59	
CONOCOPHILLIPS	3,333	90.91	303,003.03	
COTERRA ENERGY INC	2,157	26.35	56,836.95	
DEVON ENERGY CORP	1,626	53.77	87,430.02	
DIAMONDBACK ENERGY INC	435	119.70	52,069.50	
EOG RESOURCES INC	1,479	110.59	163,562.61	
EQT CORP	870	35.09	30,528.30	
EXXON MOBIL CORP	10,802	86.90	938,693.80	
HALLIBURTON CO	2,270	30.95	70,256.50	
HESS CORP	712	101.69	72,403.28	
KINDER MORGAN INC	5,159	16.48	85,020.32	
MARATHON OIL CORP	1,827	22.05	40,285.35	
MARATHON PETROLEUM CORP	1,450	85.68	124,236.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	2,363	57.52	135,919.76	
ONEOK INC	1,130	54.57	61,664.10	
PHILLIPS 66	1,213	84.20	102,134.60	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	586	223.48	130,959.28	
SCHLUMBERGER LTD	3,698	35.06	129,651.88	
TARGA RESOURCES CORP	569	58.14	33,081.66	
VALERO ENERGY CORP	1,034	103.93	107,463.62	
WILLIAMS COS INC	3,076	30.05	92,433.80	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	559	252.08	140,912.72	
ALBEMARLE CORP	296	224.79	66,537.84	
ALCOA CORP	471	49.36	23,248.56	
AMCOR PLC	3,872	12.41	48,051.52	
AVERY DENNISON CORP	208	165.35	34,392.80	
BALL CORP	817	71.59	58,489.03	
CELANESE CORP	275	127.57	35,081.75	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	544	83.32	45,326.08	
CLEVELAND-CLIFFS INC	1,353	16.48	22,297.44	
CORTEVA INC	1,843	53.56	98,711.08	
CROWN HOLDINGS INC	317	95.43	30,251.31	
DOW INC	1,862	53.14	98,946.68	
DUPONT DE NEMOURS INC	1,310	58.55	76,700.50	
EASTMAN CHEMICAL CO	341	92.45	31,525.45	
ECOLAB INC	652	159.65	104,091.80	
FMC CORP	336	108.23	36,365.28	
FREEPORT-MCMORAN INC	3,714	30.99	115,096.86	
INTERNATIONAL PAPER CO	966	42.84	41,383.44	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	645	121.41	78,309.45	
LINDE PLC	1,314	303.23	398,444.22	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	670	89.24	59,790.80	

MARTIN MARIETTA MATERIALS	157	309.68	48,619.76	
MOSAIC CO/THE	940	46.61	43,813.40	
NEWMONT CORP	2,009	64.18	128,937.62	
NUCOR CORP	670	111.06	74,410.20	
PACKAGING CORP OF AMERICA	239	140.60	33,603.40	
PPG INDUSTRIES INC	600	121.01	72,606.00	
RPM INTERNATIONAL INC	331	81.61	27,012.91	
SEALED AIR CORP	377	59.65	22,488.05	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	629	231.25	145,456.25	
STEEL DYNAMICS INC	519	68.89	35,753.91	
VULCAN MATERIALS CO	335	145.82	48,849.70	
WESTLAKE CORP	104	99.60	10,358.40	
WESTROCK CO	664	40.64	26,984.96	
3M CO	1,455	134.33	195,450.15	
AERCAP HOLDINGS NV	355	40.99	14,551.45	
ALLEGION PLC	226	99.60	22,509.60	
AMETEK INC	587	113.50	66,624.50	
BOEING CO/THE	1,412	141.53	199,840.36	
CARRIER GLOBAL CORP	2,256	36.30	81,892.80	
CATERPILLAR INC	1,367	185.49	253,564.83	
CUMMINS INC	361	195.02	70,402.22	
DEERE & CO	744	310.87	231,287.28	
DOVER CORP	366	123.22	45,098.52	
EATON CORP PLC	1,053	131.83	138,816.99	
EMERSON ELECTRIC CO	1,504	82.03	123,373.12	
FASTENAL CO	1,459	51.90	75,722.10	
FORTIVE CORP	865	56.28	48,682.20	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	365	63.24	23,082.60	
GENERAC HOLDINGS INC	182	224.55	40,868.10	
GENERAL DYNAMICS CORP	600	222.33	133,398.00	
GENERAL ELECTRIC CO	2,776	67.08	186,214.08	
HEICO CORP	118	132.00	15,576.00	
HEICO CORP-CLASS A	191	106.34	20,310.94	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,770	180.02	318,635.40	
HOWMET AEROSPACE INC	977	32.18	31,439.86	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	100	215.34	21,534.00	
IDEX CORP	201	185.56	37,297.56	
ILLINOIS TOOL WORKS	794	187.92	149,208.48	
INGERSOLL-RAND INC	1,038	43.33	44,976.54	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	500	52.07	26,035.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	1,775	48.95	86,886.25	
KORNIT DIGITAL LTD	100	36.40	3,640.00	

L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	497	233.55	116,074.35	
LENNOX INTERNATIONAL INC	83	203.64	16,902.12	
LOCKHEED MARTIN CORP	627	419.04	262,738.08	
MASCO CORP	600	51.80	31,080.00	
NORDSON CORP	133	204.94	27,257.02	
NORTHROP GRUMMAN CORP	381	463.70	176,669.70	
OTIS WORLDWIDE CORP	1,137	70.86	80,567.82	
OWENS CORNING	259	75.60	19,580.40	
PACCAR INC	879	84.21	74,020.59	
PARKER HANNIFIN CORP	325	253.10	82,257.50	
PENTAIR PLC	414	47.03	19,470.42	
PLUG POWER INC	1,284	18.23	23,407.32	
QUANTA SERVICES INC	374	125.98	47,116.52	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	3,853	94.20	362,952.60	
ROCKWELL AUTOMATION INC	293	201.06	58,910.58	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	406	43.19	17,535.14	
SMITH (A.O.) CORP	363	55.82	20,262.66	
SNAP-ON INC	135	201.87	27,252.45	
STANLEY BLACK & DECKER INC	413	111.16	45,909.08	
TEXTRON INC	549	60.62	33,280.38	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	598	131.49	78,631.02	
TRANSDIGM GROUP INC	133	538.75	71,653.75	
UNITED RENTALS INC	182	248.29	45,188.78	
WABTEC CORP	452	85.05	38,442.60	
WW GRAINGER INC	115	460.95	53,009.25	
XYLEM INC	450	79.61	35,824.50	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	340	89.54	30,443.60	
CINTAS CORP	235	379.18	89,107.30	
CLARIVATE PLC	891	14.65	13,053.15	
COPART INC	540	112.88	60,955.20	
COSTAR GROUP INC	1,000	62.85	62,850.00	
EQUIFAX INC	309	184.83	57,112.47	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	326	125.42	40,886.92	
LEIDOS HOLDINGS INC	349	101.57	35,447.93	
REPUBLIC SERVICES INC	563	129.90	73,133.70	
ROBERT HALF INTL INC	284	77.90	22,123.60	
ROLLINS INC	525	35.11	18,432.75	
TRANSUNION	466	81.83	38,132.78	
VERISK ANALYTICS INC	423	172.99	73,174.77	
WASTE CONNECTIONS INC	661	122.73	81,124.53	
WASTE MANAGEMENT INC	1,057	150.31	158,877.67	
AMERCO	23	481.86	11,082.78	

C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	346	103.86	35,935.56	
CSX CORP	5,598	29.57	165,532.86	
DELTA AIR LINES INC	476	31.20	14,851.20	
EXPEDITORS INTL WASH INC	429	100.49	43,110.21	
FEDEX CORP	637	243.24	154,943.88	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	3,000	2.89	8,670.00	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	212	162.15	34,375.80	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	390	47.07	18,357.30	
LYFT INC-A	679	16.34	11,094.86	
NORFOLK SOUTHERN CORP	614	230.43	141,484.02	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	247	257.72	63,656.84	
SOUTHWEST AIRLINES CO	370	37.73	13,960.10	
UBER TECHNOLOGIES INC	3,679	23.03	84,727.37	
UNION PACIFIC CORP	1,624	215.78	350,426.72	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,879	183.30	344,420.70	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	200	46.35	9,270.00	
APTIIV PLC	686	97.09	66,603.74	
BORGWARNER INC	574	35.69	20,486.06	
FORD MOTOR CO	9,921	12.01	119,151.21	
GENERAL MOTORS CO	3,533	34.82	123,019.06	
LEAR CORP	153	134.21	20,534.13	
LUCID GROUP INC	1,100	19.21	21,131.00	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	400	29.50	11,800.00	
TESLA INC	2,245	737.12	1,654,834.40	
DR HORTON INC	856	67.69	57,942.64	
GARMIN LTD	382	100.13	38,249.66	
HASBRO INC	333	85.74	28,551.42	
LENNAR CORP-A	687	71.93	49,415.91	
LULULEMON ATHLETICA INC	299	293.36	87,714.64	
MOHAWK INDUSTRIES INC	145	127.95	18,552.75	
NEWELL BRANDS INC	926	20.03	18,547.78	
NIKE INC -CL B	3,287	112.91	371,135.17	
NVR INC	8	4,049.72	32,397.76	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	682	11.01	7,508.82	
PULTEGROUP INC	686	40.39	27,707.54	
VF CORP	832	48.01	39,944.32	
WHIRLPOOL CORP	161	166.35	26,782.35	
AIRBNB INC-CLASS A	839	103.51	86,844.89	
ARAMARK	599	31.16	18,664.84	
BOOKING HOLDINGS INC	104	1,931.05	200,829.20	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	544	44.47	24,191.68	
CARNIVAL CORP	2,088	10.85	22,654.80	

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	71	1,329.02	94,360.42	
DARDEN RESTAURANTS INC	337	119.81	40,375.97	
DOMINO'S PIZZA INC	92	396.54	36,481.68	
EXPEDIA GROUP INC	370	102.34	37,865.80	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	708	116.71	82,630.68	
LAS VEGAS SANDS CORP	930	33.43	31,089.90	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	703	139.39	97,991.17	
MCDONALD'S CORP	1,890	247.90	468,531.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	942	30.24	28,486.08	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	583	41.76	24,346.08	
STARBUCKS CORP	2,964	78.11	231,518.04	
VAIL RESORTS INC	105	232.34	24,395.70	
WYNN RESORTS LTD	267	58.29	15,563.43	
YUM! BRANDS INC	740	114.42	84,670.80	
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,967	77.94	153,307.98	
ALPHABET INC-CL A	768	2,359.50	1,812,096.00	
ALPHABET INC-CL C	726	2,370.76	1,721,171.76	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	1,400	12.47	17,458.00	
CABLE ONE INC	14	1,266.56	17,731.84	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	303	463.12	140,325.36	
COMCAST CORP-CLASS A	11,510	39.57	455,450.70	
DISH NETWORK CORP-A	644	18.85	12,139.40	
ELECTRONIC ARTS INC	713	130.20	92,832.60	
FOX CORP - CLASS A	846	32.80	27,748.80	
FOX CORP - CLASS B	328	30.35	9,954.80	
IAC/INTERACTIVECORP	202	83.90	16,947.80	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	993	27.98	27,784.14	
LIBERTY BROADBAND-C	351	115.27	40,459.77	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	172	36.07	6,204.04	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	495	36.09	17,864.55	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	492	63.87	31,424.04	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	438	86.80	38,018.40	
MATCH GROUP INC	759	78.45	59,543.55	
META PLATFORMS INC-CLASS A	5,900	170.16	1,003,944.00	
NETFLIX INC	1,152	190.85	219,859.20	
NEWS CORP - CLASS A	968	15.78	15,275.04	
OMNICOM GROUP	532	64.60	34,367.20	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	1,531	25.76	39,438.56	
PINTEREST INC- CLASS A	1,457	21.47	31,281.79	
ROBLOX CORP -CLASS A	900	36.42	32,778.00	
ROKU INC	297	98.77	29,334.69	
SEA LTD-ADR	922	80.47	74,193.34	

SIRIUS XM HOLDINGS INC	2,407	6.19	14,899.33	
SNAP INC - A	2,742	14.70	40,307.40	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	408	133.62	54,516.96	
TWITTER INC	2,021	39.41	79,647.61	
WALT DISNEY CO/THE	4,654	97.78	455,068.12	
WARNER BROS DISCOVERY INC	5,595	14.28	79,896.60	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	700	37.71	26,397.00	
ADVANCE AUTO PARTS INC	149	183.10	27,281.90	
AMAZON.COM INC	23,400	116.46	2,725,164.00	
AUTOZONE INC	53	2,158.91	114,422.23	
BATH & BODY WORKS INC	641	30.95	19,838.95	
BEST BUY CO INC	559	74.69	41,751.71	
BURLINGTON STORES INC	177	159.98	28,316.46	
CARMAX INC	410	98.36	40,327.60	
CARVANA CO	188	31.52	5,925.76	
CHEWY INC - CLASS A	222	38.16	8,471.52	
DOLLAR GENERAL CORP	590	247.90	146,261.00	
DOLLAR TREE INC	569	157.21	89,452.49	
DOORDASH INC - A	500	74.11	37,055.00	
EBAY INC	1,580	45.67	72,158.60	
ETSY INC	320	83.62	26,758.40	
GENUINE PARTS CO	357	136.75	48,819.75	
HOME DEPOT INC	2,670	283.00	755,610.00	
LKQ CORP	669	49.92	33,396.48	
LOWE'S COS INC	1,703	182.84	311,376.52	
MERCADOLIBRE INC	115	739.46	85,037.90	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	170	639.06	108,640.20	
POOL CORP	106	356.94	37,835.64	
ROSS STORES INC	898	77.53	69,621.94	
TARGET CORP	1,210	150.42	182,008.20	
TJX COMPANIES INC	3,041	60.24	183,189.84	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	288	202.97	58,455.36	
ULTA BEAUTY INC	149	410.54	61,170.46	
WAYFAIR INC- CLASS A	202	59.35	11,988.70	
COSTCO WHOLESALE CORP	1,134	484.37	549,275.58	
KROGER CO	1,785	48.45	86,483.25	
SYSCO CORP	1,297	85.57	110,984.29	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,857	41.65	77,344.05	
WALMART INC	3,927	123.72	485,848.44	
ALTRIA GROUP INC	4,643	43.40	201,506.20	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,415	74.52	105,445.80	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	773	71.51	55,277.23	

