

## 【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4月25日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	上坪 直樹
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	インデックスコレクション（外国株式）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

インデックスコレクション（外国株式）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

### （７）【申込期間】

2023年 4月26日から2023年10月25日までとします。

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

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

**( 9 ) 【払込期日】**

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

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

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

**( 11 ) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**( 12 ) 【その他】**

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所）で金融商品取引所（金融商品取引法第28条第8項第3号の取

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (日本を除く)	ファミリー ファンド ファンド・ オブ・ファン ズ	あり ( ) なし	日経225 TOPIX その他 (MSCI コクサイ・ インデック ス(配当込 み、円ペー ス))	ブル・ベア型 条件付運用型 ロング・ ショート型/絶 対収益追求型 その他 ( )
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ( )	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東)				
不動産投信 ( )	その他 ( )					
その他資産 (投資信託証券 (株式一 般))						
資産複合 ( ) 資産配分 固定型 資産配分 変更型						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。  
属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円で為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

#### [ 投資対象地域による区分 ]

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

#### [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

#### [ 独立した区分 ]

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

#### [ 補足分類 ]

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

#### < 属性区分表定義 >

#### [ 投資対象資産による属性区分 ]

##### (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

う。

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

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

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



資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

- (6) オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7) 中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8) アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9) 中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10) エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

#### [ 投資形態による属性区分 ]

- (1) ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2) ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

- (1) 為替ヘッジあり...目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
- (2) 為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

#### [ 特殊型 ]

- (1) ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3) ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4) その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

#### < ファンドの特色 >

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

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)とは

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

#### マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

### ファンドのしくみ

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



### 分配方針

- 年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。
- 分配対象額は、経費控除後の配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- 収益分配金は、自動的にファンドの受益権に再投資されます。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

### 主な投資制限

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

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2010年10月20日

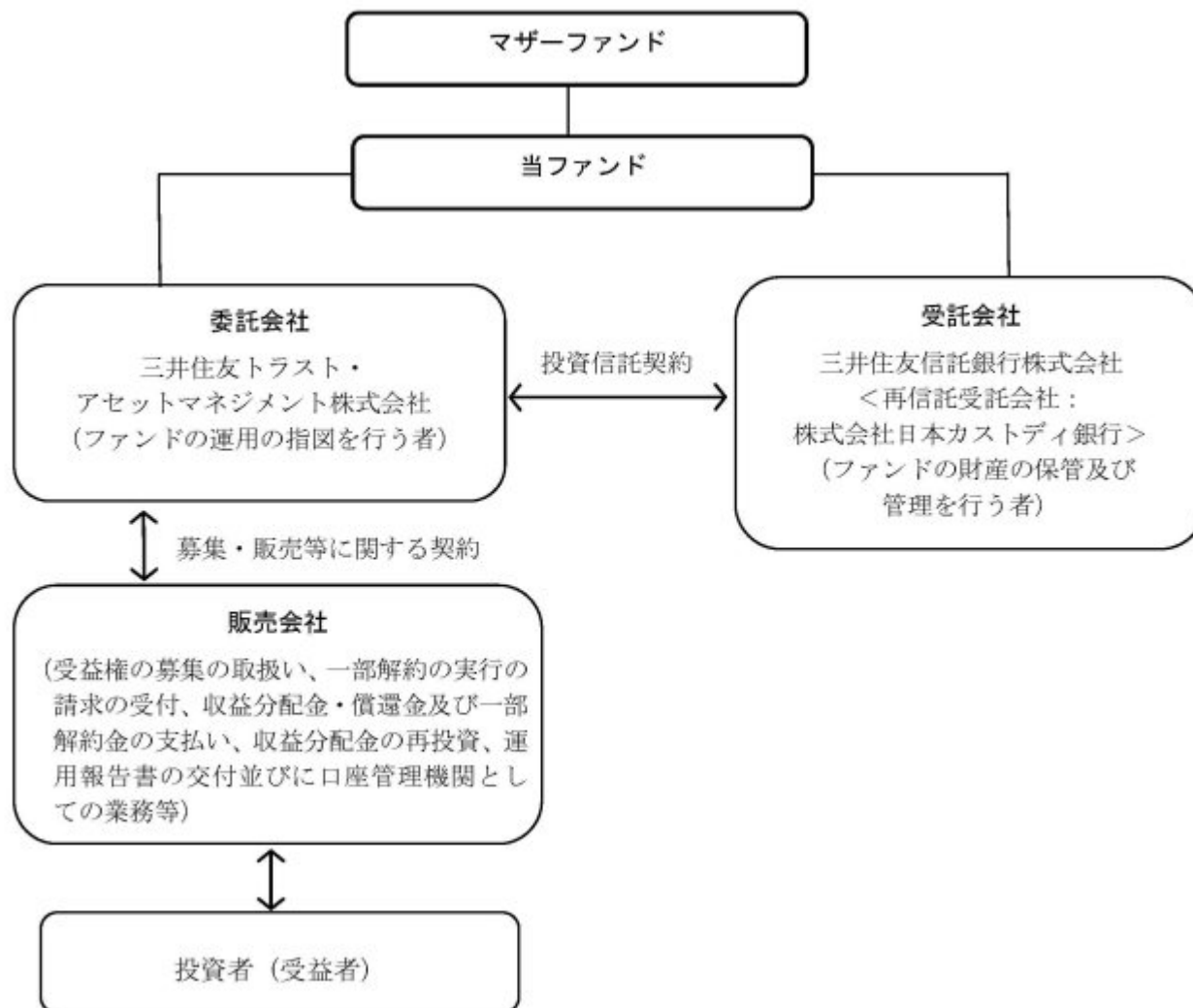
信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

2012年4月1日

当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継  
 当ファンドの名称を中央三井インデックスコレクション（外国株式）からインデックスコレクション（外国株式）に変更  
 当ファンドの主要投資対象である中央三井外国株式マザーファンドの名称を外国株式マザーファンドに変更

### （３）【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2023年2月28日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

1986年11月1日：	住信キャピタルマネジメント株式会社設立
1987年2月20日：	投資顧問業の登録
1987年9月9日：	投資一任契約に係る業務の認可
1990年10月1日：	住信投資顧問株式会社に商号変更
1999年2月15日：	住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
1999年3月25日：	証券投資信託委託業の認可
2007年9月30日：	金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）

2012年4月1日： 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更

2018年10月1日： 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

#### 八．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### 運用方針

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

#### 投資態度

- A．株式への実質投資は、わが国を除く世界の主要国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- B．株式への実質投資割合は、原則として高位（90%以上）とします。
- C．実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として、為替予約取引等を活用する場合があります。
- D．運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- E．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- F．資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。
- G．国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- H．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- I．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

### (2)【投資対象】

#### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- A．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
- 1．有価証券
  - 2．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限りません。）
  - 3．金銭債権（上記1．、2．及び下記4．に掲げるものに該当するものを除きます。）
  - 4．約束手形（上記1．に掲げるものに該当するものを除きます。）
- B．次に掲げる特定資産以外の資産
- 1．為替手形
- 運用指図できる投資対象である有価証券
- 委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「外国株式マザーファンド」の受益証券及び次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。
- 1．株券又は新株引受権証券
  - 2．国債証券
  - 3．地方債証券
  - 4．特別の法律により法人の発行する債券
  - 5．社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
  - 6．資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  - 7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
  - 8．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証券
  - 9．資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
  - 10．コマーシャル・ペーパー
  - 11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
  - 12．外国又は外国の者の発行する証券又は証券で、上記1．から11．までの証券又は証券の性質を有するもの
  - 13．投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。）
  - 14．投資証券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
  - 15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  - 16．オプションを表示する証券又は証券（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せん。）
  - 17．預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  - 18．外国法人が発行する譲渡性預金証券
  - 19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
  - 20．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
  - 21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - 22．外国の者に対する権利で上記21．の有価証券の性質を有するもの
- なお、上記1．の証券又は証券並びに上記12．及び17．の証券又は証券のうち上記1．の証券又は

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

運用指図できる金融商品

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

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

B．金融商品による運用の特例

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

（参考）マザーファンドの概要

「外国株式マザーファンド」の概要

#### 1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

#### 2．運用方法

##### （1）投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

##### （2）投資態度

M S C Iコクサイ・インデックスに採用されている国の株式に投資を行い、同インデックス（配当込み、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことができます。

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

できます。

### 3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

#### （3）【運用体制】

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





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

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

#### (4) 【分配方針】

年1回の毎決算時（決算日は7月25日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

- ・分配対象額は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）及び売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額。）等の全額とします。なお、前期から繰り越された分配準備積立金及び収益調整金は、全額分配に使用することがあります。
- ・分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

- ・収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## （５）【投資制限】

### <約款に定める投資制限>

#### A．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

#### B．株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

#### C．新株引受権証券等への投資割合

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

#### D．同一銘柄の株式への投資割合

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

#### E．同一銘柄の転換社債等への投資割合

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

#### F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

#### G．投資信託証券への投資割合

投資信託証券（マザーファンド及び上場投資信託を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

#### H．投資する株式等の範囲

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

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

#### I．信用取引の指図範囲

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

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

- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- Ｊ．先物取引等の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
- ロ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ハ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- Ｋ．スワップ取引の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- Ｌ．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引及び為替先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- Ｍ．有価証券の貸付の指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の
- a．及びb．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
- a．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- b．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．a．及びb．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- Ｎ．公社債の空売りの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下

記O.の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができますものとしします。

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

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

#### O. 公社債の借入れの指図及び範囲

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

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

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

ニ.上記イ.の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

#### P. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### Q. 外国為替予約取引の指図

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

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

ハ.信託財産の一部解約等の事由により、上記□.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します。

#### R. 一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

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

#### S. 再投資の指図

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

#### T. 資金の借入れ

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

#### ウ．受託会社による資金の立替え

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

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

ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。

#### ヴ．利害関係人等との取引等

イ．受託会社は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、信託財産と、受託会社（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託会社が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）及び受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下イ．及び下記ロ．において同じ。）の信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託会社における他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記イ．からロ．まで及びQ．からT．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

ロ．受託会社は、受託会社が当ファンドの受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託会社又は受託会社の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託会社の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

ハ．委託会社は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託会社、その取締役、執行役及び委託会社の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）又は委託会社が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記イ．からロ．まで及びQ．からT．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができます。受託会社は、委託会社の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。

ニ．上記イ．からハ．までの場合、委託会社及び受託会社は、受益者に対して信託法第31条第3項及び同法第32条第3項の通知は行いません。

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

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

### < 関連法令に基づく投資制限 >

#### イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### （1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### 為替変動リスク

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

##### 信用リスク

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

##### 流動性リスク

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

##### カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

### < その他の留意点 >

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

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

分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われ

ると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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

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

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

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

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

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

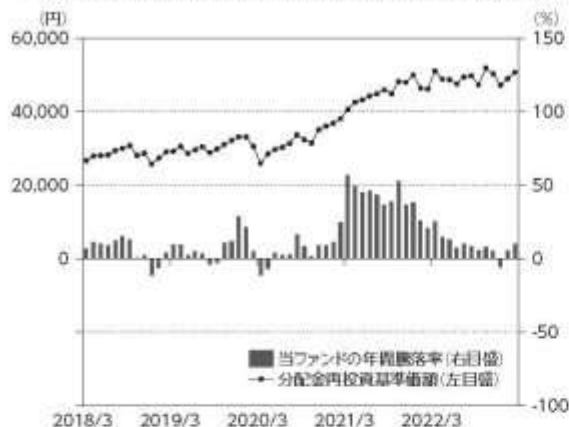
## （２）リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

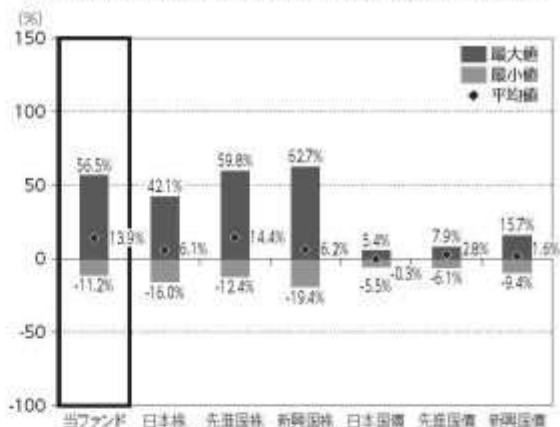
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*2018年3月～2023年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

## 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての優位性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動性ベースの時価総額法により算出されます。[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中絶に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIロクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIロクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村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公表する、国債で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された銘柄ポートフォリオのパフォーマンスを算出されます。同指数の知的財産権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に帰属します。なお、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は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのアドバイザーではなく、本ファンドの権限、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は遅延につき同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 J.P. Morganグローバル・ボイディング・エマージング・ マーケット・グロース・ディベース(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なくして本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金(解約)手数料】

<解約手数料>



ありません。

#### < 信託財産留保額 >

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（ ）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

#### （ 3 ）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.154%（税抜 0.14%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.099% （税抜 0.09%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.033% （税抜 0.03%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.022% （税抜 0.02%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

#### （ 4 ）【その他の手数料等】

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

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

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

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2023年 2月28日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

#### 5【運用状況】

以下は、2023年2月28日現在の状況について記載してあります。

#### 【インデックスコレクション（外国株式）】

##### （１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	78,672,825,497	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		39,115,991	0.05
合計(純資産総額)		78,711,941,488	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

##### （２）【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	16,665,852,963	4.5496	75,822,964,641	4.7206	78,672,825,497	99.95

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第3期計算期間末 (2013年 7月25日)	3,500,525,790	3,500,525,790	16,673	16,673
第4期計算期間末 (2014年 7月25日)	4,931,176,773	4,931,176,773	20,290	20,290
第5期計算期間末 (2015年 7月27日)	7,108,640,556	7,108,640,556	24,857	24,857
第6期計算期間末 (2016年 7月25日)	8,358,485,964	8,358,485,964	21,531	21,531
第7期計算期間末 (2017年 7月25日)	10,774,198,811	10,774,198,811	26,309	26,309
第8期計算期間末 (2018年 7月25日)	13,311,577,217	13,311,577,217	29,584	29,584
第9期計算期間末 (2019年 7月25日)	15,289,835,110	15,289,835,110	30,533	30,533
第10期計算期間末 (2020年 7月27日)	30,092,371,505	30,092,371,505	31,466	31,466
第11期計算期間末 (2021年 7月26日)	50,422,555,346	50,422,555,346	45,151	45,151
第12期計算期間末 (2022年 7月25日)	70,525,655,206	70,525,655,206	48,960	48,960
2022年 2月末日	60,665,985,947		46,180	
3月末日	68,623,708,672		51,092	
4月末日	66,798,816,667		48,903	
5月末日	67,869,466,810		48,765	
6月末日	68,344,417,803		47,615	
7月末日	71,592,214,586		49,484	
8月末日	72,955,554,986		49,818	
9月末日	70,328,175,259		47,371	
10月末日	78,491,118,430		51,903	
11月末日	76,788,418,198		50,365	
12月末日	72,748,014,051		47,273	

2023年 1月末日	76,188,881,234		49,050	
2月末日	78,711,941,488		50,764	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	0
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	0
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	0
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	0
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	0
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	64.9
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	21.7
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	22.5
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	13.4
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	22.2
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	12.4
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	3.2
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	3.1
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	43.5
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	8.4
第13期中間計算期間	2022年 7月26日～2023年 1月25日	0.1

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	777,905,019	622,145,962	2,099,493,600
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	802,343,640	471,521,956	2,430,315,284

第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	1,130,281,171	700,770,207	2,859,826,248
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	1,568,065,514	545,911,406	3,881,980,356
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	964,496,261	751,295,568	4,095,181,049
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	1,062,392,166	658,047,025	4,499,526,190
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	1,178,922,174	670,766,867	5,007,681,497
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	6,462,723,124	1,906,825,426	9,563,579,195
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	3,985,167,713	2,381,313,047	11,167,433,861
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	5,769,271,220	2,531,861,036	14,404,844,045
第13期中間計算期間	2022年 7月26日～2023年 1月25日	2,235,338,797	1,184,204,021	15,455,978,821

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

(参考)

## 外国株式マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	238,944,281,843	65.71
	イギリス	16,223,191,697	4.46
	カナダ	13,181,354,116	3.62
	フランス	12,333,313,872	3.39
	スイス	11,916,001,748	3.28
	ドイツ	9,176,493,459	2.52
	オーストラリア	7,695,627,321	2.12
	オランダ	7,068,240,781	1.94
	アイルランド	6,563,730,291	1.81
	スウェーデン	3,475,129,188	0.96
	デンマーク	3,215,908,061	0.88
	スペイン	2,859,771,088	0.79
	香港	2,254,442,429	0.62
	イタリア	2,002,612,226	0.55
	フィンランド	1,366,182,263	0.38
	シンガポール	1,228,241,887	0.34
	ジャージー	1,172,218,688	0.32
	ベルギー	925,599,594	0.25
	ノルウェー	775,129,616	0.21
	イスラエル	734,926,036	0.20
ケイマン	664,254,571	0.18	
キュラソー	562,737,957	0.15	
バミューダ	554,384,222	0.15	
ルクセンブルク	266,571,175	0.07	

	ニュージーランド	250,523,738	0.07
	オーストリア	218,422,500	0.06
	ポルトガル	183,700,800	0.05
	リベリア	126,507,047	0.03
	パナマ	84,953,681	0.02
	マン島	74,980,350	0.02
	小計	346,099,432,245	95.18
投資信託受益証券	オーストラリア	88,603,104	0.02
	香港	44,583,176	0.01
	小計	133,186,280	0.04
投資証券	アメリカ	6,712,981,102	1.85
	オーストラリア	457,966,661	0.13
	シンガポール	164,508,077	0.05
	フランス	163,316,976	0.04
	イギリス	150,655,369	0.04
	香港	95,270,729	0.03
	カナダ	44,761,992	0.01
	ベルギー	30,006,546	0.01
	小計	7,819,467,452	2.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,578,005,637	2.63
合計(純資産総額)		363,630,091,614	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,693,129,166	2.12
	買建	カナダ	440,832,823	0.12
	買建	ドイツ	1,568,942,419	0.43
	買建	イギリス	377,661,948	0.10
	買建	オーストラリア	312,857,467	0.09