BUNGE LTD	356	88.39	31,466.84	
CAMPBELL SOUP CO	612	48.44	29,645.28	
COCA-COLA CO/THE	10,532	63.04	663,937.28	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	527	53.02	27,941.54	
CONAGRA BRANDS INC	1,224	34.10	41,738.40	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	415	245.50	101,882.50	
GENERAL MILLS INC	1,532	70.63	108,205.16	
HERSHEY CO/THE	368	220.96	81,313.28	
HORMEL FOODS CORP	747	47.37	35,385.39	
JM SMUCKER CO/THE	275	128.88	35,442.00	
KELLOGG CO	676	70.72	47,806.72	
KEURIG DR PEPPER INC	2,036	35.76	72,807.36	
KRAFT HEINZ CO/THE	1,896	38.40	72,806.40	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	625	87.84	54,900.00	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	471	55.77	26,267.67	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	3,523	62.65	220,715.95	
MONSTER BEVERAGE CORP	1,004	94.58	94,958.32	
PEPSICO INC	3,537	166.13	587,601.81	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	3,935	103.40	406,879.00	
TYSON FOODS INC-CL A	745	85.80	63,921.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	619	91.61	56,706.59	
CLOROX COMPANY	322	140.75	45,321.50	
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,024	80.38	162,689.12	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	585	270.20	158,067.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	851	134.46	114,425.46	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	6,117	144.35	882,988.95	
ABBOTT LABORATORIES	4,522	109.45	494,932.90	
ABIOMED INC	110	255.32	28,085.20	
ALIGN TECHNOLOGY INC	189	258.75	48,903.75	
AMERISOURCEBERGEN CORP	389	148.46	57,750.94	
ANTHEM INC	614	469.87	288,500.18	
BAXTER INTERNATIONAL INC	1,267	66.78	84,610.26	
BECTON DICKINSON AND CO	729	250.92	182,920.68	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	3,605	38.02	137,062.10	
CARDINAL HEALTH INC	678	54.45	36,917.10	
CENTENE CORP	1,479	82.95	122,683.05	
CIGNA CORP	814	265.13	215,815.82	
COOPER COS INC/THE	122	323.49	39,465.78	
CVS HEALTH CORP	3,338	94.52	315,507.76	
DAVITA INC	171	77.50	13,252.50	
DENTSPLY SIRONA INC	554	36.76	20,365.04	
DEXCOM INC	980	77.67	76,116.60	

EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,581	96.98	153,325.38	
HCA HEALTHCARE INC	629	182.33	114,685.57	
HENRY SCHEIN INC	353	77.29	27,283.37	
HOLOGIC INC	636	70.93	45,111.48	
HUMANA INC	325	456.81	148,463.25	
IDEXX LABORATORIES INC	214	361.48	77,356.72	
INSULET CORP	175	227.73	39,852.75	
INTUITIVE SURGICAL INC	931	209.67	195,202.77	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	242	242.56	58,699.52	
MASIMO CORP	134	138.60	18,572.40	
MCKESSON CORP	386	321.55	124,118.30	
MEDTRONIC PLC	3,458	90.22	311,980.76	
MOLINA HEALTHCARE INC	148	267.13	39,535.24	
NOVOCURE LTD	237	75.60	17,917.20	
QUEST DIAGNOSTICS INC	310	140.31	43,496.10	
RESMED INC	369	211.50	78,043.50	
STERIS PLC	254	207.89	52,804.06	
STRYKER CORP	884	204.43	180,716.12	
TELADOC HEALTH INC	382	37.17	14,198.94	
TELEFLEX INC	117	258.05	30,191.85	
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,407	495.64	1,193,005.48	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	186	108.77	20,231.22	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	351	207.04	72,671.04	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	529	108.87	57,592.23	
ABBVIE INC	4,528	152.34	689,795.52	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	761	121.29	92,301.69	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	301	147.50	44,397.50	
AMGEN INC	1,423	245.37	349,161.51	
AVANTOR INC	1,624	31.60	51,318.40	
BIO-RAD LABORATORIES-A	60	507.84	30,470.40	
BIO-TECHNE CORP	99	352.76	34,923.24	
BIOGEN INC	371	211.93	78,626.03	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	488	86.85	42,382.80	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	5,524	78.96	436,175.04	
CATALENT INC	453	109.61	49,653.33	
CHARLES RIVER LABORATORIES	132	226.32	29,874.24	
DANAHER CORP	1,738	256.83	446,370.54	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	1,080	20.61	22,258.80	
ELI LILLY & CO	2,076	325.62	675,987.12	
EXACT SCIENCES CORP	457	45.15	20,633.55	
GILEAD SCIENCES INC	3,168	63.08	199,837.44	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	533	85.13	45,374.29	

ILLUMINA INC	402	193.93	77,959.86	
INCYTE CORP	479	78.19	37,453.01	
IQVIA HOLDINGS INC	482	213.80	103,051.60	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	155	153.49	23,790.95	
JOHNSON & JOHNSON	6,717	182.29	1,224,441.93	
MERCK & CO. INC.	6,456	93.13	601,247.28	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	58	1,146.90	66,520.20	
MODERNA INC	871	144.27	125,659.17	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	235	98.24	23,086.40	
PERKINELMER INC	325	145.53	47,297.25	
PFIZER INC	14,366	51.59	741,141.94	
REGENERON PHARMACEUTICALS	276	612.49	169,047.24	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	948	43.20	40,953.60	
SEAGEN INC	341	179.33	61,151.53	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	2,786	7.74	21,563.64	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	996	544.81	542,630.76	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	643	292.55	188,109.65	
VIATRIS INC	3,239	10.96	35,499.44	
WATERS CORP	154	328.58	50,601.32	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	187	301.18	56,320.66	
ZOETIS INC	1,195	174.61	208,658.95	
BANK OF AMERICA CORP	18,610	32.31	601,289.10	
CITIGROUP INC	5,130	47.86	245,521.80	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,264	37.03	46,805.92	
FIFTH THIRD BANCORP	1,726	35.22	60,789.72	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	33	668.84	22,071.72	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	445	146.91	65,374.95	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	3,578	12.51	44,760.78	
JPMORGAN CHASE & CO	7,551	117.32	885,883.32	
KEYCORP	2,346	17.83	41,829.18	
M & T BANK CORP	453	166.64	75,487.92	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,067	162.84	173,750.28	
REGIONS FINANCIAL CORP	2,396	19.49	46,698.04	
SIGNATURE BANK	153	192.14	29,397.42	
SVB FINANCIAL GROUP	148	415.52	61,496.96	
TRUIST FINANCIAL CORP	3,374	49.22	166,068.28	
US BANCORP	3,682	47.52	174,968.64	
WEBSTER FINANCIAL CORP	510	44.88	22,888.80	
WELLS FARGO & CO	9,758	40.76	397,736.08	
ALLY FINANCIAL INC	812	35.15	28,541.80	
AMERICAN EXPRESS CO	1,666	146.15	243,485.90	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	281	249.29	70,050.49	

ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	3,729	6.33	23,604.57	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	985	52.00	51,220.00	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	1,981	43.60	86,371.60	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	3,295	278.28	916,932.60	
BLACKROCK INC	393	647.78	254,577.54	
BLACKSTONE INC	1,793	98.87	177,273.91	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,076	110.09	118,456.84	
CARLYLE GROUP INC/THE	437	34.11	14,906.07	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	281	114.94	32,298.14	
CME GROUP INC	908	210.00	190,680.00	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	300	62.71	18,813.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	744	99.17	73,782.48	
EQUITABLE HOLDINGS INC	922	27.25	25,124.50	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	93	392.52	36,504.36	
FRANKLIN RESOURCES INC	810	25.34	20,525.40	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	110	52.94	5,823.40	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	870	302.75	263,392.50	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,423	97.91	139,325.93	
INVESCO LTD	864	17.36	14,999.04	
KKR & CO INC	1,448	48.57	70,329.36	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	206	188.82	38,896.92	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	96	277.64	26,653.44	
MOODY'S CORP	423	277.50	117,382.50	
MORGAN STANLEY	3,397	77.82	264,354.54	
MSCI INC	208	432.06	89,868.48	
NASDAQ INC	291	159.28	46,350.48	
NORTHERN TRUST CORP	499	97.12	48,462.88	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	467	92.50	43,197.50	
S&P GLOBAL INC	913	341.66	311,935.58	
SCHWAB (CHARLES) CORP	3,662	64.43	235,942.66	
SEI INVESTMENTS COMPANY	291	55.38	16,115.58	
STATE STREET CORP	923	66.27	61,167.21	
SYNCHRONY FINANCIAL	1,387	29.54	40,971.98	
T ROWE PRICE GROUP INC	615	121.50	74,722.50	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	271	74.08	20,075.68	
UPSTART HOLDINGS INC	160	40.95	6,552.00	
AFLAC INC	1,589	55.79	88,650.31	
ALLEGHANY CORP	35	833.50	29,172.50	
ALLSTATE CORP	724	127.16	92,063.84	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	184	137.53	25,305.52	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	2,099	52.77	110,764.23	
AON PLC-CLASS A	557	271.74	151,359.18	

ARCH CAPITAL GROUP LTD	981	44.86	44,007.66	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	525	165.25	86,756.25	
ASSURANT INC	149	172.86	25,756.14	
BROWN & BROWN INC	584	59.06	34,491.04	
CHUBB LTD	1,089	194.53	211,843.17	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	387	116.50	45,085.50	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	72	190.96	13,749.12	
EVEREST RE GROUP LTD	100	283.19	28,319.00	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	642	37.59	24,132.78	
GLOBE LIFE INC	245	99.16	24,294.20	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	860	65.69	56,493.40	
LINCOLN NATIONAL CORP	466	48.98	22,824.68	
LOEWS CORP	500	59.77	29,885.00	
MARKEL CORP	34	1,292.86	43,957.24	
MARSH & MCLENNAN COS	1,277	158.83	202,825.91	
METLIFE INC	1,803	64.22	115,788.66	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	664	68.55	45,517.20	
PROGRESSIVE CORP	1,480	115.99	171,665.20	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	953	97.41	92,831.73	
TRAVELERS COS INC/THE	622	166.72	103,699.84	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	315	204.95	64,559.25	
WR BERKLEY CORP	541	68.03	36,804.23	
CBRE GROUP INC - A	847	73.13	61,941.11	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	2,700	4.90	13,230.00	
ZILLOW GROUP INC - C	474	35.46	16,808.04	
ACCENTURE PLC-CL A	1,618	299.37	484,380.66	
ADOBE INC	1,202	387.72	466,039.44	
AFFIRM HOLDINGS INC	400	23.28	9,312.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	411	94.46	38,823.06	
ANSYS INC	220	256.95	56,529.00	
APPLOVIN CORP-CLASS A	300	39.63	11,889.00	
AUTODESK INC	555	192.48	106,826.40	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,064	218.79	232,792.56	
AVALARA INC	219	84.35	18,472.65	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	600	35.58	21,348.00	
BILL.COM HOLDINGS INC	300	130.48	39,144.00	
BLACK KNIGHT INC	408	66.21	27,013.68	
BLOCK INC	1,356	71.00	96,276.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	294	145.59	42,803.46	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	699	157.62	110,176.38	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	353	51.59	18,211.27	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD	264	124.10	32,762.40	

CITRIX SYSTEMS INC	314	96.59	30,329.26	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	657	51.84	34,058.88	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	1,327	70.26	93,235.02	
COUPA SOFTWARE INC	186	65.84	12,246.24	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	493	184.99	91,200.07	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	113	142.80	16,136.40	
DATADOG INC - CLASS A	552	107.48	59,328.96	
DOCUSIGN INC	514	68.75	35,337.50	
DROPBOX INC-CLASS A	810	22.62	18,322.20	
DYNATRACE INC	474	44.08	20,893.92	
EPAM SYSTEMS INC	143	326.01	46,619.43	
FAIR ISAAC CORP	65	416.15	27,049.75	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	1,539	98.63	151,791.57	
FISERV INC	1,587	94.19	149,479.53	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	195	217.50	42,412.50	
FORTINET INC	1,755	59.13	103,773.15	
GARTNER INC	208	251.29	52,268.32	
GLOBAL PAYMENTS INC	733	118.86	87,124.38	
GODADDY INC - CLASS A	436	70.97	30,942.92	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	192	77.92	14,960.64	
HUBSPOT INC	113	343.71	38,839.23	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,313	142.06	328,584.78	
INTUIT INC	696	417.62	290,663.52	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	189	182.90	34,568.10	
MASTERCARD INC - A	2,235	330.50	738,667.50	
MICROSOFT CORP	18,200	267.70	4,872,140.00	
MONGODB INC	173	303.09	52,434.57	
NORTONLIFELOCK INC	1,471	22.46	33,038.66	
OKTA INC	374	101.26	37,871.24	
ORACLE CORP	4,055	70.70	286,688.50	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	4,071	10.19	41,483.49	
PALO ALTO NETWORKS INC	249	510.71	127,166.79	
PAYCHEX INC	821	122.43	100,515.03	
PAYCOM SOFTWARE INC	129	306.53	39,542.37	
PAYPAL HOLDINGS INC	2,819	77.68	218,979.92	
PTC INC	291	112.44	32,720.04	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	202	61.80	12,483.60	
ROPER TECHNOLOGIES INC	267	407.71	108,858.57	
SALESFORCE INC	2,520	185.92	468,518.40	
SERVICENOW INC	516	504.09	260,110.44	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	539	151.53	81,674.67	
SPLUNK INC	409	97.86	40,024.74	

SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	603	60.66	36,577.98	
SYNOPSYS INC	385	317.47	122,225.95	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1,102	49.49	54,537.98	
TWILIO INC - A	426	99.12	42,225.12	
TYLER TECHNOLOGIES INC	118	345.33	40,748.94	
UNITY SOFTWARE INC	546	46.81	25,558.26	
VERISIGN INC	254	169.27	42,994.58	
VISA INC-CLASS A SHARES	4,251	205.51	873,623.01	
VMWARE INC-CLASS A	530	117.96	62,518.80	
WESTERN UNION CO	907	16.69	15,137.83	
WIX.COM LTD	145	68.89	9,989.05	
WORKDAY INC-CLASS A	524	152.05	79,674.20	
ZENDESK INC	305	74.17	22,621.85	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	549	122.64	67,329.36	
ZSCALER INC	206	170.82	35,188.92	
AMPHENOL CORP-CL A	1,516	65.85	99,828.60	
APPLE INC	41,695	141.66	5,906,513.70	
ARISTA NETWORKS INC	643	99.82	64,184.26	
ARROW ELECTRONICS INC	176	111.06	19,546.56	
CDW CORP/DE	343	164.34	56,368.62	
CISCO SYSTEMS INC	10,655	44.10	469,885.50	
COGNEX CORP	458	45.38	20,784.04	
CORNING INC	2,050	32.76	67,158.00	
DELL TECHNOLOGIES -C	732	50.25	36,783.00	
F5 INC	156	158.47	24,721.32	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	3,298	14.06	46,369.88	
HP INC	2,692	35.23	94,839.16	
JUNIPER NETWORKS INC	828	29.15	24,136.20	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	465	140.48	65,323.20	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	427	217.33	92,799.91	
NETAPP INC	566	66.81	37,814.46	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	506	74.15	37,519.90	
TE CONNECTIVITY LTD	825	118.39	97,671.75	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	118	378.02	44,606.36	
TRIMBLE INC	626	61.01	38,192.26	
WESTERN DIGITAL CORP	854	47.07	40,197.78	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	135	308.91	41,702.85	
AT&T INC	18,343	20.99	385,019.57	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	594	23.17	13,762.98	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	608	22.08	13,424.64	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	2,206	11.27	24,861.62	
T-MOBILE US INC	1,579	137.08	216,449.32	

VERIZON COMMUNICATIONS INC	10,701	50.96	545,322.96	
AES CORP	1,681	21.42	36,007.02	
ALLIANT ENERGY CORP	637	57.32	36,512.84	
AMEREN CORPORATION	655	87.91	57,581.05	
AMERICAN ELECTRIC POWER	1,271	93.60	118,965.60	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	458	148.34	67,939.72	
ATMOS ENERGY CORP	383	109.24	41,838.92	
CENTERPOINT ENERGY INC	1,592	28.85	45,929.20	
CMS ENERGY CORP	751	65.19	48,957.69	
CONSOLIDATED EDISON INC	897	92.93	83,358.21	
CONSTELLATION ENERGY	798	59.28	47,305.44	
DOMINION ENERGY INC	2,048	78.14	160,030.72	
DTE ENERGY COMPANY	491	122.91	60,348.81	
DUKE ENERGY CORP	1,999	104.53	208,955.47	
EDISON INTERNATIONAL	964	62.79	60,529.56	
ENTERGY CORP	506	110.55	55,938.30	
ESSENTIAL UTILITIES INC	585	45.96	26,886.60	
EVERGY INC	608	64.11	38,978.88	
EVERSOURCE ENERGY	869	83.35	72,431.15	
EXELON CORP	2,472	43.29	107,012.88	
FIRSTENERGY CORP	1,367	37.29	50,975.43	
NEXTERA ENERGY INC	5,043	78.02	393,454.86	
NISOURCE INC	1,003	28.62	28,705.86	
NRG ENERGY INC	585	38.32	22,417.20	
P G & E CORP	3,764	10.25	38,581.00	
PPL CORP	1,909	27.08	51,695.72	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	1,284	62.51	80,262.84	
SEMPRA ENERGY	809	149.44	120,896.96	
SOUTHERN CO/THE	2,760	69.83	192,730.80	
UGI CORP	505	39.47	19,932.35	
VISTRA CORP	1,086	23.39	25,401.54	
WEC ENERGY GROUP INC	798	97.16	77,533.68	
XCEL ENERGY INC	1,442	68.56	98,863.52	
ADVANCED MICRO DEVICES	4,199	87.08	365,648.92	
ANALOG DEVICES INC	1,356	149.69	202,979.64	
APPLIED MATERIALS INC	2,283	97.36	222,272.88	
BROADCOM INC	1,051	509.09	535,053.59	
ENPHASE ENERGY INC	360	198.39	71,420.40	
ENTEGRIS INC	344	103.90	35,741.60	
INTEL CORP	10,425	38.61	402,509.25	
KLA CORP	384	339.50	130,368.00	
LAM RESEARCH CORP	356	450.19	160,267.64	

MARVELL TECHNOLOGY INC	2,197	48.22	105,939.34	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	1,403	60.58	84,993.74	
MICRON TECHNOLOGY INC	2,826	58.44	165,151.44	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	111	419.41	46,554.51	
NVIDIA CORP	6,384	171.26	1,093,323.84	
NXP SEMICONDUCTORS NV	672	159.32	107,063.04	
ON SEMICONDUCTOR	1,091	52.97	57,790.27	
QORVO INC	275	97.87	26,914.25	
QUALCOMM INC	2,878	125.10	360,037.80	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	418	98.03	40,976.54	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	128	286.34	36,651.52	
TERADYNE INC	414	97.12	40,207.68	
TEXAS INSTRUMENTS INC	2,370	155.95	369,601.50	
アメリカドル 小計		844,304		86,895,280.09
				(11,696,973,652)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	1,700	15.00	25,500.00
	CAMECO CORP	1,000	29.01	29,010.00
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	3,000	65.14	195,420.00
	CENOVUS ENERGY INC	3,600	24.29	87,444.00
	ENBRIDGE INC	5,100	53.85	274,635.00
	IMPERIAL OIL LTD	600	60.42	36,252.00
	KEYERA CORP	500	29.00	14,500.00
	PARKLAND CORP	400	33.11	13,244.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	1,457	44.28	64,515.96
	SUNCOR ENERGY INC	3,700	44.55	164,835.00
	TC ENERGY CORP	2,500	66.81	167,025.00
	TOURMALINE OIL CORP	800	63.88	51,104.00
	AGNICO EAGLE MINES LTD	1,155	63.44	73,273.20
	BARRICK GOLD CORP	4,500	24.23	109,035.00
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	400	60.48	24,192.00
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	1,600	25.88	41,408.00
	FRANCO-NEVADA CORP	500	178.62	89,310.00
	IVANHOE MINES LTD-CL A	1,800	7.49	13,482.00
	KINROSS GOLD CORP	3,100	5.16	15,996.00
	LUNDIN MINING CORP	1,600	8.48	13,568.00
	NUTRIEN LTD	1,388	103.45	143,588.60
	PAN AMERICAN SILVER CORP	600	27.18	16,308.00
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	1,200	40.86	49,032.00
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	200	97.63	19,526.00
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,100	49.27	54,197.00
	CAE INC	700	32.14	22,498.00
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	200	100.95	20,190.00

WSP GLOBAL INC	300	141.86	42,558.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	500	35.27	17,635.00	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	300	79.60	23,880.00	
THOMSON REUTERS CORP	423	134.19	56,762.37	
AIR CANADA	300	17.42	5,226.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,500	146.75	220,125.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	2,400	90.95	218,280.00	
TFI INTERNATIONAL INC	200	101.34	20,268.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	800	74.61	59,688.00	
BRP INC/CA- SUB VOTING	100	83.98	8,398.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	400	36.95	14,780.00	
RESTAURANT BRANDS INTERN	780	64.16	50,044.80	
QUEBECOR INC -CL B	400	28.65	11,460.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	1,200	38.25	45,900.00	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	100	166.29	16,629.00	
DOLLARAMA INC	700	74.95	52,465.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	2,200	55.17	121,374.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	500	39.89	19,945.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	400	114.71	45,884.00	
METRO INC/CN	600	68.88	41,328.00	
WESTON (GEORGE) LTD	116	147.41	17,099.56	
SAPUTO INC	700	28.76	20,132.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	800	11.28	9,024.00	
BANK OF MONTREAL	1,700	123.16	209,372.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	3,100	75.56	234,236.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	2,300	63.25	145,475.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	900	83.60	75,240.00	
ROYAL BANK OF CANADA	3,600	124.34	447,624.00	
TORONTO-DOMINION BANK	4,700	83.74	393,578.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	3,600	58.87	211,932.00	
IGM FINANCIAL INC	200	35.93	7,186.00	
ONEX CORPORATION	200	65.70	13,140.00	
TMX GROUP LTD	200	133.37	26,674.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	60	636.77	38,206.20	
GREAT-WEST LIFECO INC	800	31.14	24,912.00	
IA FINANCIAL CORP INC	300	61.45	18,435.00	
INTACT FINANCIAL CORP	400	180.42	72,168.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	4,900	21.92	107,408.00	
POWER CORP OF CANADA	1,500	33.69	50,535.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	1,500	59.05	88,575.00	
FIRSTSERVICE CORP	100	159.20	15,920.00	
BLACKBERRY LTD	1,600	7.40	11,840.00	

CGI INC	600	103.73	62,238.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	50	1,948.66	97,433.00	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	300	32.82	9,846.00	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	200	51.18	10,236.00	
OPEN TEXT CORP	700	51.10	35,770.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	290	497.09	144,156.10	
BCE INC	200	63.28	12,656.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	900	62.43	56,187.00	
TELUS CORP	1,100	28.89	31,779.00	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	1,600	17.86	28,576.00	
ALTAGAS LTD	800	26.84	21,472.00	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	300	47.03	14,109.00	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	300	37.70	11,310.00	
EMERA INC	700	59.80	41,860.00	
FORTIS INC	1,200	59.77	71,724.00	
HYDRO ONE LTD	800	33.87	27,096.00	
NORTHLAND POWER INC	500	38.55	19,275.00	
カナダドル 小計	102,319		5,856,153.79	
			(610,328,347)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	557	33.15	18,464.55
	SANTOS LTD	8,156	7.22	58,886.32
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	506	23.23	11,754.38
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	4,801	30.61	146,958.61
	BHP GROUP LTD	12,982	40.02	519,539.64
	BLUESCOPE STEEL LTD	1,219	15.63	19,052.97
	EVOLUTION MINING LTD	5,134	3.38	17,352.92
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	4,181	17.28	72,247.68
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	1,184	32.18	38,101.12
	MINERAL RESOURCES LTD	500	48.20	24,100.00
	NEWCREST MINING LTD	2,429	23.04	55,964.16
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	2,655	7.99	21,213.45
	ORICA LTD	941	15.47	14,557.27
	RIO TINTO LTD	941	101.40	95,417.40
	SOUTH32 LTD	11,968	3.99	47,752.32
	REECE LTD	697	14.19	9,890.43
	BRAMBLES LTD	3,695	10.88	40,201.60
	AURIZON HOLDINGS LTD	5,283	3.74	19,758.42
	QANTAS AIRWAYS LTD	2,324	4.45	10,341.80
	TRANSURBAN GROUP	7,795	14.23	110,922.85
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,544	33.52	51,754.88
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	146	66.15	9,657.90
	IDP EDUCATION LTD	622	23.89	14,859.58