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		1,905,435,798	0.52
	売建		127,619,372	0.04

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	852,213	20,685.35	17,628,324,946	20,165.93	17,185,670,771	4.73
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	375,818	35,005.45	13,155,679,749	34,104.31	12,817,014,628	3.52
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	486,498	13,930.19	6,777,014,148	12,782.30	6,218,563,775	1.71
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	132,418	28,750.63	3,807,101,413	32,038.91	4,242,528,821	1.17
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	141,703	26,551.63	3,762,445,739	28,306.19	4,011,073,161	1.10
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	318,772	14,028.35	4,471,847,417	12,251.97	3,905,587,244	1.07
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	294,920	14,106.06	4,160,160,719	12,283.33	3,622,600,568	1.00
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	221,643	15,232.15	3,376,099,621	15,071.28	3,340,444,045	0.92
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	49,740	64,789.46	3,222,628,198	65,891.01	3,277,419,116	0.90
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	155,995	19,347.95	3,018,184,021	19,380.67	3,023,288,053	0.83
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	139,834	22,270.86	3,114,224,668	21,217.03	2,966,863,278	0.82
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	69,208	42,048.26	2,910,076,109	41,534.29	2,874,505,682	0.79
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	121,381	25,365.55	3,078,897,014	23,113.38	2,805,526,173	0.77
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	86,992	31,279.55	2,721,071,066	30,040.31	2,613,267,126	0.72
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	126,953	19,277.06	2,447,280,852	18,968.95	2,408,165,896	0.66
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	146,347	16,240.40	2,376,734,755	15,826.67	2,316,186,435	0.64
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	45,913	50,847.00	2,334,538,315	48,462.58	2,225,062,821	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	54,487	44,889.37	2,445,887,599	40,355.04	2,198,825,244	0.60
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	98,959	23,127.02	2,288,626,891	22,197.25	2,196,617,722	0.60
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	134,895	14,182.40	1,913,136,184	14,909.04	2,011,156,138	0.55

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	94,161	19,770.57	1,861,617,263	21,032.99	1,980,487,597	0.54
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	21,642	89,744.96	1,942,260,554	86,115.25	1,863,706,349	0.51
アメリカ	株式	LILLY (ELI) & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	42,999	46,033.18	1,979,381,042	43,164.80	1,856,043,433	0.51
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	385,185	4,958.32	1,909,871,298	4,663.84	1,796,444,793	0.49
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	218,827	8,202.97	1,795,032,651	8,155.26	1,784,591,211	0.49
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	73,517	23,424.22	1,722,078,426	23,981.81	1,763,070,748	0.48
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	88,202	18,613.94	1,641,786,736	19,632.07	1,731,588,015	0.48
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	21,504	81,975.22	1,762,795,324	79,814.39	1,716,328,825	0.47
フランス	株式	LVMH	耐久消費財・アパレル	14,740	117,741.46	1,735,509,150	114,936.02	1,694,157,053	0.47
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	298,935	5,965.80	1,783,386,662	5,559.53	1,661,940,313	0.46

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.50
		素材	4.31
		資本財	6.62
		商業・専門サービス	1.17
		運輸	1.88
		自動車・自動車部品	1.99
		耐久消費財・アパレル	1.67
		消費者サービス	1.97
		メディア・娯楽	4.89
		小売	4.30
		食品・生活必需品小売り	1.49
		食品・飲料・タバコ	4.16
		家庭用品・パーソナル用品	1.74
		ヘルスケア機器・サービス	4.64
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.66		



	銀行	6.21
	各種金融	4.76
	保険	3.30
	不動産	0.38
	ソフトウェア・サービス	10.25
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.15
	電気通信サービス	1.42
	公益事業	2.95
	半導体・半導体製造装置	4.76
	小計	95.18
投資信託受益証券		0.04
投資証券		2.15
合計		97.37

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	283	アメリカドル	58,164,371.5	7,929,548,767	56,430,200	7,693,129,166	2.12
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	18	カナダドル	4,474,545.5	449,154,877	4,391,640	440,832,823	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	33	スイスフラン	3,687,895	537,252,543	3,673,890	535,212,295	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	168	ユーロ	7,083,704.5	1,024,374,508	7,148,400	1,033,730,124	0.28
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	19	オーストラリアドル	3,540,771	325,396,854	3,404,325	312,857,467	0.09
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	29	イギリスポンド	2,273,347.5	373,829,263	2,296,655	377,661,948	0.10

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
----	-------	---------	----	--------	--------	----------

為替予約取引	アメリカドル	買建	10,691,600.00	1,427,022,218	1,455,709,142	0.40
	カナダドル	買建	362,000.00	36,328,401	36,328,256	0.01
	ユーロ	買建	1,500,000.00	211,796,940	216,695,760	0.06
	イギリスポンド	買建	610,000.00	98,429,593	100,206,000	0.03
	スイスフラン	買建	400,000.00	58,270,120	58,268,560	0.02
	香港ドル	買建	2,200,000.00	38,228,520	38,228,080	0.01
	アメリカドル	売建	502,000.00	68,387,209	68,428,172	0.02
	イギリスポンド	売建	360,000.00	58,642,884	59,191,200	0.02

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

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

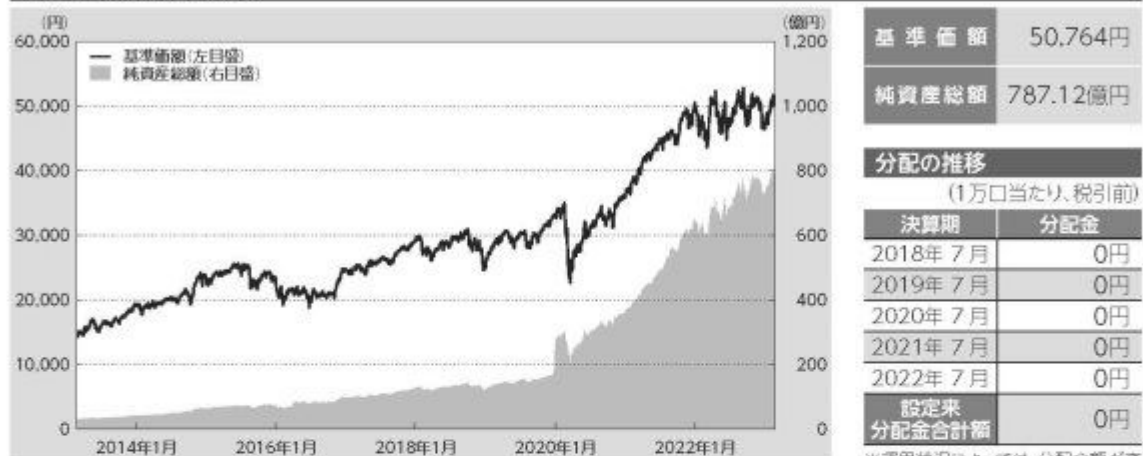
#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


**運用実績**

当初設定日：2010年10月20日

作成基準日：2023年2月28日

**基準価額・純資産の推移**

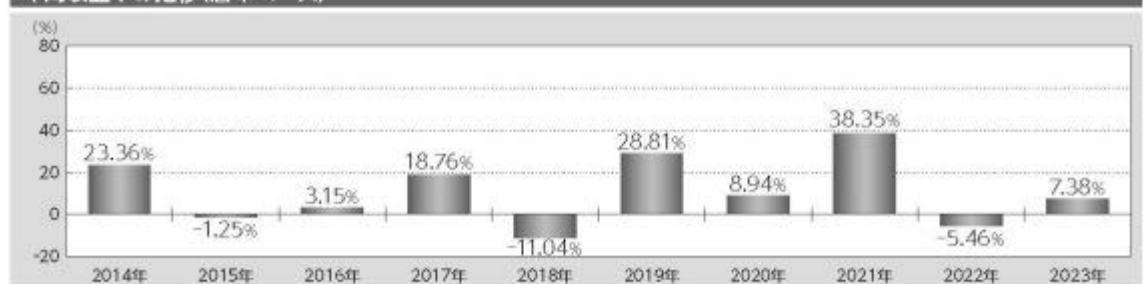
※上記グラフは作成基準日以前の最近10年間を表示しております。

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

**主要な資産の状況**

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.7%
MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	3.5%
AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	1.7%
NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	1.2%
TESLA INC	アメリカ	株式	自動車・自動車部品	1.1%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	メディア・娯楽	1.1%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	メディア・娯楽	1.0%
EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	0.9%
UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア機器・サービス	0.9%
JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	銀行	0.8%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移(暦年ベース)**

※2023年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

**第2【管理及び運営】****1【申込（販売）手続等】****< 申込手続 >**

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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

#### < 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

ありません。

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2 【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

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

< 一部解約代金の支払い >

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

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

< 受付不可日 >

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

とします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

#### <一部解約受付の中止等>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことができます。

一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記<解約価額>の規定に準じて計算された価額とします。

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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

**< 基準価額の算出頻度 >**

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

**< 主要な投資対象資産の評価方法 >****A．親投資信託受益証券（外国株式マザーファンド）の評価方法**

計算日の基準価額で評価します。

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

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

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

**< 基準価額の照会方法 >**

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

**（2）【保管】**

該当事項はありません。

**（3）【信託期間】**

無期限とします。（2010年10月20日設定）

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

**（4）【計算期間】**

当ファンドの計算期間は、毎年7月26日から翌年7月25日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は2010年10月20日から2011年7月25日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