LOTTERY CORP LTD/THE	5,855	4.58	26,815.90	
REA GROUP LTD	142	114.07	16,197.94	
SEEK LTD	963	21.35	20,560.05	
WESFARMERS LTD	2,874	43.81	125,909.94	
COLES GROUP LTD	3,280	17.81	58,416.80	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	3,419	7.46	25,505.74	
WOOLWORTHS GROUP LTD	3,073	35.46	108,968.58	
TREASURY WINE ESTATES LTD	1,804	11.30	20,385.20	
COCHLEAR LTD	160	195.16	31,225.60	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	437	71.52	31,254.24	
SONIC HEALTHCARE LTD	1,162	33.31	38,706.22	
CSL LTD	1,244	271.25	337,435.00	
AUST AND NZ BANKING GROUP	7,134	21.91	156,305.94	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	4,315	90.16	389,040.40	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	8,284	27.02	223,833.68	
WESTPAC BANKING CORP	8,912	19.48	173,605.76	
ASX LTD	488	82.04	40,035.52	
MACQUARIE GROUP LTD	931	165.33	153,922.23	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	6,395	4.36	27,882.20	
MEDIBANK PRIVATE LTD	6,661	3.23	21,515.03	
QBE INSURANCE GROUP LTD	3,778	12.05	45,524.90	
SUNCORP GROUP LTD	3,194	10.84	34,622.96	
LENDLEASE GROUP	1,565	9.21	14,413.65	
COMPUTERSHARE LTD	1,249	23.65	29,538.85	
WISETECH GLOBAL LTD	371	39.00	14,469.00	
XERO LTD	357	82.15	29,327.55	
TELSTRA CORP LTD	11,202	3.89	43,575.78	
APA GROUP	3,043	11.50	34,994.50	
ORIGIN ENERGY LTD	5,149	5.55	28,576.95	
オーストラリアドル 小計		177,701		3,731,316.36 (346,825,855)
イギリスポンド	BP PLC	49,918	3.86	192,933.07
	SHELL PLC	19,467	20.87	406,373.62
	ANGLO AMERICAN PLC	3,232	30.66	99,093.12
	ANTOFAGASTA PLC	960	11.84	11,371.20
	CRODA INTERNATIONAL PLC	337	63.04	21,244.48
	GLENCORE PLC	25,114	4.46	112,071.22
	JOHNSON MATTHEY PLC	520	19.85	10,324.60
	MONDI PLC	1,226	14.76	18,101.89
	RIO TINTO PLC	2,836	49.79	141,204.44
	ASHTEAD GROUP PLC	1,128	35.51	40,055.28
	BAE SYSTEMS PLC	8,037	7.83	62,929.71

BUNZL PLC	864	26.44	22,844.16	
DCC PLC	253	50.02	12,655.06	
FERGUSON PLC	560	92.00	51,520.00	
MELROSE INDUSTRIES PLC	11,788	1.51	17,900.07	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	22,200	0.80	17,968.68	
SMITHS GROUP PLC	904	13.99	12,646.96	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	193	97.00	18,721.00	
EXPERIAN PLC	2,341	23.90	55,949.90	
INTERTEK GROUP PLC	393	43.25	16,997.25	
RELX PLC	4,901	22.05	108,067.05	
RENTOKIL INITIAL PLC	4,847	4.82	23,396.46	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,276	4.72	10,744.99	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	290	37.36	10,834.40	
BURBERRY GROUP PLC	1,068	16.98	18,134.64	
PERSIMMON PLC	813	18.71	15,215.29	
TAYLOR WIMPEY PLC	8,804	1.18	10,423.93	
COMPASS GROUP PLC	4,531	16.97	76,891.07	
ENTAIN PLC	1,492	13.36	19,933.12	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	483	44.04	21,271.32	
WHITBREAD PLC	456	25.56	11,655.36	
AUTO TRADER GROUP PLC	2,260	5.50	12,430.00	
INFORMA PLC	3,841	5.42	20,841.26	
PEARSON PLC	1,922	7.80	15,006.97	
WPP PLC	3,099	8.10	25,101.90	
JD SPORTS FASHION PLC	6,745	1.19	8,033.29	
KINGFISHER PLC	5,496	2.43	13,371.76	
NEXT PLC	340	59.82	20,338.80	
OCADO GROUP PLC	1,100	8.70	9,576.60	
SAINSBURY (J) PLC	4,929	2.10	10,390.33	
TESCO PLC	19,411	2.55	49,575.69	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1,005	16.36	16,441.80	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	5,513	35.30	194,636.46	
COCA-COLA HBC AG-DI	447	18.15	8,113.05	
DIAGEO PLC	5,895	36.58	215,668.57	
IMPERIAL BRANDS PLC	2,394	18.38	44,013.69	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,808	62.46	112,927.68	
UNILEVER PLC	6,631	37.37	247,800.47	
SMITH & NEPHEW PLC	2,260	11.65	26,329.00	
ASTRAZENECA PLC	3,962	107.76	426,945.12	
GSK PLC	13,003	17.56	228,358.68	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	361	16.37	5,909.57	
BARCLAYS PLC	42,294	1.58	67,222.08	

HSBC HOLDINGS PLC	51,449	5.37	276,435.47	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	179,529	0.43	77,906.60	
NATWEST GROUP PLC	13,892	2.21	30,770.78	
STANDARD CHARTERED PLC	6,476	5.89	38,169.54	
3I GROUP PLC	2,445	11.22	27,445.12	
ABRDN PLC	6,100	1.70	10,427.95	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	905	8.04	7,281.63	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	832	76.00	63,232.00	
M&G PLC	6,694	1.98	13,294.28	
SCHRODERS PLC	293	27.68	8,110.24	
ST JAMES'S PLACE PLC	1,350	11.49	15,511.50	
ADMIRAL GROUP PLC	491	22.19	10,895.29	
AVIVA PLC	7,225	4.11	29,730.87	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	16,539	2.44	40,454.39	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	1,739	6.20	10,795.71	
PRUDENTIAL PLC	6,943	9.86	68,471.86	
AVEVA GROUP PLC	270	24.63	6,650.10	
SAGE GROUP PLC/THE	2,629	6.46	16,993.85	
HALMA PLC	972	19.96	19,405.98	
BT GROUP PLC	17,798	1.88	33,549.23	
VODAFONE GROUP PLC	69,201	1.26	87,539.26	
NATIONAL GRID PLC	9,568	10.51	100,559.68	
SEVERN TRENT PLC	644	27.89	17,961.16	
SSE PLC	2,781	16.49	45,872.59	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,875	10.12	18,975.00	
イギリスポンド 小計		725,588		4,524,946.19
				(747,204,364)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	508	17.72	9,001.76
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	17	723.00	12,291.00
	GIVAUDAN-REG	23	3,310.00	76,130.00
	HOLCIM LTD	1,456	43.72	63,656.32
	SIKA AG-REG	383	227.30	87,055.90
	ABB LTD-REG	4,169	25.46	106,142.74
	GEBERIT AG-REG	92	477.00	43,884.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	63	169.00	10,647.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	95	172.05	16,344.75
	VAT GROUP AG	67	243.20	16,294.40
	ADECCO GROUP AG-REG	350	33.86	11,851.00
	SGS SA-REG	17	2,205.00	37,485.00
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	134	226.10	30,297.40
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1,322	102.15	135,042.30
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	81	232.40	18,824.40

SWATCH GROUP AG/THE-REG	93	43.34	4,030.62	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	9	2,146.00	19,314.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	5	9,600.00	48,000.00	
NESTLE SA-REG	7,203	111.64	804,142.92	
ALCON INC	1,272	66.14	84,130.08	
SONOVA HOLDING AG-REG	137	309.00	42,333.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	312	110.15	34,366.80	
BACHEM HOLDING AG-REG B	90	71.90	6,471.00	
LONZA GROUP AG-REG	189	512.80	96,919.20	
NOVARTIS AG-REG	5,607	80.60	451,924.20	
ROCHE HOLDING AG-BR	63	361.80	22,793.40	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,802	318.80	574,477.60	
VIFOR PHARMA AG-NEW	119	164.50	19,575.50	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	6,552	5.72	37,477.44	
JULIUS BAER GROUP LTD	602	45.26	27,246.52	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	58	895.00	51,910.00	
UBS GROUP AG-REG	8,895	15.99	142,275.52	
BALOISE HOLDING AG - REG	108	155.70	16,815.60	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	79	472.00	37,288.00	
SWISS RE AG	767	75.12	57,617.04	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	381	418.00	159,258.00	
SWISS PRIME SITE-REG	214	85.45	18,286.30	
TEMENOS AG - REG	172	84.84	14,592.48	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	452	53.38	24,127.76	
SWISSCOM AG-REG	67	522.40	35,000.80	
スイスフラン 小計		44,025	3,505,321.75	
			(492,743,078)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	6,832	52.85	361,071.20
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	3,500	84.65	296,275.00
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	4,000	18.20	72,800.00
	MTR CORP	4,000	41.00	164,000.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	4,000	22.80	91,200.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	6,000	42.00	252,000.00
	SANDS CHINA LTD	6,400	15.10	96,640.00
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	5,600	14.14	79,184.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	3,700	22.60	83,620.00
	WH GROUP LTD	21,000	5.60	117,600.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	9,500	31.00	294,500.00
	HANG SENG BANK LTD	2,000	138.00	276,000.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	3,000	374.20	1,122,600.00
	AIA GROUP LTD	31,200	80.60	2,514,720.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	5,332	54.60	291,127.20

ESR GROUP LTD	4,400	20.20	88,880.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	5,000	14.40	72,000.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	4,118	29.00	119,422.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	4,250	28.15	119,637.50	
SINO LAND CO	7,000	11.22	78,540.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	3,500	92.00	322,000.00	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	1,000	46.20	46,200.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	2,200	19.00	41,800.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	4,000	35.35	141,400.00	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	10,000	10.52	105,200.00	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	1,500	48.45	72,675.00	
CLP HOLDINGS LTD	4,000	65.20	260,800.00	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	6,500	7.23	46,995.00	
HONG KONG & CHINA GAS	28,474	8.37	238,327.38	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	4,000	48.60	194,400.00	
香港ドル 小計	206,006		8,061,614.28	
			(138,256,684)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	3,500	6.56	22,960.00
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	3,000	4.01	12,030.00
	SINGAPORE AIRLINES LTD	3,900	5.15	20,085.00
	GENTING SINGAPORE LTD	12,300	0.72	8,917.50
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	4,900	4.05	19,845.00
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	4,600	29.81	137,126.00
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	8,700	11.33	98,571.00
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	3,000	26.40	79,200.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,000	9.47	18,940.00
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	6,900	3.85	26,565.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	1,500	8.16	12,240.00
	UOL GROUP LTD	1,800	7.34	13,212.00
	VENTURE CORP LTD	700	16.71	11,697.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	21,700	2.58	55,986.00
シンガポールドル 小計		78,500		537,374.50
			(52,195,185)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	2,910	7.32	21,315.75
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	1,585	19.73	31,272.05
	SPARK NEW ZEALAND LTD	4,546	4.78	21,729.88
	MERCURY NZ LTD	1,273	5.59	7,116.07
	MERIDIAN ENERGY LTD	3,652	4.42	16,141.84
ニュージーランドドル 小計		13,966		97,575.59
			(8,269,531)	
スウェーデンクローネ	BOLIDEN AB	707	330.50	233,663.50
	HOLMEN AB-B SHARES	252	422.20	106,394.40

SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	1,552	153.30	237,921.60	
ALFA LAVAL AB	775	246.30	190,882.50	
ASSA ABLOY AB-B	2,540	212.50	539,750.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	6,920	94.33	652,763.60	
ATLAS COPCO AB-B SHS	3,860	83.96	324,085.60	
EPIROC AB-A	1,654	159.00	262,986.00	
EPIROC AB-B	1,010	136.20	137,562.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	1,008	75.34	75,942.72	
INDUTRADE AB	800	183.30	146,640.00	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	423	198.70	84,050.10	
LIFCO AB-B SHS	500	160.15	80,075.00	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	4,217	72.28	304,804.76	
SANDVIK AB	2,875	167.50	481,562.50	
SKANSKA AB-B SHS	796	150.50	119,798.00	
SKF AB-B SHARES	930	149.45	138,988.50	
VOLVO AB-A SHS	445	163.30	72,668.50	
VOLVO AB-B SHS	4,063	157.28	639,028.64	
SECURITAS AB-B SHS	897	87.04	78,074.88	
VOLVO CAR AB-B	1,500	78.00	117,000.00	
ELECTROLUX AB-B	455	134.64	61,261.20	
EVOLUTION AB	467	961.30	448,927.10	
EMBRACER GROUP AB	1,300	79.44	103,272.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	1,913	121.48	232,391.24	
SWEDISH MATCH AB	3,830	100.90	386,447.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,464	262.20	383,860.80	
GETINGE AB-B SHS	567	230.40	130,636.80	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	458	217.30	99,523.40	
NORDEA BANK ABP	8,177	93.30	762,914.10	
SKANDINAViska ENSKILDA BAN-A	4,153	101.60	421,944.80	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	3,547	87.00	308,589.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	2,313	130.85	302,656.05	
EQT AB	856	215.60	184,553.60	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	231	228.10	52,691.10	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	544	226.00	122,944.00	
INVESTOR AB-A SHS	1,300	182.80	237,640.00	
INVESTOR AB-B SHS	4,615	165.60	764,244.00	
KINNEVIK AB - B	570	162.45	92,596.50	
LUNDBERGS AB-B SHS	218	416.00	90,688.00	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	1,722	51.75	89,113.50	
SAGAX AB-B	500	194.00	97,000.00	
SINCH AB	1,600	38.43	61,488.00	
ERICSSON LM-B SHS	7,389	78.19	577,745.91	

	HEXAGON AB-B SHS	4,909	105.70	518,881.30	
	TELE2 AB-B SHS	1,425	114.10	162,592.50	
	TELIA CO AB	6,823	39.08	266,642.84	
	スウェーデンクローネ 小計	99,070		11,985,887.54 (159,172,586)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	807	331.70	267,681.90	
	EQUINOR ASA	2,505	324.25	812,246.25	
	NORSK HYDRO ASA	3,237	60.38	195,450.06	
	YARA INTERNATIONAL ASA	412	428.00	176,336.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	300	324.40	97,320.00	
	ADEVINTA ASA	545	76.55	41,719.75	
	MOWI ASA	1,148	225.80	259,218.40	
	ORKLA ASA	1,843	75.34	138,851.62	
	SALMAR ASA	163	659.50	107,498.50	
	DNB BANK ASA	2,359	176.00	415,184.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	557	188.20	104,827.40	
	TELENOR ASA	1,721	130.95	225,364.95	
	ノルウェークローネ 小計	15,597		2,841,698.83 (38,675,521)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	274	526.20	144,178.80	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	501	418.10	209,468.10	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	21	1,667.50	35,017.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,559	164.50	420,955.50	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	8	16,840.00	134,720.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	13	17,105.00	222,365.00	
	DSV A/S	517	1,027.00	530,959.00	
	PANDORA A/S	255	469.70	119,773.50	
	CARLSBERG AS-B	252	897.60	226,195.20	
	COLOPLAST-B	308	810.60	249,664.80	
	DEMANT A/S	235	288.80	67,868.00	
	GN STORE NORD A/S	312	244.20	76,190.40	
	GENMAB A/S	168	2,232.00	374,976.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	4,317	786.30	3,394,457.10	
	DANSKE BANK A/S	1,679	107.45	180,408.55	
	TRYG A/S	888	156.40	138,883.20	
	ORSTED A/S	479	734.60	351,873.40	
	デンマーククローネ 小計	12,786		6,877,954.05 (131,300,142)	
イスラエルシェケル	ICL GROUP LTD	1,984	32.35	64,182.40	
	ELBIT SYSTEMS LTD	62	706.00	43,772.00	
	BANK HAPOALIM BM	3,065	29.10	89,191.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	3,682	31.35	115,430.70	

ISRAEL DISCOUNT BANK-A	3,008	18.62	56,008.96	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	381	113.50	43,243.50	
AZRIELI GROUP LTD	97	257.10	24,938.70	
NICE LTD	172	706.70	121,552.40	
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	300	160.20	48,060.00	
イスラエルシェケル 小計	12,751		606,380.16	
			(23,969,055)	
ヨーロ	ENI SPA	6,291	11.66	73,390.80
	GALP ENERGIA SGPS SA	1,546	11.28	17,438.88
	NESTE OYJ	1,041	41.53	43,232.73
	OMV AG	363	44.62	16,197.06
	REPSOL SA	3,669	13.75	50,448.75
	TENARIS SA	1,104	12.45	13,744.80
	TOTALENERGIES SE	6,345	49.55	314,426.47
	AIR LIQUIDE SA	1,321	134.90	178,202.90
	AKZO NOBEL N.V.	470	64.48	30,305.60
	ARCELORMITTAL	1,606	22.50	36,135.00
	ARKEMA	174	89.62	15,593.88
	BASF SE	2,328	42.21	98,276.52
	COVESTRO AG	491	34.48	16,929.68
	CRH PLC	1,949	33.03	64,375.47
	EVONIK INDUSTRIES AG	609	21.41	13,038.69
	HEIDELBERGCEMENT AG	340	48.49	16,486.60
	KONINKLIJKE DSM NV	445	137.75	61,298.75
	OCI NV	260	30.38	7,898.80
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	631	32.90	20,759.90
	SOLVAY SA	180	79.76	14,356.80
	STORA ENSO OYJ-R SHS	1,476	15.20	22,435.20
	SYMRISE AG	338	106.20	35,895.60
	UMICORE	493	32.54	16,042.22
	UPM-KYMMENE OYJ	1,416	29.17	41,304.72
	VOESTALPINE AG	334	21.10	7,047.40
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	660	23.80	15,708.00
	AIRBUS SE	1,493	92.50	138,102.50
	ALSTOM	809	23.52	19,027.68
	BOUYGUES SA	637	30.84	19,645.08
	BRENNETAG SE	401	60.80	24,380.80
	CNH INDUSTRIAL NV	2,573	11.42	29,383.66
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	1,282	43.24	55,440.09
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	1,262	25.73	32,471.26
	DASSAULT AVIATION SA	54	147.00	7,938.00
	EIFFAGE	217	88.96	19,304.32

FERROVIAL SA	1,232	24.48	30,159.36	
GEA GROUP AG	354	33.19	11,749.26	
IMCD NV	142	128.65	18,268.30	
KINGSPAN GROUP PLC	381	59.18	22,547.58	
KION GROUP AG	157	40.11	6,297.27	
KNORR-BREMSE AG	163	57.22	9,326.86	
KONE OYJ-B	824	42.77	35,242.48	
LEGRAND SA	686	71.68	49,172.48	
MTU AERO ENGINES AG	133	173.60	23,088.80	
PRYSMIAN SPA	643	27.31	17,560.33	
RATIONAL AG	13	554.00	7,202.00	
RHEINMETALL AG	113	206.40	23,323.20	
SAFRAN SA	867	95.00	82,365.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,370	116.74	159,933.80	
SIEMENS AG-REG	1,987	102.62	203,905.94	
SIEMENS ENERGY AG	1,027	15.70	16,123.90	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	606	17.85	10,817.10	
THALES SA	272	113.55	30,885.60	
VINCI SA	1,365	87.75	119,778.75	
WARTSILA OYJ ABP	1,007	7.44	7,500.13	
BUREAU VERITAS SA	722	25.39	18,331.58	
RANDSTAD NV	291	47.37	13,784.67	
TELEPERFORMANCE	150	294.20	44,130.00	
WOLTERS KLUWER	672	90.26	60,654.72	
ADP	62	128.10	7,942.20	
AENA SME SA	191	129.80	24,791.80	
ATLANTIA SPA	1,420	22.20	31,524.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,120	5.96	6,681.92	
DEUTSCHE POST AG-REG	2,513	35.90	90,229.26	
GETLINK SE	1,026	17.50	17,955.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	819	74.94	61,375.86	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	159	69.40	11,034.60	
CONTINENTAL AG	291	66.62	19,386.42	
FERRARI NV	321	179.70	57,683.70	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	2,061	58.56	120,692.16	
MICHELIN (CGDE)	1,732	26.24	45,456.34	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	390	64.80	25,272.00	
RENAULT SA	448	24.71	11,070.08	
STELLANTIS NV	5,670	12.42	70,466.76	
VALEO	541	18.81	10,176.21	
VOLKSWAGEN AG	85	180.95	15,380.75	
VOLKSWAGEN AG-PREF	466	139.18	64,857.88	

ADIDAS AG	445	170.36	75,810.20	
ESSILORLUXOTTICA	731	146.55	107,128.05	
HERMES INTERNATIONAL	81	1,067.50	86,467.50	
KERING	190	502.50	95,475.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON	713	587.40	418,816.20	
MONCLER SPA	486	39.70	19,294.20	
PUMA SE	264	66.88	17,656.32	
SEB SA	52	93.65	4,869.80	
ACCOR SA	532	28.20	15,002.40	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	425	101.95	43,328.75	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	200	33.90	6,780.00	
SODEXO SA	226	66.88	15,114.88	
BOLLORE SE	2,292	4.90	11,244.55	
PUBLICIS GROUPE	581	46.61	27,080.41	
SCOUT24 SE	199	51.50	10,248.50	
UBISOFT ENTERTAINMENT	238	44.98	10,705.24	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	1,875	20.00	37,500.00	
VIVENDI SE	2,075	10.06	20,884.87	
D'IETEREN GROUP	66	135.30	8,929.80	
DELIVERY HERO SE	438	39.59	17,340.42	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	2,726	21.93	59,781.18	
JUST EAT TAKEAWAY	417	18.32	7,640.27	
PROSUS NV	2,137	53.07	113,410.59	
ZALANDO SE	571	25.14	14,354.94	
CARREFOUR SA	1,574	17.07	26,876.05	
HELLOFRESH SE	407	30.70	12,494.90	
JERONIMO MARTINS	716	19.56	14,004.96	
KESKO OYJ-B SHS	701	21.47	15,050.47	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	2,655	24.91	66,149.32	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	2,218	50.81	112,696.58	
DANONE	1,661	52.59	87,351.99	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	1,223	10.02	12,260.57	
HEINEKEN HOLDING NV	283	70.60	19,979.80	
HEINEKEN NV	662	89.04	58,944.48	
JDE PEET'S NV	306	25.90	7,925.40	
KERRY GROUP PLC-A	406	91.66	37,213.96	
PERNOD RICARD SA	533	179.90	95,886.70	
REMY COINTREAU	59	169.00	9,971.00	
BEIERSDORF AG	255	97.98	24,984.90	
HENKEL AG & CO KGAA	211	59.05	12,459.55	
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	516	60.36	31,145.76	
L'OREAL	617	336.85	207,836.45	

AMPLIFON SPA	308	29.80	9,178.40	
BIOMERIEUX	121	91.40	11,059.40	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	100	114.15	11,415.00	
DIASORIN SPA	77	127.75	9,836.75	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	528	47.09	24,863.52	
FRESENIUS SE & CO KGAA	1,025	28.10	28,802.50	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	2,318	20.61	47,773.98	
SARTORIUS AG-VORZUG	62	328.20	20,348.40	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	724	46.83	33,904.92	
ARGENX SE	118	336.30	39,683.40	
BAYER AG-REG	2,489	57.79	143,839.31	
EUROFINS SCIENTIFIC	342	78.80	26,949.60	
GRIFOLS SA	945	18.53	17,510.85	
IPSEN	84	87.90	7,383.60	
MERCK KGAA	328	164.80	54,054.40	
ORION OYJ-CLASS B	302	37.73	11,394.46	
QIAGEN N.V.	593	43.50	25,795.50	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	259	41.86	10,841.74	
SANOFI	2,877	100.56	289,311.12	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	73	305.30	22,286.90	
UCB SA	343	80.94	27,762.42	
ABN AMRO BANK NV-CVA	944	11.37	10,738.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	16,837	4.34	73,123.09	
BANCO SANTANDER SA	43,806	2.76	120,904.56	
BNP PARIBAS	2,849	47.93	136,566.81	
CAIXABANK SA	11,253	3.39	38,237.69	
COMMERZBANK AG	3,214	7.32	23,552.19	
CREDIT AGRICOLE SA	2,996	9.17	27,500.28	
ERSTE GROUP BANK AG	930	26.11	24,282.30	
FINECOBANK SPA	1,528	12.02	18,366.56	
ING GROEP NV	9,906	9.77	96,870.77	
INTESA SANPAOLO	41,742	1.88	78,566.79	
KBC GROUP NV	669	55.92	37,410.48	
MEDIOBANCA SPA	1,612	8.62	13,908.33	
SOCIETE GENERALE SA	2,057	22.80	46,899.60	
UNICREDIT SPA	5,353	9.82	52,587.87	
AMUNDI SA	166	52.15	8,656.90	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	5,239	8.91	46,726.64	
DEUTSCHE BOERSE AG	484	157.30	76,133.20	
EURAZE0 SE	89	62.60	5,571.40	
EURONEXT NV	211	77.60	16,373.60	
EXOR NV	285	62.42	17,789.70	

GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	286	80.62	23,057.32	
SOFINA	37	200.80	7,429.60	
WENDEL	66	81.60	5,385.60	
AEGON NV	4,260	4.25	18,113.52	
AGEAS	404	41.88	16,919.52	
ALLIANZ SE-REG	1,036	181.20	187,723.20	
ASSICURAZIONI GENERALI	2,807	16.02	44,968.14	
AXA SA	4,940	22.46	110,977.10	
HANNOVER RUECK SE	156	136.85	21,348.60	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	357	222.60	79,468.20	
NN GROUP NV	721	42.70	30,786.70	
POSTE ITALIANE SPA	1,510	8.94	13,508.46	
SAMPO OYJ-A SHS	1,281	40.26	51,573.06	
AROUNDOWN SA	2,392	3.61	8,635.12	
LEG IMMOBILIEN SE	186	84.66	15,746.76	
VONOVIA SE	1,879	31.70	59,564.30	
ADYEN NV	56	1,413.20	79,139.20	
AMADEUS IT GROUP SA	1,141	53.26	60,769.66	
BECHTLE AG	184	39.19	7,210.96	
CAPGEMINI SE	407	178.35	72,588.45	
DASSAULT SYSTEMES SE	1,688	36.63	61,839.88	
EDENRED	654	45.01	29,436.54	
NEMETSCHEK SE	131	59.92	7,849.52	
NEXI SPA	1,362	8.28	11,277.36	
SAP SE	2,643	92.33	244,028.19	
WORLDSLNE SA	605	38.53	23,310.65	
NOKIA OYJ	13,665	4.45	60,809.25	
CELLNEX TELECOM SA	1,440	38.95	56,088.00	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	8,243	18.88	155,627.84	
ELISA OYJ	350	52.00	18,200.00	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	742	9.97	7,400.70	
KONINKLIJKE KPN NV	8,408	3.37	28,360.18	
ORANGE	5,015	11.10	55,696.59	
PROXIMUS	539	14.04	7,567.56	
TELECOM ITALIA SPA	29,748	0.26	7,761.25	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	3,933	2.75	10,815.75	
TELEFONICA SA	13,346	4.73	63,179.96	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	265	27.98	7,414.70	
ACCIONA SA	68	177.50	12,070.00	
E.ON SE	5,716	8.60	49,169.03	
EDF	1,575	7.72	12,168.45	
EDP RENOVAVEIS SA	748	22.85	17,091.80	

EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	7,157	4.49	32,142.08	
ELIA GROUP SA/NV	83	133.60	11,088.80	
ENAGAS SA	745	20.71	15,428.95	
ENDESA SA	751	18.94	14,227.69	
ENEL SPA	20,504	5.51	113,038.55	
ENGIE	4,634	11.34	52,577.36	
FORTUM OYJ	1,124	15.95	17,933.42	
IBERDROLA SA	14,691	10.05	147,718.00	
NATURGY ENERGY GROUP SA	286	26.85	7,679.10	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	1,162	18.41	21,392.42	
RWE AG	1,635	37.42	61,181.70	
SNAM SPA	5,207	4.96	25,826.72	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	3,614	7.45	26,924.30	
UNIPER SE	259	17.80	4,610.20	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,619	23.91	38,710.29	
VERBUND AG	172	94.55	16,262.60	
ASM INTERNATIONAL NV	117	246.90	28,887.30	
ASML HOLDING NV	1,034	484.85	501,334.90	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	3,320	24.06	79,879.20	
STMICROELECTRONICS NV	1,736	31.79	55,187.44	
ユーロ 小計	473,089		10,377,758.19 (1,473,952,995)	
合 計	2,805,702		15,919,866,995 (15,919,866,995)	

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
アメリカ ドル	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	414	59,421.42	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	869	30,614.87	
		AMERICAN TOWER CORP	1,177	307,962.05	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	356	69,473.40	
		BOSTON PROPERTIES INC	380	34,960.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	260	35,128.60	
		CROWN CASTLE INTL CORP	1,093	191,264.07	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	719	99,797.20	
		DUKE REALTY CORP	951	54,634.95	
		EQUINIX INC	228	157,130.76	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	452	33,199.40	

EQUITY RESIDENTIAL	907	65,140.74		
ESSEX PROPERTY TRUST INC	163	42,658.73		
EXTRA SPACE STORAGE INC	340	58,605.80		
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1,384	36,122.40		
HOST HOTELS & RESORTS INC	1,819	29,267.71		
INVITATION HOMES INC	1,526	54,188.26		
IRON MOUNTAIN INC	736	36,402.56		
KIMCO REALTY CORP	1,576	31,740.64		
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	1,507	23,328.36		
MID-AMERICA APARTMENT COMM	295	50,896.35		
PROLOGIS INC	1,871	229,365.89		
PUBLIC STORAGE	400	125,676.00		
REALTY INCOME CORP	1,547	107,036.93		
REGENCY CENTERS CORP	399	24,530.52		
SBA COMMUNICATIONS CORP	275	90,125.75		
SIMON PROPERTY GROUP INC	833	82,983.46		
SUN COMMUNITIES INC	297	48,351.60		
UDR INC	796	36,735.40		
VENTAS INC	1,007	51,588.61		
VICI PROPERTIES INC	2,434	73,798.88		
VORNADO REALTY TRUST	416	12,430.08		
WELLTOWER INC	1,175	97,948.00		
WEYERHAEUSER CO	1,898	65,158.34		
WP CAREY INC	487	41,774.86		
アメリカドル合計	30,987	2,589,442.59 (348,564,867)		
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	200	8,992.00
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	200	4,078.00
カナダドル合計			400	13,070.00 (1,362,155)
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS/AU	2,608	24,358.72
		GOODMAN GROUP	4,289	80,118.52
		GPT GROUP	4,795	21,241.85
		MIRVAC GROUP	9,499	20,232.87
		SCENTRE GROUP	13,419	35,962.92
		STOCKLAND	5,586	21,506.10
		VICINITY CENTRES	11,078	20,605.08
オーストラリアドル合計			51,274	224,026.06 (20,823,222)
イギリスポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	2,026	10,008.44
		LAND SECURITIES GROUP PLC	1,851	13,256.86
		SEGRO PLC	3,035	31,169.45

イギリスポンド合計			6,912	54,434.75 (8,988,810)		
香港ドル	投資証券	LINK REIT	5,400	344,250.00		
香港ドル合計			5,400	344,250.00 (5,903,887)		
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	9,200	25,944.00		
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	13,499	29,562.81		
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	4,100	7,585.00		
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	8,800	14,960.00		
シンガポールドル合計			35,599	78,051.81 (7,581,172)		
ユーロ	投資証券	COVIVIO	129	7,346.55		
		GECINA SA	99	9,251.55		
		KLEPIERRE	451	9,340.21		
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	304	15,814.08		
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	408	12,778.56		
ユーロ合計			1,391	54,530.95 (7,745,030)		
合計				400,969,143 (400,969,143)		

(注1)通貨の種類ごとの小計 / 合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式時価比率	組入投資証券時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
アメリカドル	株式 604銘柄	97.11%		71.67%
	投資証券 35銘柄		2.89%	2.14%
カナダドル	株式 86銘柄	99.78%		3.74%
	投資証券 2銘柄		0.22%	0.01%
オーストラリアドル	株式 52銘柄	94.34%		2.13%
	投資証券 7銘柄		5.66%	0.13%
イギリスポンド	株式 78銘柄	98.81%		4.58%
	投資証券 3銘柄		1.19%	0.06%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.00%		3.02%
香港ドル	株式 30銘柄	95.90%		0.85%
	投資証券 1銘柄		4.10%	0.04%
シンガポールドル	株式 14銘柄	87.32%		0.32%
	投資証券 4銘柄		12.68%	0.05%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.00%		0.05%
スウェーデンクローネ	株式 47銘柄	100.00%		0.98%

ノルウェークローネ	株式	12銘柄	100.00%		0.24%
デンマーククローネ	株式	17銘柄	100.00%		0.80%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.00%		0.15%
ユーロ	株式	223銘柄	99.48%		9.03%
	投資証券	5銘柄		0.52%	0.05%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

【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）ならびに同規則第38条の3および第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、当中間計算期間より中間財務諸表を作成しているため、中間損益及び剰余金計算書に係る比較情報は記載しておりません。
- 3 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（令和4年6月28日から令和4年12月27日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

【ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン(ラップ向け)】

(1) 【中間貸借対照表】

	第1期 [令和 4年 6月27日現在]	第2期中間計算期間末 [令和 4年12月27日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	58,761	522,630
親投資信託受益証券	271,674,141	1,109,098,280
流動資産合計	271,732,902	1,109,620,910
資産合計	271,732,902	1,109,620,910
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	5,956	119,930
未払委託者報酬	12,423	251,777
未払利息	-	1
その他未払費用	19,746	59,633
流動負債合計	38,125	431,341
負債合計	38,125	431,341
純資産の部		
元本等		
元本	302,884,425	1,262,372,680
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	31,189,648	153,183,111
(分配準備積立金)	469,282	467,963
元本等合計	271,694,777	1,109,189,569
純資産合計	271,694,777	1,109,189,569
負債純資産合計	271,732,902	1,109,620,910

(2) 【中間損益及び剩余金計算書】

(単位:円)

第2期中間計算期間
自 令和4年 6月28日
至 令和4年12月27日

営業収益	
有価証券売買等損益	14,433,332
営業収益合計	14,433,332
営業費用	
支払利息	33
受託者報酬	119,930
委託者報酬	251,777
その他費用	59,633
営業費用合計	431,373
営業利益又は営業損失()	14,864,705
経常利益又は経常損失()	14,864,705
中間純利益又は中間純損失()	14,864,705
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()	12,440
期首剩余金又は期首次損金()	31,189,648
剩余金増加額又は欠損金減少額	211,033
中間一部解約に伴う剩余金増加額又は欠損金減少額	211,033
剩余金減少額又は欠損金増加額	107,352,231
中間追加信託に伴う剩余金減少額又は欠損金増加額	107,352,231
分配金	-
中間剩余金又は中間欠損金()	153,183,111

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年6月25日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当中間計算期間は令和4年6月28日から令和4年12月27日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第1期 [令和4年6月27日現在]	第2期中間計算期間末 [令和4年12月27日現在]
1. 期首元本額	1,000,000円	302,884,425円
期中追加設定元本額	301,884,425円	961,560,809円
期中一部解約元本額	円	2,072,554円
2. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	31,189,648円	153,183,111円
3. 受益権の総数	302,884,425口	1,262,372,680口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期中間計算期間 自 令和4年6月28日 至 令和4年12月27日
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

区分	第1期 [令和4年6月27日現在]	第2期中間計算期間末 [令和4年12月27日現在]
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券	(1) 有価証券

区分	第1期 [令和 4年 6月27日現在]	第2期中間計算期間末 [令和 4年12月27日現在]
	<p>売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>同左</p> <p>(2) デリバティブ取引 同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 同左</p> <p>同左</p>

(有価証券に関する注記)
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)
取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第1期 [令和 4年 6月27日現在]	第2期中間計算期間末 [令和 4年12月27日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8970円 (8,970円)	0.8787円 (8,787円)

(参考)

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

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

[令和4年12月27日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	107,172,551
コール・ローン	617,526,465
株式	15,629,168,709
投資証券	366,990,472
派生商品評価勘定	555,550,513
未収入金	1,956,644
未収配当金	15,391,803
差入委託証拠金	114,626,487
流動資産合計	17,408,383,644
資産合計	17,408,383,644
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	27,143,046
未払解約金	5,596,957
未払利息	1,184
流動負債合計	32,741,187
負債合計	32,741,187
純資産の部	
元本等	
元本	7,601,296,185
剰余金	
剰余金又は欠損金()	9,774,346,272
元本等合計	17,375,642,457
純資産合計	17,375,642,457
負債純資産合計	17,408,383,644

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[令和4年12月27日現在]
1. 期首	令和4年6月28日

	[令和4年12月27日現在]
期首元本額	7,242,821,151円
期中追加設定元本額	1,715,283,586円
期中一部解約元本額	1,356,808,552円
元本の内訳	
つみたて先進国株式(為替ヘッジあり)	528,822,794円
ラップ向けインデックスf 先進国株式(為替ヘッジあり)	351,985円
ラップ向けアクティバロケーションファンド	8,248,675円
ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン(ラップ向け)	485,191,076円
アクティバロケーションファンド(ラップ向け)	30,411,062円
ヘッジ付先進国株式インデックスオープン	440,747,189円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)	1,021,472,079円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	3,567,105円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,044,922,224円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	1,489,549,461円
MUKAM ヘッジ付外国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	831,479,476円
MUKAM ヘッジ付外国株式インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	1,370,799,389円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07(適格機関投資家限定)	22,000,341円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09(適格機関投資家限定)	21,619,842円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11(適格機関投資家限定)	21,436,099円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01(適格機関投資家限定)	21,465,912円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03(適格機関投資家限定)	22,579,810円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05(適格機関投資家限定)	22,660,076円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07(適格機関投資家限定)	22,121,197円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09(適格機関投資家限定)	21,314,355円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11(適格機関投資家限定)	22,543,390円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01(適格機関投資家限定)	23,276,679円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03(適格機関投資家限定)	23,459,282円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05(適格機関投資家限定)	24,769,405円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07(適格機関投資家限定)	25,809,044円

		[令和4年12月27日現在]
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09(適格機関投資家限定)		25,466,024円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11(適格機関投資家限定)		25,212,214円
合計		7,601,296,185円
2. 受益権の総数		7,601,296,185口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和4年12月27日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[令和4年12月27日現在]

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	846,913,557		820,123,411	26,790,146
	合計	846,913,557		820,123,411	26,790,146

(注) 時価の算定方法

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

通貨関連

[令和 4年12月27日現在]

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
			うち1年超	1年以内	
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカドル	12,560,551,400		12,107,278,570	453,272,830
	カナダドル	643,745,979		621,298,156	22,447,823
	オーストラリアドル	427,060,999		414,287,410	12,773,589
	イギリスポンド	789,314,974		766,008,283	23,306,691
	イスイスフラン	522,177,557		512,440,475	9,737,082
	香港ドル	136,428,702		131,657,069	4,771,633
	シンガポールドル	71,254,103		70,076,424	1,177,679
	ニュージーランドドル	10,282,920		10,043,880	239,040
	スウェーデンクローネ	171,501,791		166,230,688	5,271,103
	ノルウェークローネ	39,809,049		38,873,736	935,313
	デンマーククローネ	142,719,942		141,096,472	1,623,470
	イスラエルシェケル	25,555,803		24,231,161	1,324,642
	ユーロ	1,641,333,668		1,623,016,950	18,316,718
合計		17,181,736,887		16,626,539,274	555,197,613

(注)時価の算定方法

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報)

[令和 4年12月27日現在]	
1口当たり純資産額	2,2859円
(1万口当たり純資産額)	(22,859円)

2 【ファンドの現況】

【ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン（ラップ向け）】

【純資産額計算書】

令和 4年12月30日現在

（単位：円）

資産総額	1,114,073,441
負債総額	19,254
純資産総額（ - ）	1,114,054,187
発行済口数	1,264,943,301口
1口当たり純資産価額（ / ）	0.8807
（10,000口当たり）	（8,807）

（参考）

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 4年12月30日現在

（単位：円）

資産総額	17,766,775,920
負債総額	28,486,430
純資産総額（ - ）	17,738,289,490
発行済口数	7,741,457,246口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.2913
（10,000口当たり）	（22,913）

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。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、委託会社は、この信託の受益権を取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消された場合また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、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

（2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

該当事項はありません。

（4）受益権の譲渡

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また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。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少およ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または記録するものとします。ただし、上記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。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、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また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たときまた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。

（5）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または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

（6）質権口記載また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または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、解約請求の受け付け、解約代金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたが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）資本金の額等

2022年12月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

（2）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

・投資運用の意思決定機構

投資環境見通しの策定

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

投資行動のモニタリング1

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

投資行動のモニタリング2

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

ファンドに関係する法人等の管理

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

運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年12月30日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	875	21,763,425
追加型公社債投資信託	16	1,413,534
単位型株式投資信託	90	413,739
単位型公社債投資信託	51	119,277
合計	1,032	23,709,975

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

3【委託会社等の経理状況】

（1）財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

また、当社の中間財務諸表は、「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）」（以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