**（5）【その他】**

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・受益権の口数が30億口を下回るようになった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

## (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還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、この投資信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）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、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の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以上に当たる多数をもって行います。

上記 から までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記 から までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

## <投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

### (1)投資信託約款の変更等

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更すること又は受託会社を同一とする他のファンドとの併合を行うことができます。

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

委託会社は、投資信託約款の変更又はファンドの併合を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

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

### (2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）又はファンドの併合について、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（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は除きます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及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、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

上記からまでの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して投資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、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >に従い、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、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

### (3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

### (4) 帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期計算期間(2021年7月27日から2022年7月25日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【インデックスコレクション（外国株式）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 （2021年 7月26日現在）	第12期 （2022年 7月25日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	251,911,760	167,321,370
親投資信託受益証券	50,398,037,359	70,489,921,325
未収入金	-	32,788,246
流動資産合計	50,649,949,119	70,690,030,941
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	193,292,061	113,834,056
未払受託者報酬	4,750,051	7,090,317
未払委託者報酬	28,500,252	42,541,835
未払利息	452	68
その他未払費用	850,957	909,459
流動負債合計	227,393,773	164,375,735
負債合計	227,393,773	164,375,735
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	11,167,433,861	14,404,844,045
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	39,255,121,485	56,120,811,161
（分配準備積立金）	15,416,191,886	17,005,425,851
元本等合計	50,422,555,346	70,525,655,206
純資産合計	50,422,555,346	70,525,655,206
負債純資産合計	50,649,949,119	70,690,030,941

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自	2020年 7月28日	自	2021年 7月27日
	至	2021年 7月26日	至	2022年 7月25日
営業収益				
受取利息		486		1,418
有価証券売買等損益		14,090,727,498		4,862,596,888
営業収益合計		14,090,727,984		4,862,598,306
営業費用				
支払利息		36,325		53,894
受託者報酬		8,474,403		13,526,291
委託者報酬		50,846,291		81,157,607
その他費用		1,692,538		1,818,829
営業費用合計		61,049,557		96,556,621
営業利益又は営業損失（ ）		14,029,678,427		4,766,041,685
経常利益又は経常損失（ ）		14,029,678,427		4,766,041,685
当期純利益又は当期純損失（ ）		14,029,678,427		4,766,041,685
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（ ）		1,281,720,980		436,726,551
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		20,528,792,310		39,255,121,485
剰余金増加額又は欠損金減少額		11,237,789,837		21,520,725,406
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		11,237,789,837		21,520,725,406
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,259,418,109		8,984,350,864
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,259,418,109		8,984,350,864
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		39,255,121,485		56,120,811,161

## ( 3 ) 【注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月26日から翌年7月25日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第12期計算期間は2021年 7月27日から2022年 7月25日までとなっております。

( 貸借対照表に関する注記 )

	第11期 (2021年 7月26日現在)	第12期 (2022年 7月25日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	11,167,433,861口	14,404,844,045口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 4.5151円 (45,151円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 4.8960円 (48,960円)

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第11期 自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26日			第12期 自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	626,067,808円	費用控除後の配当等収益額	A	1,015,087,764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	12,121,889,639円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	3,314,227,370円
収益調整金額	C	23,838,929,599円	収益調整金額	C	39,115,385,310円
分配準備積立金額	D	2,668,234,439円	分配準備積立金額	D	12,676,110,717円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	39,255,121,485円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	56,120,811,161円
当ファンドの期末残存口数	F	11,167,433,861口	当ファンドの期末残存口数	F	14,404,844,045口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	35,151円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	38,959円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	第12期 自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第12期 (2022年 7月25日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第11期	第12期
	自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26日	自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	9,563,579,195円	11,167,433,861円
期中追加設定元本額	3,985,167,713円	5,769,271,220円
期中一部解約元本額	2,381,313,047円	2,531,861,036円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第11期 (2021年 7月26日現在)	第12期 (2022年 7月25日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	13,913,420,610	4,853,404,387
合計	13,913,420,610	4,853,404,387

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----



親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	15,497,740,156	70,489,921,325	
合計		15,497,740,156	70,489,921,325	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

### 外国株式マザーファンド

#### 貸借対照表

	2022年 7月25日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	11,713,050,257
コール・ローン	1,202,851,169
株式	316,506,290,789
投資信託受益証券	155,312,858
投資証券	7,898,160,473
派生商品評価勘定	658,129,920
未収入金	900,597
未収配当金	257,487,435
差入委託証拠金	2,597,719,090
流動資産合計	340,989,902,588
資産合計	340,989,902,588
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	23,506,136
前受金	633,624,147
未払金	75,787,731
未払解約金	316,756,134
未払利息	489
流動負債合計	1,049,674,637
負債合計	1,049,674,637
純資産の部	
元本等	
元本	74,737,903,542
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	265,202,324,409
元本等合計	339,940,227,951
純資産合計	339,940,227,951

	2022年 7月25日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	340,989,902,588

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 7月25日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

	2022年 7月25日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	2022年 7月25日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	74,737,903,542口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 4.5484円 (1万口当たり純資産額) (45,484円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2022年 7月25日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

2022年 7月25日現在	
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年 7月25日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 7月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月27日
期首元本額	71,393,866,315円
期中追加設定元本額	10,254,343,464円
期中一部解約元本額	6,910,306,237円
期末元本額	74,737,903,542円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,501,737,362円
DC外国株式インデックスファンド	4,930,068,182円
DC外国株式インデックスファンドL	26,567,544,991円
DCバランスファンド30	624,049,609円
DCバランスファンド50	1,273,774,419円
DCバランスファンド70	848,922,838円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	280,613,499円
外国株式インデックスe	4,643,197,789円
インデックスコレクション（外国株式）	15,497,740,156円
インデックスコレクション（バランス株式30）	3,226,454,916円
インデックスコレクション（バランス株式50）	993,587,637円
インデックスコレクション（バランス株式70）	988,800,641円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,159,235,680円
外国株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	1,454,871,125円
私募外国株式パッシブファンド2（適格機関投資家専用）	121,218,009円
外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	411,378,539円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	24,271,476円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	253,567,627円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	32,198,407円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	63,987,171円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	214,525,728円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	226,390,032円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	179,029,005円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	3,505,753,100円

区分	2022年 7月25日現在
バランスVA75（適格機関投資家専用）	397,490,537円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	99,067,016円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	580,776,846円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	12,100,023円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	71,004,389円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	76,482,382円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	235,274,348円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	9,926,313円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	60,401,569円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	167,291,998円
私募外国株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	5,170,183円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 7月25日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	41,026,029,546
投資信託受益証券	8,048,363
投資証券	763,971,592
合計	41,781,952,775

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2022年 7月25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	14,868,459,527	-	15,502,083,674	633,624,147
合計		14,868,459,527	-	15,502,083,674	633,624,147

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2022年 7月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,107,570,907	-	1,108,084,884	513,977
	アメリカドル	780,642,352	-	778,835,422	1,806,930
	ユーロ	164,905,560	-	166,975,800	2,070,240
	イギリスポンド	162,022,995	-	162,273,662	250,667
	売建	96,119,660	-	95,634,000	485,660
	アメリカドル	96,119,660	-	95,634,000	485,660
合計		1,203,690,567	-	1,203,718,884	999,637

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	17,739	32.41	574,920.99	
	BAKER HUGHES CO	47,945	24.08	1,154,515.60	
	CHENIERE ENERGY INC	11,266	134.10	1,510,770.60	
	CHEVRON CORP	96,745	144.19	13,949,661.55	
	CONOCOPHILLIPS	64,539	88.13	5,687,822.07	
	COTERRA ENERGY INC	41,058	27.71	1,137,717.18	
	DEVON ENERGY CORPORATION	31,794	55.19	1,754,710.86	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	8,090	113.43	917,648.70	
	EOG RESOURCES INC	28,920	101.00	2,920,920.00	
	EQT CORPORATION	17,321	42.23	731,465.83	
	EXXON MOBIL	210,256	87.08	18,309,092.48	
	HALLIBURTON CO	44,379	27.46	1,218,647.34	
	HESS CORP	13,850	101.39	1,404,251.50	
	KINDER MORGAN INC	100,765	17.65	1,778,502.25	
	MARATHON OIL CORP	36,460	21.75	793,005.00	