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

（2）監査証明について

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

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第38期事業年度に係る中間会計期間（自 令和4年4月1日 至 令和4年9月30日）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り中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：千円）

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

(資産の部)

流動資産

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

固定資産

有形固定資産

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

無形固定資産

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

投資その他の資産

投資有価証券		18,616,670		16,803,642
関係会社株式		320,136		159,536
投資不動産	1	814,684	1	810,684
長期差入保証金		538,497		524,244
前払年金費用		258,835		189,708
繰延税金資産		916,962		982,406
その他		45,230		45,230
貸倒引当金		23,600		23,600
投資その他の資産合計		21,487,417		19,491,852
固定資産合計		29,580,307		27,569,120
資産合計		103,463,286		105,392,950

(単位：千円)

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

(負債の部)

流動負債

預り金		533,622		565,222
未払金				
未払収益分配金		158,856		197,334
未払償還金		133,877		7,418

未払手数料	2	5,200,810	2	6,423,139
その他未払金	2	4,412,521	2	4,565,457
未払費用	2	4,755,909	2	4,328,968
未払消費税等		752,617		1,112,923
未払法人税等		873,027		769,692
賞与引当金		933,381		942,287
役員賞与引当金		160,710		149,028
その他		691,143		5,517
流動負債合計		18,606,476		19,066,990

固定負債

長期未払金		21,600		10,800
退職給付引当金		1,145,514		1,246,300
役員退職慰労引当金		117,938		117,938
時効後支払損引当金		245,426		250,214
固定負債合計		1,530,479		1,625,252
負債合計		20,136,956		20,692,243

(純資産の部)**株主資本**

資本金		2,000,131		2,000,131
資本剰余金				
資本準備金		3,572,096		3,572,096
その他資本剰余金		41,160,616		41,160,616
資本剰余金合計		44,732,712		44,732,712
利益剰余金				
利益準備金		342,589		342,589
その他利益剰余金				
別途積立金		6,998,000		6,998,000
繰越利益剰余金		26,951,289		29,000,498
利益剰余金合計		34,291,879		36,341,088
株主資本合計		81,024,723		83,073,932

(単位：千円)

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

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

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

営業収益

委託者報酬	67,963,712	79,977,953
投資顧問料	2,443,980	2,711,169
その他営業収益	21,613	13,459
営業収益合計	70,429,306	82,702,582

営業費用

支払手数料	2	26,689,896	2	31,644,834
広告宣伝費		668,150		720,785
公告費		250		500
調査費				
調査費		2,077,942		2,430,158
委託調査費		12,035,954		14,557,009
事務委託費		798,528		1,450,062
営業雑経費				
通信費		296,490		138,868
印刷費		378,180		379,428
協会費		51,841		49,590
諸会費		16,613		17,729
事務機器関連費		1,977,769		2,172,978
その他営業雑経費		8,391		649
営業費用合計		45,000,009		53,562,596

一般管理費

給料				
役員報酬		352,879		414,260
給料・手当		6,461,546		6,496,233
賞与引当金繰入		933,381		942,287
役員賞与引当金繰入		160,710		149,028
福利厚生費		1,272,568		1,282,310
交際費		2,721		4,874
旅費交通費		22,768		21,698
租税公課		402,939		430,233
不動産賃借料		666,331		724,961
退職給付費用		481,135		494,615
役員退職慰労引当金繰入		11,763		-
固定資産減価償却費		1,358,911		2,249,287
諸経費		413,538		379,054
一般管理費合計		12,541,193		13,588,846
営業利益		12,888,103		15,551,139

(単位：千円)

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

営業外収益

受取配当金	170,807	243,133
受取利息	2	2,726

投資有価証券償還益	81,557	1,089,101
収益分配金等時効完成分	275,835	137,485
受取賃貸料	2	65,808
その他		12,504
営業外収益合計	609,239	1,579,148
営業外費用		
投資有価証券償還損	95,946	3,074
時効後支払損引当金繰入	16,395	16,548
事務過誤費		76,076
賃貸関連費用	13,472	15,780
その他	2,932	7,585
営業外費用合計	128,747	119,066
経常利益	13,368,595	17,011,221
特別利益		
投資有価証券売却益	2,007,655	605,706
特別利益合計	2,007,655	605,706
特別損失		
投資有価証券売却損	51,737	28,188
投資有価証券評価損	26,317	36,558
固定資産除却損	1	536
特別損失合計	78,591	77,840
税引前当期純利益	15,297,659	17,539,087
法人税、住民税及び事業税	2	4,755,427
法人税等調整額		19,122
法人税等合計		4,736,304
当期純利益	10,561,354	12,150,032

(3)【株主資本等変動計算書】

第36期(自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)

(単位:千円)

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,815	1,815	79,922,854
当期変動額			
剰余金の配当			9,457,670

当期純利益			10,561,354
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	2,299,791	2,299,791	2,299,791
当期変動額合計	2,299,791	2,299,791	3,403,475
当期末残高	2,301,606	2,301,606	83,326,329

第37期(自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)

(単位:千円)

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

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産及び投資不動産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	5年～50年
器具備品	2年～20年
投資不動産	3年～47年

(2)無形固定資産

定額法を採用しております。

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

4.外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5.引当金の計上基準**(1)貸倒引当金**

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

(2)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3)役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5)役員退職慰労引当金

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

(6)時効後支払損引当金

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

6.収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1)委託者報酬

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

(2)投資顧問料

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

7.その他財務諸表作成のための基礎となる事項**(1)連結納税制度の適用**

連結納税制度を適用しております。

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

令和2年度税制改正において従来の連結納税制度が見直され、グループ通算制度に移行する税制改正法(「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号))が令和2年3月31日に公布されておりますが、繰延税金資産の額について、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 令和2年3月31日)により「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日)第44項の定めを適用せず、改正前の税法の規定に基づいて算定しております。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取り扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第42号 令和3年8月12日)を適用する予定であります。

(会計方針の変更)

(1) 収益認識に関する会計基準等の適用

「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 令和2年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。)等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することいたしました。収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当事業年度の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当事業年度の期首の繰越利益剰余金に加減し、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。

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

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

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

1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

(2) 時価の算定に関する会計基準等の適用

「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 令和元年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 令和元年7月4日)第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することいたしました。なお、時価算定会計基準等の適用による、財務諸表への影響はありません。また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこといたしました。

(未適用の会計基準等)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 令和3年6月17日)

(1) 概要

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

(2) 適用予定期

令和5年3月期の期首より適用します。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

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

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

第36期

第37期

(令和3年3月31日現在)

(令和4年3月31日現在)

建物	643,920千円	805,250千円
器具備品	1,545,179千円	2,054,366千円
投資不動産	151,833千円	157,995千円

2. 関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

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

2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

(株主資本等変動計算書関係)

第36期(自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

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

令和3年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	10,576,511千円
--------	--------------

配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	49,988円
基準日	令和3年3月31日
効力発生日	令和3年6月29日

第37期(自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

令和3年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

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

令和4年6月28日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

(リース取引関係)

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

第36期(令和3年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 有価証券	2,001	2,001	-
(2) 金銭の信託	2,300,000	2,300,000	-
(3) 投資有価証券	18,585,310	18,585,310	-
資産計	20,887,311	20,887,311	-

(注1) 「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

(注4) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第36期(令和3年3月31日現在)

(単位:千円)

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

第37期(令和4年3月31日現在)

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

(注1) 「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注2) 市場価格のない株式等

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

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

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

(注4) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第37期(令和4年3月31日現在)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	51,593,362	-	-	-
金銭の信託	8,401,300	-	-	-
未収委託者報酬	15,750,264	-	-	-

有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	293,326	6,911,464	3,695,585	-
合計	76,038,253	6,911,464	3,695,585	-

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

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

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

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

2. その他有価証券

第36期(令和3年3月31日現在)

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

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」(貸借対照表計上額は2,300,000千円、取得原価は

2,300,000千円)を含めてあります。

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

第37期(令和4年3月31日現在)

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

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

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

3. 売却したその他有価証券

第36期(自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)

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

第37期(自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

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

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

退職給付債務の期首残高	3,718,736 千円	3,729,235 千円
勤務費用	203,106	198,457
利息費用	19,110	21,549
数理計算上の差異の 発生額	18,826	46,069
退職給付の支払額	192,890	179,650
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	3,729,235	3,723,521

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

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

(5)年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3.確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第36期 (令和3年3月31日現在)	第37期 (令和4年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	418,394千円	410,082千円
投資有価証券評価損	188,859	65,490
未払事業税	180,263	165,702
賞与引当金	285,801	288,528
役員賞与引当金	25,472	25,799
役員退職慰労引当金	36,112	36,112
退職給付引当金	350,756	381,617
減価償却超過額	68,024	145,316
委託者報酬	209,938	-
長期差入保証金	48,639	52,869
時効後支払損引当金	75,149	76,615
連結納税適用による時価評価	38,873	35,311
その他	87,023	76,257
繰延税金資産 小計	2,013,308	1,759,702
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	2,013,308	1,759,702

繰延税金負債

前払年金費用	79,225	58,088
連結納税適用による時価評価	1,203	1,149
その他有価証券評価差額金	1,015,785	717,957

その他	101	101
繰延税金負債 合計	1,096,346	777,296
繰延税金資産の純額	916,962	982,406

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

第36期(令和3年3月31日現在)及び第37期(令和4年3月31日現在)

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

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

収益及び契約から生じるキャッシュ・フローの性質、金額、時期及び不確実性に影響を及ぼす主要な要因に基づく区分に当該収益を分解した情報については、重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は、「(重要な会計方針)の6.収益および費用の計上基準」に記載のとおりであります。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係 並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

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

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第36期(自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注4)	科目	期末残高(注4)
親会社	㈱三菱UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税	連結納税に 伴う支払 (注1)	3,492,898 千円	その他未払金	3,425,136 千円
親会社	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等 投資の助言 役員の兼任	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2) 投資助言料 (注3)	5,128,270 千円 523,327 千円	未払手数料 未払費用	772,495 千円 290,120 千円

第37期(自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第36期(自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注2)	科目	期末残高(注2)
----	--------	-----	-----	-------	----------------	-----------	-------	----------	----	----------

同一の親会社を持つ会社	株三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	3,729,785千円	未払手数料	764,501千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券(株)	東京都千代田区	40,500百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	5,655,482千円	未払手数料	1,193,245千円

第37期(自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注2)	科目	期末残高(注2)
同一の親会社を持つ会社	株三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	4,097,951千円	未払手数料	838,058千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券(株)	東京都千代田区	40,500百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	7,025,984千円	未払手数料	1,319,958千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。
2. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

2. 親会社に関する注記

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

三菱UFJ信託銀行株式会社(非上場)

(1株当たり情報)

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

1株当たり純資産額	393,827.09円	400,322.84円
1株当たり当期純利益金額	49,916.36円	57,424.97円

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

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

3. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

第38期中間会計期間

(令和4年9月30日現在)

(資産の部)

流動資産

現金及び預金	48,375,193
有価証券	270,676
前払費用	804,517
未収入金	78,340
未収委託者報酬	16,141,814
未収収益	751,362
金銭の信託	10,401,500
その他	264,566
流動資産合計	77,087,971

固定資産

有形固定資産

建物	1	285,704
器具備品	1	898,241
土地		628,433
建設仮勘定		39,450
有形固定資産合計		1,851,829

無形固定資産

電話加入権	15,822
ソフトウェア	4,470,447
ソフトウェア仮勘定	1,585,322
無形固定資産合計	6,071,592

投資その他の資産

投資有価証券	14,693,980
関係会社株式	159,536
投資不動産	809,716
長期差入保証金	1,204,923
前払年金費用	154,270
繰延税金資産	1,369,880

その他	45,230
貸倒引当金	23,600
投資その他の資産合計	18,413,938
固定資産合計	26,337,361
資産合計	103,425,332

(単位:千円)

第38期中間会計期間
(令和4年9月30日現在)

(負債の部)

流動負債	
預り金	1,783,230
未払金	
未払収益分配金	112,635
未払償還金	7,418
未払手数料	6,226,860
その他未払金	575,030
未払費用	5,329,791
未払消費税等	2
未払法人税等	592,374
賞与引当金	2,634,965
役員賞与引当金	954,015
その他	86,040
流動負債合計	5,517
	18,307,880

固定負債

退職給付引当金	1,299,571
役員退職慰労引当金	75,667
時効後支払損引当金	261,505
固定負債合計	1,636,744
負債合計	19,944,625

(純資産の部)

株主資本	
資本金	2,000,131
資本剰余金	
資本準備金	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712
利益剰余金	
利益準備金	342,589
その他利益剰余金	
別途積立金	6,998,000
繰越利益剰余金	28,593,826
利益剰余金合計	35,934,416
株主資本合計	82,667,260

(単位:千円)

第38期中間会計期間
(令和4年9月30日現在)

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	813,447
評価・換算差額等合計	813,447
純資産合計	83,480,707
負債純資産合計	103,425,332

(2)中間損益計算書

(単位:千円)

第38期中間会計期間

(自 令和4年4月1日
至 令和4年9月30日)

営業収益	
委託者報酬	40,789,208
投資顧問料	1,442,097
その他営業収益	5,655
営業収益合計	42,236,961
営業費用	
支払手数料	15,949,349
広告宣伝費	237,620
公告費	250
調査費	
調査費	1,359,939
委託調査費	7,988,301
事務委託費	709,248
営業雑経費	
通信費	64,639
印刷費	194,724
協会費	27,550
諸会費	9,245
事務機器関連費	1,088,738
営業費用合計	27,629,607
一般管理費	
給料	
役員報酬	204,466
給料・手当	2,770,641
賞与引当金繰入	954,015
役員賞与引当金繰入	86,040
福利厚生費	637,045
交際費	4,351
旅費交通費	22,970
租税公課	219,318
不動産賃借料	362,988
退職給付費用	193,777
固定資産減価償却費	1,198,877
諸経費	182,304
一般管理費合計	6,836,796
営業利益	7,770,556

(単位:千円)

第38期中間会計期間

(自 令和4年4月1日
至 令和4年9月30日)

営業外収益	
受取配当金	31,240
受取利息	5,115
投資有価証券償還益	780
収益分配金等時効完成分	93,217
受取賃貸料	32,904
その他	32,041
営業外収益合計	195,299
営業外費用	

時効後支払損引当金繰入	39,158
事務過誤費	1,807
賃貸関連費用	6,770
その他	11,805
営業外費用合計	59,541
経常利益	7,906,314
特別利益	
投資有価証券売却益	364,481
特別利益合計	364,481
特別損失	
投資有価証券売却損	338
投資有価証券評価損	104,554
固定資産除却損	3,528
特別損失合計	108,421
税引前中間純利益	8,162,374
法人税、住民税及び事業税	2,522,443
法人税等調整額	28,522
法人税等合計	2,493,921
中間純利益	5,668,453

(3) 中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間(自 令和4年4月1日 至 令和4年9月30日)

(単位:千円)

	株主資本								株主資本合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金合計		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計			
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	29,000,498	36,341,088	83,073,932	
当中間期変動額										
剩余金の配当							6,075,125	6,075,125	6,075,125	
中間純利益							5,668,453	5,668,453	5,668,453	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)										
当中間期変動額合計							406,671	406,671	406,671	
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	28,593,826	35,934,416	82,667,260	

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,626,775	1,626,775	84,700,707
当中間期変動額			
剩余金の配当			6,075,125
中間純利益			5,668,453
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	813,328	813,328	813,328
当中間期変動額合計	813,328	813,328	1,220,000
当中間期末残高	813,447	813,447	83,480,707

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5年～50年

器具備品 2年～20年

投資不動産 3年～47年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5) 役員退職慰労引当金

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

(6) 時効後支払損引当金

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

5. 収益および費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。

(1) 委託者報酬

投資信託の信託約款に基づき信託財産の運用指図等を行っております。委託者報酬は、純資産総額

に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受領しております。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2)投資顧問料

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

6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間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処理しております。

7. その他中間財務諸表作成のための重要な事項

グループ通算制度の適用

当中間会計期間からグループ通算制度を適用しております。

[会計方針の変更]

(時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 令和3年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたり適用することいたしました。なお、時価算定会計基準適用指針の適用による、中間財務諸表への影響はありません。

(追加情報)

当社は、当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、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については、「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12日。以下「実務対応報告第42号」という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項(1)に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

1 減価償却累計額

第38期中間会計期間 (令和4年9月30日現在)	
建物	903,274千円
器具備品	2,258,329千円
投資不動産	161,052千円

2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

第38期中間会計期間 (自 令和4年4月1日 至 令和4年9月30日)	
有形固定資産	321,137千円
無形固定資産	877,740千円
投資不動産	3,057千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第38期中間会計期間（自 令和4年4月1日 至 令和4年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	211,581	-	-	211,581
合計	211,581	-	-	211,581

2. 配当に関する事項

令和4年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

（リース取引関係）

第38期中間会計期間（令和4年9月30日現在）

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

1年内	880,111千円
1年超	1,932,485千円
合 計	2,812,596千円

（金融商品関係）

第38期中間会計期間（令和4年9月30日現在）

1. 金融商品の時価等に関する事項

令和4年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含まれてありません（（注2）参照）。

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 有価証券	270,676	270,676	-
(2) 金銭の信託	10,401,500	10,401,500	-
(3) 投資有価証券	14,662,620	14,662,620	-
資産計	25,334,797	25,334,797	

（注1）「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注2）市場価格のない株式等

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

また、子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 関連会社株式159,536千円）は、市場価格がないため、記載していません。

（注3）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産

区分	時価(千円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券	-	270,676	-	270,676
金銭の信託	-	10,401,500	-	10,401,500
投資有価証券	1,743,912	12,918,707	-	14,662,620
資産計	1,743,912	23,590,884	-	25,334,797

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

ETF(上場投資信託)は相場価格を用いて評価しております。ETFは活発な市場で取引されているため、レベル1の時価に分類しております。

ETF(上場投資信託)以外の投資信託は基準価額を用いて評価しております。基準価額は観察可能なインプットを用いて算出しているため、レベル2の時価に分類しております。

金銭の信託

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

(有価証券関係)

第38期中間会計期間(令和4年9月30日現在)

1. 子会社及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 関連会社株式159,536千円)は、市場価格がないため、記載しておりません。

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
中間貸借対照表 計上額が取得原価 を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	17,920,574	16,110,224	1,810,349
小計		17,920,574	16,110,224	1,810,349
中間貸借対照表 計上額が取得原価 を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	7,414,223	8,052,120	637,897
小計		7,414,223	8,052,120	637,897
合計		25,334,797	24,162,345	1,172,451

(注)「その他」には、中間貸借対照表の「金銭の信託」(中間貸借対照表計上額10,401,500千円、取得価額10,400,000千円)を含めております。

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

3. 減損処理を行った有価証券

当中間会計期間において、有価証券について104,554千円(その他有価証券のその他104,554千円)減損処理を行っております。

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

(収益認識関係)

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

収益及び契約から生じるキャッシュ・フローの性質、金額、時期及び不確実性に影響を及ぼす主要な要因に基づく区分に当該収益を分解した情報については、重要性が乏しいため記載を省略しております。

ます。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第38期中間会計期間(自 令和4年4月1日 至 令和4年9月30日)

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第38期中間会計期間(自 令和4年4月1日 至 令和4年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(1) 株当たり情報

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第38期中間会計期間 (令和4年9月30日現在)	
1株当たり純資産額	394,556.72円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	83,480,707
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	83,480,707
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	211,581

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第38期中間会計期間 (自 令和4年4月1日 至 令和4年9月30日)	
1株当たり中間純利益金額	26,790.93円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	5,668,453
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	5,668,453
普通株式の期中平均株式数(株)	211,581

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

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。

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

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

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 において同じ。）または子法人等（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または店頭デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等また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的取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記 に掲げるもののほか、委託会社の親法人等また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、また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】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

（1）受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

（再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）

資本金の額：324,279百万円（2022年9月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

（2）販売会社

名称	資本金の額 (2022年9月末現在)	事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
農林中央金庫	4,040,198 百万円	金融業務を営んでいます。
東京都信用農業協同組合連合会	132,435 百万円	金融業務を営んでいます。
石川県信用農業協同組合連合会	33,047 百万円	金融業務を営んでいます。
福井県信用農業協同組合連合会	23,373 百万円	金融業務を営んでいます。
兵庫県信用農業協同組合連合会	258,320 百万円	金融業務を営んでいます。
徳島県信用農業協同組合連合会	32,545 百万円	金融業務を営んでいます。
はが野農業協同組合	3,960 百万円	金融業務を営んでいます。
下野農業協同組合	2,001 百万円	金融業務を営んでいます。
塩野谷農業協同組合	3,028 百万円	金融業務を営んでいます。
那須南農業協同組合	1,171 百万円	金融業務を営んでいます。
あさか野農業協同組合	862 百万円	金融業務を営んでいます。

いのま野農業協同組合	5,616 百万円	金融業務を営んでいます。
くまがや農業協同組合	2,706 百万円	金融業務を営んでいます。
さいかつ農業協同組合	1,832 百万円	金融業務を営んでいます。
東京中央農業協同組合	1,147 百万円	金融業務を営んでいます。
横浜農業協同組合	11,721 百万円	金融業務を営んでいます。
セレサ川崎農業協同組合	2,485 百万円	金融業務を営んでいます。
よこすか葉山農業協同組合	1,358 百万円	金融業務を営んでいます。
さがみ農業協同組合	5,060 百万円	金融業務を営んでいます。
湘南農業協同組合	3,195 百万円	金融業務を営んでいます。
秦野市農業協同組合	1,640 百万円	金融業務を営んでいます。
かながわ西湘農業協同組合	2,384 百万円	金融業務を営んでいます。
厚木市農業協同組合	2,420 百万円	金融業務を営んでいます。
県央愛川農業協同組合	446 百万円	金融業務を営んでいます。
相模原市農業協同組合	841 百万円	金融業務を営んでいます。
神奈川つくり農業協同組合	762 百万円	金融業務を営んでいます。
信州うえだ農業協同組合	4,019 百万円	金融業務を営んでいます。
信州諏訪農業協同組合	6,255 百万円	金融業務を営んでいます。
上伊那農業協同組合	8,056 百万円	金融業務を営んでいます。
みなみ信州農業協同組合	4,372 百万円	金融業務を営んでいます。
中野市農業協同組合	2,527 百万円	金融業務を営んでいます。
ながの農業協同組合	12,995 百万円	金融業務を営んでいます。
黒部市農業協同組合	1,326 百万円	金融業務を営んでいます。
小松市農業協同組合	2,052 百万円	金融業務を営んでいます。
金沢市農業協同組合	3,108 百万円	金融業務を営んでいます。
ぎふ農業協同組合	7,118 百万円	金融業務を営んでいます。
ハイナン農業協同組合	819 百万円	金融業務を営んでいます。
あいち尾東農業協同組合	1,187 百万円	金融業務を営んでいます。
愛知北農業協同組合	744 百万円	金融業務を営んでいます。
あいち中央農業協同組合	3,589 百万円	金融業務を営んでいます。
鈴鹿農業協同組合	1,547 百万円	金融業務を営んでいます。
伊賀ふるさと農業協同組合	3,798 百万円	金融業務を営んでいます。
越前たけふ農業協同組合	3,000 百万円	金融業務を営んでいます。
兵庫六甲農業協同組合	5,666 百万円	金融業務を営んでいます。
あかし農業協同組合	423 百万円	金融業務を営んでいます。
兵庫南農業協同組合	3,721 百万円	金融業務を営んでいます。
みのり農業協同組合	4,264 百万円	金融業務を営んでいます。
兵庫みらい農業協同組合	3,411 百万円	金融業務を営んでいます。
加古川市南農業協同組合	497 百万円	金融業務を営んでいます。
兵庫西農業協同組合	12,627 百万円	金融業務を営んでいます。
相生市農業協同組合	102 百万円	金融業務を営んでいます。
丹波ひかみ農業協同組合	2,158 百万円	金融業務を営んでいます。
丹波ささやま農業協同組合	2,056 百万円	金融業務を営んでいます。
淡路日の出農業協同組合	1,844 百万円	金融業務を営んでいます。
晴れの国岡山農業協同組合	25,687 百万円	金融業務を営んでいます。
徳島市農業協同組合	3,991 百万円	金融業務を営んでいます。
長崎西彼農業協同組合	3,261 百万円	金融業務を営んでいます。
長崎県央農業協同組合	5,740 百万円	金融業務を営んでいます。

は「出資金」を記載しております。

2 【関係業務の概要】

(1) 受託会社：ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。

3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2022年12月末現在）

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

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

第3【その他】

(1)目論見書の表紙にロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、また使用開始日、ファンドの形態、申込みに係る事項、ファンド専用サイトのアドレス、ファンドの管理番号などを記載することができます。

(2)投資信託説明書（交付目論見書）に、以下の趣旨の文言の全部または一部および有価証券届出書の主要内容を記載することができます。

- ・ファンドに関する投資信託説明書（請求目論見書）を含む詳細な情報は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
- ・本書には、約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されています。
- ・ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- ・ファンドの商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認します。
- ・ファンドの財産は、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。
- ・請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。（請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようお願ひいたします。）
- ・有価証券届出書の効力の発生の有無については、委託会社のホームページにて確認いただけます。効力が発生するまでに、本書の記載内容が訂正される場合があります。

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。

(4)目論見書は電磁的方法により提供されるほか、インターネット、電子媒体等に掲載されることがあります。

(5)投信評価機関、投信評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することができます。

(6)目論見書は「投資信託説明書」を別称として使用します。

(7)目論見書に委託会社のホームページアドレス等を掲載し、当該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のご案内を記載することができます。

独立監査人の監査報告書

令和4年6月10日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員
公認会計士 青木 裕晃

指定有限責任社員
業務執行社員
公認会計士 伊藤 鉄也

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の令和4年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

（注）1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

令和4年8月31日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会御中

PwC あらた有限責任監査法人
東京事務所
指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 和田 渉
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているヘッジ付先進国株式インデックス・オープン(ラップ向け)の令和4年1月27日から令和4年6月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン(ラップ向け)の令和4年6月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

（注）1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

令和4年12月2日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社
員 業務執
行社員 公認会計士 青木裕晃

指定有限責任社
員 業務執
行社員 公認会計士 伊藤鉄也

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の令和4年4月1日から令和5年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（令和4年4月1日から令和4年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の令和4年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（令和4年4月1日から令和4年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる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。

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

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、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

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

以上

（注）1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

令和5年3月1日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人
東京事務所
指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員

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」に掲げられているヘッジ付先進国株式インデックス・オープン(ラップ向け)の令和4年6月28日から令和4年12月27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、ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン(ラップ向け)の令和4年12月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(令和4年6月28日から令和4年12月27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、三菱UFJ国際投信株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、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

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

以上

-
- (注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
 - 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。