MARATHON PETROLEUM CORP	27,282	85.65	2,336,703.30
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	46,140	61.06	2,817,308.40
ONEOK INC	22,489	57.99	1,304,137.11
PHILLIPS 66	24,061	84.53	2,033,876.33
PIONEER NATURAL RESOURCES	11,583	209.80	2,430,113.40
SCHLUMBERGER	69,679	35.07	2,443,642.53
TARGA RESOURCES CORP	11,099	61.71	684,919.29
VALERO ENERGY CORP	20,210	104.02	2,102,244.20
WILLIAMS COS	60,051	32.34	1,942,049.34
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	10,917	234.56	2,560,691.52
ALBEMARLE CORP	5,885	221.46	1,303,292.10
ALCOA CORP	9,533	45.80	436,611.40
AMCOR PLC	72,748	12.60	916,624.80
AVERY DENNISON CORP	4,144	175.30	726,443.20
BALL CORP	15,147	70.71	1,071,044.37
CELANESE CORP-SERIES A	5,419	113.34	614,189.46
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	84.81	880,242.99
CLEVELAND-CLIFFS INC	27,048	15.62	422,489.76
CORTEVA INC	36,448	54.01	1,968,556.48
CROWN HOLDINGS INC	6,218	94.93	590,274.74
DOW INC	36,681	50.85	1,865,228.85
DUPONT DE NEMOURS INC	25,064	57.26	1,435,164.64
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,266	93.07	583,176.62
ECOLAB INC	12,620	162.99	2,056,933.80
FMC CORP	5,984	105.90	633,705.60
FREEMPORT-MCMORAN INC	72,123	27.76	2,002,134.48
INT'L PAPER CO	17,345	43.19	749,130.55
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	12,588	122.26	1,539,008.88
LINDE PLC	25,501	285.54	7,281,555.54
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,234	86.80	1,148,711.20
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,168	326.21	1,033,433.28
MOSAIC CO/THE	18,682	47.64	890,010.48
NEWMONT CORPORATION	40,062	51.39	2,058,786.18
NUCOR CORP	13,230	119.86	1,585,747.80
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,374	141.60	619,358.40
PPG INDUSTRIES INC	11,826	127.73	1,510,534.98
RPM INTERNATIONAL INC	5,987	86.11	515,540.57
SEALED AIR CORP	7,368	59.11	435,522.48
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	12,375	259.01	3,205,248.75
STEEL DYNAMICS INC	9,667	66.60	643,822.20
VULCAN MATERIALS CO	6,735	155.65	1,048,302.75
WESTLAKE CORP	2,096	91.81	192,433.76



WESTROCK CO	12,132	41.33	501,415.56
3 M COMPANY	28,021	134.12	3,758,176.52
AERCAP HOLDINGS NV	7,161	42.98	307,779.78
ALLEGION PLC	4,638	103.39	479,522.82
AMETEK INC	11,723	115.33	1,352,013.59
BOEING CO	27,320	158.16	4,320,931.20
CARRIER GLOBAL CORP	41,014	38.50	1,579,039.00
CATERPILLAR	26,471	178.62	4,728,250.02
CUMMINS INC	6,913	205.20	1,418,547.60
DEERE&CO	14,394	312.26	4,494,670.44
DOVER CORP	7,491	128.64	963,642.24
EATON CORP	19,500	136.65	2,664,675.00
EMERSON ELECTRIC CO	29,379	83.10	2,441,394.90
FASTENAL CO	29,312	48.46	1,420,459.52
FORTIVE CORP	16,407	58.42	958,496.94
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,412	68.41	438,644.92
GENERAC HOLDINGS INC	2,918	239.93	700,115.74
GENERAL DYNAMICS CORP	11,819	216.76	2,561,886.44
GENERAL ELECTRIC CO	54,947	68.19	3,746,835.93
GRAINGER (WW) INC	2,333	473.88	1,105,562.04
HEICO CORP	2,252	143.20	322,486.40
HEICO CORP-CLASS A	3,318	115.12	381,968.16
HONEYWELL INTL INC	34,145	181.47	6,196,293.15
HOWMET AEROSPACE INC	18,227	34.36	626,279.72
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	208.73	415,998.89
IDEX CORP	3,505	192.77	675,658.85
ILLINOIS TOOL WORKS	15,483	191.56	2,965,923.48
INGERSOLL-RAND INC	20,847	44.54	928,525.38
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,600	55.30	530,880.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	33,831	50.78	1,717,938.18
KORNIT DIGITAL LTD	2,600	26.19	68,094.00
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	9,818	225.13	2,210,326.34
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,584	227.66	360,613.44
LOCKHEED MARTIN CORP	12,232	394.74	4,828,459.68
MASCO CORP	12,110	56.31	681,914.10
NORDSON CORP	2,536	219.67	557,083.12
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,408	451.85	3,347,304.80
OTIS WORLDWIDE CORP	21,403	71.90	1,538,875.70
OWENS CORNING	4,965	84.04	417,258.60
PACCAR INC	17,559	84.73	1,487,774.07
PARKER HANNIFIN CORP	6,517	267.87	1,745,708.79
PENTAIR PLC	7,637	46.99	358,862.63

PLUG POWER INC	23,605	17.64	416,392.20
QUANTA SERVICES INC	7,500	133.06	997,950.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	74,482	94.21	7,016,949.22
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,882	221.60	1,303,451.20
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,602	44.29	336,692.58
SMITH (A.O.) CORP	6,846	59.00	403,914.00
SNAP-ON INC	2,772	213.27	591,184.44
STANLEY BLACK&DECKER	8,223	115.70	951,401.10
TEXTRON	10,911	63.83	696,449.13
TRANE TECHNOLOGIES PLC	11,217	139.22	1,561,630.74
TRANSDIGM GROUP INC	2,661	581.12	1,546,360.32
UNITED RENTALS INC	3,678	274.29	1,008,838.62
WABTEC CORP	8,356	85.91	717,863.96
XYLEM INC	8,363	84.34	705,335.42
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	6,342	94.27	597,860.34
CINTAS CORP	4,794	396.73	1,901,923.62
CLARIVATE PLC	15,370	14.40	221,328.00
COPART INC	10,801	121.97	1,317,397.97
COSTAR GROUP INC	20,002	61.81	1,236,323.62
EQUIFAX INC	6,176	200.85	1,240,449.60
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,004	129.52	777,638.08
LEIDOS HOLDINGS	6,238	101.45	632,845.10
REPUBLIC SERVICES INC	11,169	131.02	1,463,362.38
ROBERT HALF INTL INC	5,212	77.05	401,584.60
ROLLINS INC	10,710	36.47	390,593.70
TRANSUNION	8,818	88.46	780,040.28
VERISK ANALYTICS INC	8,140	184.78	1,504,109.20
WASTE CONNECTIONS INC	12,957	126.26	1,635,950.82
WASTE MANAGEMENT INC	20,741	154.93	3,213,403.13
AMERCO	564	496.57	280,065.48
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,274	101.99	639,885.26
CSX CORP	107,460	30.89	3,319,439.40
DELTA AIR LINES INC	7,841	31.35	245,815.35
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,850	101.17	794,184.50
FEDEX CORP	12,306	227.30	2,797,153.80
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	54,628	2.73	149,134.44
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,907	173.75	678,841.25
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,000	51.17	358,190.00
LYFT INC-A	11,829	13.54	160,164.66
NORFOLK SOUTHERN CORP	11,893	243.10	2,891,188.30
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,619	278.96	1,288,516.24
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,754	40.24	271,780.96

UBER TECHNOLOGIES INC	71,603	23.30	1,668,349.90
UNION PACIFIC CORP	31,614	213.40	6,746,427.60
UNITED PARCEL SERVICE B	36,774	187.98	6,912,776.52
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	5,000	45.39	226,950.00
APTIV PLC	13,457	97.63	1,313,806.91
BORGWARNER INC	11,533	36.41	419,916.53
FORD MOTOR COMPANY	192,833	12.82	2,472,119.06
GENERAL MOTORS CO	69,921	34.67	2,424,161.07
LEAR CORP	2,989	141.17	421,957.13
LUCID GROUP INC	20,820	19.68	409,737.60
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	8,920	32.48	289,721.60
TESLA INC	43,619	816.73	35,624,945.87
DR HORTON INC	16,141	77.39	1,249,151.99
GARMIN LTD	7,784	104.95	816,930.80
HASBRO INC	6,002	81.13	486,942.26
LENNAR CORP-CL A	12,818	83.08	1,064,919.44
LULULEMON ATHLETICA INC	5,782	304.50	1,760,619.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,830	134.82	381,540.60
NEWELL BRANDS INC	17,598	20.19	355,303.62
NIKE B	63,624	109.12	6,942,650.88
NVR INC	164	4,552.61	746,628.04
PELOTON INTERACTIVE INC-A	12,862	9.77	125,661.74
PULTE GROUP INC	12,386	45.91	568,641.26
VF CORP	16,318	47.46	774,452.28
WHIRLPOOL CORP	3,060	167.77	513,376.20
AIRBNB INC-CLASS A	17,083	103.97	1,776,119.51
ARAMARK	11,643	31.97	372,226.71
BOOKING HOLDINGS INC	2,039	1,809.88	3,690,345.32
CAESARS ENTERTAINMENT INC	9,663	42.65	412,126.95
CARNIVAL CORPORATION	42,799	9.26	396,318.74
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,390	1,347.33	1,872,788.70
DARDEN RESTAURANTS INC	6,041	121.35	733,075.35
DOMINO'S PIZZA INC	1,797	399.27	717,488.19
EXPEDIA GROUP INC	7,394	99.38	734,815.72
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	13,745	120.83	1,660,808.35
LAS VEGAS SANDS CORP	15,969	38.99	622,631.31
MARRIOTT INTL A	13,789	150.91	2,080,897.99
MCDONALD'S CORP	36,983	253.99	9,393,312.17
MGM RESORTS INTERNATIONAL	18,299	30.94	566,171.06
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,621	34.87	370,354.27
STARBUCKS CORP	56,825	83.59	4,750,001.75
VAIL RESORTS INC	1,853	230.69	427,468.57

WYNN RESORTS LTD	5,210	61.73	321,613.30
YUM BRANDS INC	14,073	119.45	1,681,019.85
ACTIVISION BLIZZARD INC	38,655	79.23	3,062,635.65
ALPHABET INC-CL A	298,600	107.90	32,218,940.00
ALPHABET INC-CL C	282,060	108.36	30,564,021.60
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	24,885	15.50	385,717.50
CABLE ONE INC	247	1,435.31	354,521.57
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	6,158	485.70	2,990,940.60
COMCAST CORP-CL A	224,950	42.60	9,582,870.00
DISH NETWORK CORPORATION-A	12,603	18.70	235,676.10
ELECTRONIC ARTS INC	13,548	130.16	1,763,407.68
FOX CORP - CLASS A	15,560	35.16	547,089.60
FOX CORP- CLASS B	6,975	32.57	227,175.75
IAC/INTERACTIVECORP	3,853	74.32	286,354.96
INTERPUBLIC GROUP OF COS	17,946	29.49	529,227.54
LIBERTY BROADBAND-C	7,402	123.32	912,814.64
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,885	63.53	627,994.05
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,928	39.44	312,680.32
LIBERTY SIRIUSXM-A	3,171	39.64	125,698.44
LIVE NATION ENTERTAINMENT	8,618	91.58	789,236.44
MATCH GROUP INC	14,456	72.21	1,043,867.76
META PLATFORMS INC-CLASS A	114,468	169.27	19,375,998.36
NETFLIX INC	22,149	220.44	4,882,525.56
NEWS CORP-CLASS A	17,936	16.88	302,759.68
OMNICOM GROUP	9,954	68.96	686,427.84
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	30,808	25.27	778,518.16
PINTEREST INC- CLASS A	27,343	18.11	495,181.73
ROBLOX CORP -CLASS A	18,226	39.40	718,104.40
ROKU INC	5,586	88.84	496,260.24
SEA LTD-ADR	18,067	77.32	1,396,940.44
SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,096	6.46	304,240.16
SNAP INC - A	52,578	9.96	523,676.88
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,203	130.41	1,069,753.23
THE WALT DISNEY CO	90,541	102.72	9,300,371.52
TWITTER INC	40,330	39.84	1,606,747.20
WARNER BROS DISCOVERY INC	111,814	14.65	1,638,075.10
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	14,227	37.64	535,504.28
ADVANCE AUTO PARTS	3,129	191.23	598,358.67
AMAZON.COM	454,960	122.42	55,696,203.20
AUTOZONE INC	1,035	2,147.62	2,222,786.70
BATH & BODY WORKS INC	13,789	33.47	461,517.83
BEST BUY COMPANY INC	10,832	76.80	831,897.60

BURLINGTON STORES INC	3,076	156.39	481,055.64
CARMAX INC	7,628	94.35	719,701.80
CARVANA CO	3,698	25.38	93,855.24
CHEWY INC - CLASS A	3,947	42.52	167,826.44
DOLLAR GENERAL CORP	11,647	247.81	2,886,243.07
DOLLAR TREE INC	10,956	172.01	1,884,541.56
DOORDASH INC - A	10,462	73.45	768,433.90
EBAY	29,667	46.68	1,384,855.56
ETSY INC	5,869	97.11	569,938.59
GENUINE PARTS CO	6,685	144.49	965,915.65
HOME DEPOT	52,079	306.59	15,966,900.61
LKQ CORP	13,325	53.09	707,424.25
LOWES COMPANIES	32,939	195.58	6,442,209.62
MERCADOLIBRE INC	2,180	763.92	1,665,345.60
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,383	688.20	2,328,180.60
POOL CORP	1,855	363.11	673,569.05
ROSS STORES INC	17,806	83.24	1,482,171.44
TARGET (DAYTON HUDSON)	23,475	157.74	3,702,946.50
TJX COMPANIES INC	58,528	63.76	3,731,745.28
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,411	194.89	1,054,549.79
ULTA BEAUTY INC	2,749	406.40	1,117,193.60
WAYFAIR INC- CLASS A	3,788	51.75	196,029.00
COSTCO WHOLESALE CORP	22,048	529.72	11,679,266.56
KROGER CO	33,615	46.24	1,554,357.60
SYSCO CORP	25,975	86.86	2,256,188.50
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	36,389	38.66	1,406,798.74
WALMART INC	75,871	132.21	10,030,904.91
ALTRIA GROUP INC	90,586	43.09	3,903,350.74
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	28,451	73.84	2,100,821.84
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,737	71.22	1,120,789.14
BUNGE LIMITED	7,221	91.02	657,255.42
CAMPBELL SOUP CO (US)	9,742	47.85	466,154.70
COCA-COLA CO	204,683	61.59	12,606,425.97
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	9,216	51.50	474,624.00
CONAGRA BRANDS INC	22,663	33.63	762,156.69
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,917	242.38	1,918,922.46
GENERAL MILLS INC	30,271	73.63	2,228,853.73
HERSHEY FOODS CORPORATION	7,340	215.92	1,584,852.80
HORMEL FOODS CORP	13,714	47.59	652,649.26
JM SMUCKER CO	5,275	130.19	686,752.25
KELLOGG CO	11,938	71.14	849,269.32
KEURIG DR PEPPER INC	39,374	36.43	1,434,394.82

KRAFT HEINZ CO/THE	37,077	38.32	1,420,790.64
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	12,652	84.11	1,064,159.72
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	8,727	57.91	505,380.57
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	69,256	61.99	4,293,179.44
MONSTER BEVERAGE CORP	19,643	95.07	1,867,460.01
PEPSICO INC	68,768	169.61	11,663,740.48
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	77,103	95.93	7,396,490.79
TYSON FOODS INC	14,778	82.08	1,212,978.24
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,548	94.06	1,086,204.88
CLOROX COMPANY	5,866	147.85	867,288.10
COLGATE-PALMOLIVE CO	39,331	77.47	3,046,972.57
ESTEE LAUDER CO-CL A	11,283	260.10	2,934,708.30
KIMBERLY-CLARK CORP	16,900	132.40	2,237,560.00
PROCTER & GAMBLE CO	119,071	143.02	17,029,534.42
ABBOTT LABORATORIES	87,688	109.20	9,575,529.60
ABIOMED INC	2,088	281.70	588,189.60
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,719	265.88	988,807.72
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,784	142.50	1,109,220.00
BAXTER INTERNATIONAL	25,237	66.16	1,669,679.92
BECTON DICKINSON & CO	14,222	242.13	3,443,572.86
BOSTON SCIENTIFIC CORP	70,019	38.12	2,669,124.28
CARDINAL HEALTH	13,608	56.99	775,519.92
CENTENE CORP	29,043	90.94	2,641,170.42
CIGNA CORP	16,011	269.20	4,310,161.20
CVS HEALTH CORP	65,355	94.06	6,147,291.30
DAVITA INC	3,582	87.10	311,992.20
DENTSPLY SIRONA INC	10,094	35.96	362,980.24
DEXCOM INC	19,120	83.78	1,601,873.60
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	30,691	102.58	3,148,282.78
ELEVANCE HEALTH INC	11,878	459.60	5,459,128.80
HCA HEALTHCARE INC	12,224	202.03	2,469,614.72
HENRY SCHEIN INC	6,547	77.04	504,380.88
HOLOGIC INC	11,926	70.54	841,260.04
HUMANA INC	6,360	488.97	3,109,849.20
IDEXX LABORATORIES INC	4,215	393.51	1,658,644.65
INSULET CORP	3,546	240.64	853,309.44
INTUITIVE SURGICAL INC	17,481	211.85	3,703,349.85
LABORATORY CRP OF AMER	4,533	246.34	1,116,659.22
MASIMO CORP	2,735	138.92	379,946.20
MCKESSON CORP	7,488	330.44	2,474,334.72
MEDTRONIC PLC	66,841	90.72	6,063,815.52
MOLINA HEALTHCARE INC	2,739	301.67	826,274.13

NOVOCURE LTD	4,504	71.80	323,387.20
QUEST DIAGNOSTICS	6,246	131.03	818,413.38
RESMED INC	7,208	231.75	1,670,454.00
STERIS PLC	5,122	217.53	1,114,188.66
STRYKER CORP	16,646	199.42	3,319,545.32
TELADOC HEALTH INC	6,270	41.18	258,198.60
TELEFLEX INC	2,162	265.18	573,319.16
THE COOPER COS INC	2,279	313.44	714,329.76
UNITEDHEALTH GROUP INC	46,721	521.41	24,360,796.61
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	110.99	432,639.02
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,903	213.77	1,475,654.31
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,564	107.00	1,130,348.00
ABBVIE INC	87,899	148.47	13,050,364.53
AGILENT TECHNOLOGIES	15,096	125.04	1,887,603.84
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,156	143.21	881,600.76
AMGEN	27,728	245.95	6,819,701.60
AVANTOR INC	31,022	30.97	960,751.34
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,027	524.62	538,784.74
BIO-TECHNE CORP	1,796	363.25	652,397.00
BIOGEN INC	7,191	206.25	1,483,143.75
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,381	85.23	714,312.63
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	107,603	72.95	7,849,638.85
CATALENT INC	8,308	107.61	894,023.88
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,324	237.01	550,811.24
DANAHER CORP	33,807	273.84	9,257,708.88
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,778	20.65	429,065.70
EXACT SCIENCES CORP	9,063	45.39	411,369.57
GILEAD SCIENCES INC	61,511	60.80	3,739,868.80
HORIZON THERAPEUTICS PLC	10,243	82.93	849,451.99
ILLUMINA INC	7,888	201.69	1,590,930.72
INCYTE CORP	8,608	80.90	696,387.20
IQVIA HOLDINGS INC	9,501	221.74	2,106,751.74
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,663	157.53	419,502.39
JOHNSON & JOHNSON	130,558	172.12	22,471,642.96
LILLY (ELI) & CO	40,232	328.75	13,226,270.00
MERCK & CO	125,650	90.11	11,322,321.50
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,109	1,224.14	1,357,571.26
MODERNA INC	17,165	163.52	2,806,820.80
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,708	95.29	448,625.32
PERKINELMER INC	6,426	146.67	942,501.42
PFIZER	279,392	51.23	14,313,252.16
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,329	586.11	3,123,380.19

ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,093	43.23	782,160.39
SEAGEN INC	7,007	171.62	1,202,541.34
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	56,857	7.01	398,567.57
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	19,450	561.54	10,921,953.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,718	280.29	3,564,728.22
VIATRIS INC	57,073	9.55	545,047.15
WATERS CORP	2,876	345.68	994,175.68
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,764	313.64	1,180,540.96
ZOETIS INC	23,191	178.18	4,132,172.38
BANK OF AMERICA CORP	360,929	33.43	12,065,856.47
CITIGROUP	97,674	51.91	5,070,257.34
CITIZENS FINANCIAL GROUP	25,193	37.17	936,423.81
FIFTH THIRD BANCORP	33,182	33.63	1,115,910.66
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	578	703.54	406,646.12
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,838	158.66	1,402,237.08
HUNTINGTON BANCSHARES INC	69,030	13.02	898,770.60
JPMORGAN CHASE & CO	146,660	114.76	16,830,701.60
KEY CORP	44,974	18.04	811,330.96
M & T BANK CORP	8,756	168.96	1,479,413.76
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	20,656	161.76	3,341,314.56
REGIONS FINL CORP	46,064	20.65	951,221.60
SIGNATURE BANK	3,120	175.89	548,776.80
SVB FINANCIAL GROUP	2,803	361.36	1,012,892.08
TRUIST FINANCIAL CORP	65,536	48.14	3,154,903.04
US BANCORP	69,143	47.71	3,298,812.53
WEBSTER FINANCIAL CORP	8,680	45.06	391,120.80
WELLS FARGO & CO	189,752	43.17	8,191,593.84
ALLY FINANCIAL INC	18,129	33.48	606,958.92
AMERICAN EXPRESS	32,007	153.01	4,897,391.07
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,496	245.06	1,346,849.76
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	20,242	53.94	1,091,853.48
BANK NEW YORK CO	38,892	42.72	1,661,466.24
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	64,127	285.93	18,335,833.11
BLACKROCK INC	7,579	633.64	4,802,357.56
BLACKSTONE INC	34,948	96.43	3,370,035.64
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,406	108.93	2,222,825.58
CARLYLE GROUP INC/THE	10,351	35.00	362,285.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,962	123.73	613,948.26
CME GROUP INC	17,634	204.48	3,605,800.32
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	6,291	70.82	445,528.62
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,285	100.00	1,428,500.00
EQUITABLE HOLDINGS INC	18,461	26.54	489,954.94



FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,750	408.03	714,052.50
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	25.30	373,124.40
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,286	44.65	102,069.90
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,837	323.93	5,454,009.41
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	27,704	99.11	2,745,743.44
INVESCO LTD	19,405	17.11	332,019.55
KKR & CO INC	28,014	51.33	1,437,958.62
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,096	192.39	788,029.44
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,762	270.84	477,220.08
MOODY'S CORP	8,230	295.46	2,431,635.80
MORGAN STANLEY	65,965	82.43	5,437,494.95
MSCI INC	4,065	439.90	1,788,193.50
NASDAQ INC	5,320	172.60	918,232.00
NORTHERN TRUST CORP	10,018	97.40	975,753.20
PRICE T ROWE GROUP INC	11,505	121.08	1,393,025.40
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,521	95.73	911,445.33
S&P GLOBAL INC	17,638	361.94	6,383,897.72
SCHWAB (CHARLES) CORP	72,232	62.99	4,549,893.68
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	54.39	342,058.71
STATE STREET CORP	18,501	68.16	1,261,028.16
SYNCHRONY FINANCIAL	27,139	32.68	886,902.52
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,522	70.97	320,926.34
UPSTART HOLDINGS INC	2,178	26.03	56,693.34
AFLAC	31,141	55.28	1,721,474.48
ALLEGHANY CORP	647	837.15	541,636.05
ALLSTATE CORP	14,193	116.20	1,649,226.60
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,803	131.91	501,653.73
AMERICAN INT'L GROUP	40,246	51.33	2,065,827.18
AON PLC	10,695	279.49	2,989,145.55
ARCH CAPITAL GROUP LTD	18,793	43.67	820,690.31
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,383	168.23	1,746,732.09
ASSURANT INC	2,684	169.74	455,582.16
BROWN & BROWN INC	11,065	61.97	685,698.05
CHUBB LTD	21,140	184.13	3,892,508.20
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,751	110.83	859,043.33
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,444	191.81	276,973.64
EVEREST RE GROUP LTD	1,834	271.94	498,737.96
FNF GROUP	12,836	37.89	486,356.04
GLOBE LIFE INC	4,559	100.67	458,954.53
HARTFORD FINANCIAL SVCS	16,673	63.78	1,063,403.94
LINCOLN NATIONAL CORP	8,416	49.64	417,770.24
LOEWS CORP	10,482	57.05	597,998.10

MARKEL CORP	639	1,262.68	806,852.52
MARSH & MCLENNAN COS	24,739	156.84	3,880,064.76
METLIFE INC	35,762	60.85	2,176,117.70
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,725	63.91	813,254.75
PROGRESSIVE CORP	28,960	111.19	3,220,062.40
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,486	95.51	1,765,597.86
TRAVELERS COS INC/THE	11,830	156.42	1,850,448.60
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,009	202.18	1,214,899.62
WR BERKLEY CORP	9,829	62.65	615,786.85
CBRE GROUP INC-A	16,391	82.26	1,348,323.66
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	64,300	4.90	315,070.00
WEYERHAEUSER CO	36,674	35.51	1,302,293.74
ZILLOW GROUP INC-C	7,537	36.21	272,914.77
ACCENTURE PLC-CL A	31,433	288.01	9,053,018.33
ADOBE INC	23,458	401.90	9,427,770.20
AFFIRM HOLDINGS INC	8,787	26.77	235,227.99
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	7,539	94.13	709,646.07
ANSYS INC	4,382	260.17	1,140,064.94
APPLOVIN CORP-CLASS A	6,563	36.16	237,318.08
AUTODESK INC	10,882	195.95	2,132,327.90
AUTOMATIC DATA PROCESS	20,657	220.34	4,551,563.38
AVALARA INC	4,011	89.37	358,463.07
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,879	36.69	289,080.51
BILL.COM HOLDINGS INC	4,833	129.57	626,211.81
BLACK KNIGHT INC	8,009	65.03	520,825.27
BLOCK INC	24,992	71.80	1,794,425.60
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	5,961	156.19	931,048.59
CADENCE DESIGN SYSTEMS	13,920	167.71	2,334,523.20
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,963	54.20	377,394.60
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,676	128.85	731,352.60
CITRIX SYSTEMS INC	6,470	101.48	656,575.60
CLOUDFLARE INC - CLASS A	12,921	51.65	667,369.65
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	26,353	69.10	1,820,992.30
COUPA SOFTWARE INC	3,189	66.93	213,439.77
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,967	183.53	1,829,243.51
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,100	139.72	293,412.00
DATADOG INC - CLASS A	10,804	93.79	1,013,307.16
DOCUSIGN INC	9,538	64.45	614,724.10
DROPBOX INC-CLASS A	16,505	22.69	374,498.45
DYNATRACE INC	8,780	37.12	325,913.60
EPAM SYSTEMS INC	2,842	323.30	918,818.60
FAIR ISAAC CORP	1,345	467.65	628,989.25

FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	30,439	99.02	3,014,069.78
FISERV INC	30,979	99.87	3,093,872.73
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,879	218.79	848,686.41
FORTINET INC	34,510	61.23	2,113,047.30
GARTNER INC	4,134	253.74	1,048,961.16
GLOBAL PAYMENTS INC	14,011	118.71	1,663,245.81
GODADDY INC - CLASS A	8,747	74.02	647,452.94
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	3,640	76.07	276,894.80
HUBSPOT INC	2,233	300.50	671,016.50
INTL BUSINESS MACHINES CORP	44,787	128.25	5,743,932.75
INTUIT INC	13,404	434.74	5,827,254.96
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,514	199.69	701,710.66
MASTERCARD INC-CLASS A	43,362	343.88	14,911,324.56
MICROSOFT CORP	353,374	260.36	92,004,454.64
MONGODB INC	3,415	301.61	1,029,998.15
NORTONLIFELOCK INC	29,838	25.43	758,780.34
OKTA INC	7,338	101.95	748,109.10
ORACLE CORP	78,820	74.90	5,903,618.00
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	74,206	9.84	730,187.04
PALO ALTO NETWORKS INC	4,839	511.17	2,473,551.63
PAYCHEX INC	16,029	122.44	1,962,590.76
PAYCOM SOFTWARE INC	2,625	324.53	851,891.25
PAYPAL HOLDINGS INC	54,270	81.05	4,398,583.50
PTC INC	5,381	111.18	598,259.58
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,503	55.18	193,295.54
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,201	410.92	2,137,194.92
SALESFORCE INC	49,010	182.47	8,942,854.70
SERVICENOW INC	9,974	446.77	4,456,083.98
SNOWFLAKE INC-CLASS A	10,361	142.99	1,481,519.39
SPLUNK INC	7,452	105.23	784,173.96
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10,662	62.79	669,466.98
SYNOPSYS INC	7,555	338.04	2,553,892.20
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	21,590	47.27	1,020,559.30
TWILIO INC - A	7,960	87.33	695,146.80
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,028	367.31	744,904.68
UNITY SOFTWARE INC	10,116	36.47	368,930.52
VERISIGN INC	4,769	185.30	883,695.70
VISA INC-CLASS A SHARES	82,381	213.70	17,604,819.70
VMWARE INC-CLASS A	10,056	113.60	1,142,361.60
WESTERN UNION CO	20,387	16.73	341,074.51
WIX.COM LTD	2,353	63.20	148,709.60
WORKDAY INC-CLASS A	9,867	148.00	1,460,316.00

ZENDESK INC	5,395	75.25	405,973.75
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	10,363	106.55	1,104,177.65
ZSCALER INC	4,184	159.93	669,147.12
AMPHENOL CORPORATION	29,472	69.82	2,057,735.04
APPLE INC	809,683	154.09	124,764,053.47
ARISTA NETWORKS INC	12,447	102.38	1,274,323.86
ARROW ELECTRONICS INC	3,851	119.61	460,618.11
CDW CORP/DE	6,651	170.10	1,131,335.10
CISCO SYSTEMS	205,941	44.46	9,156,136.86
COGNEX CORP	8,069	48.76	393,444.44
CORNING	40,515	34.37	1,392,500.55
DELL TECHNOLOGIES -C	14,009	43.34	607,150.06
F5 INC	2,841	153.91	437,258.31
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	66,144	13.77	910,802.88
HP INC	52,913	32.47	1,718,085.11
JUNIPER NETWORKS INC	16,308	28.61	466,571.88
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,238	150.58	1,391,058.04
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,455	221.16	1,869,907.80
NETAPP INC	10,843	69.26	750,986.18
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	9,880	76.83	759,080.40
TE CONNECTIVITY LTD	16,345	123.05	2,011,252.25
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,404	400.93	963,835.72
TRIMBLE IMS HOLDINGS	11,609	63.15	733,108.35
WESTERN DIGITAL CORP	15,203	47.22	717,885.66
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,482	326.68	810,819.76
AT&T INC	355,457	18.40	6,540,408.80
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,831	21.77	170,480.87
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,877	22.68	428,130.36
LUMEN TECHNOLOGIES INC	42,975	10.55	453,386.25
T-MOBILE US INC	31,168	132.48	4,129,136.64
VERIZON COMMUNICATIONS	208,706	44.45	9,276,981.70
AES CORP	30,838	19.73	608,433.74
ALLIANT ENERGY CORPORATION	12,663	57.43	727,236.09
AMEREN CORPORATION	13,199	87.43	1,153,988.57
AMERICAN ELECTRIC POWER	24,953	94.35	2,354,315.55
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,178	148.22	1,360,363.16
ATMOS ENERGY CORP	6,926	113.35	785,062.10
CENTERPOINT ENERGY INC	31,584	29.70	938,044.80
CMS ENERGY CORP	14,716	65.18	959,188.88
CONSOLIDATED EDISON INC	17,915	92.44	1,656,062.60
CONSTELLATION ENERGY	16,151	54.00	872,154.00
DOMINION ENERGY INC	39,780	77.35	3,076,983.00

DTE ENERGY COMPANY	9,793	123.75	1,211,883.75
DUKE ENERGY CORP	38,378	104.98	4,028,922.44
EDISON INTL	19,236	61.33	1,179,743.88
ENERGY CORP	10,274	109.37	1,123,667.38
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,385	48.68	554,221.80
EVERGY INC	11,724	64.31	753,970.44
EVERSOURCE ENERGY	17,349	84.06	1,458,356.94
EXELON CORP	48,454	44.02	2,132,945.08
FIRSTENERGY CORP	27,438	38.32	1,051,424.16
NEXTERA ENERGY INC	97,684	80.25	7,839,141.00
NISOURCE INC	20,005	28.44	568,942.20
NRG ENERGY INC	12,298	35.63	438,177.74
PG&E CORP	68,966	10.63	733,108.58
PPL CORPORATION	35,742	27.33	976,828.86
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	25,028	60.10	1,504,182.80
SEMPRA ENERGY	15,948	154.24	2,459,819.52
SOUTHERN CO	52,914	71.94	3,806,633.16
UGI CORP	9,579	41.23	394,942.17
VISTRA CORP	23,603	23.00	542,869.00
WEC ENERGY GROUP INC	15,877	97.86	1,553,723.22
XCEL ENERGY INC	26,807	68.67	1,840,836.69
ADVANCED MICRO DEVICES	81,339	88.10	7,165,965.90
ANALOG DEVICES	26,323	163.27	4,297,756.21
APPLIED MATERIALS	44,314	101.67	4,505,404.38
BROADCOM INC	20,363	512.52	10,436,444.76
ENPHASE ENERGY INC	6,604	211.54	1,397,010.16
ENTEGRIS INC	6,990	102.27	714,867.30
INTEL CORP	202,547	39.20	7,939,842.40
KLA CORP	7,545	354.02	2,671,080.90
LAM RESEARCH CORP	6,968	463.99	3,233,082.32
MARVELL TECHNOLOGY INC	42,282	52.02	2,199,509.64
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	27,084	64.72	1,752,876.48
MICRON TECHNOLOGY	54,679	61.29	3,351,275.91
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,249	436.44	981,553.56
NVIDIA CORP	124,147	173.19	21,501,018.93
NXP SEMICONDUCTORS NV	13,089	175.14	2,292,407.46
ON SEMICONDUCTOR CORP	21,863	59.42	1,299,099.46
QORVO INC	5,297	104.34	552,688.98
QUALCOMM	56,084	153.70	8,620,110.80
SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,742	106.07	821,193.94
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	2,629	288.93	759,596.97
TERADYNE INC	7,707	100.46	774,245.22

	TEXAS INSTRUMENTS	45,951	163.90	7,531,368.90
	アメリカドル 小計	16,897,831		1,708,938,677.68 (233,492,291,531)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	36,244	15.77	571,567.88
	CAMECO CORP	19,186	29.07	557,737.02
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	58,757	64.33	3,779,837.81
	CENOVUS ENERGY INC	70,732	21.81	1,542,664.92
	ENBRIDGE	101,209	55.41	5,607,990.69
	IMPERIAL OIL	11,645	55.78	649,558.10
	KEYERA CORP	10,963	30.99	339,743.37
	PARKLAND CORP	8,544	34.89	298,100.16
	PEMBINA PIPELINE CORP	28,103	46.31	1,301,449.93
	SUNCOR ENERGY	70,924	39.78	2,821,356.72
	TC ENERGY CORP	48,340	68.63	3,317,574.20
	TOURMALINE OIL CORP	14,710	68.77	1,011,606.70
	AGNICO EAGLE MINES	22,981	52.00	1,195,012.00
	BARRICK GOLD CORP	88,471	19.80	1,751,725.80
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	63.78	465,721.56
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	30,312	19.89	602,905.68
	FRANCO-NEVADA CORP	9,313	160.99	1,499,299.87
	IVANHOE MINES LTD-CL A	26,291	6.86	180,356.26
	KINROSS GOLD CORP	56,706	4.20	238,165.20
	LUNDIN MINING CORP	30,173	7.35	221,771.55
	NUTRIEN LTD	27,681	101.17	2,800,486.77
	PAN AMERICAN SILVER CORP	9,343	24.26	226,661.18
	TECK RESOURCES LTD-CL B	24,191	33.59	812,575.69
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,500	126.18	567,810.00
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	23,120	41.97	970,346.40
	CAE INC	16,864	33.11	558,367.04
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,269	106.28	453,709.32
	WSP GLOBAL INC	5,400	151.18	816,372.00
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	10,920	35.15	383,838.00
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,665	89.40	506,451.00
	THOMSON REUTERS CORP	7,995	140.10	1,120,099.50
	AIR CANADA	6,737	16.91	113,922.67
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	29,791	149.27	4,446,902.57
	CP RAILWAY LIMITED	46,278	95.60	4,424,176.80
	TFI INTERNATIONAL INC	4,630	116.45	539,163.50
	MAGNA INTERNATIONAL INC	14,682	78.88	1,158,116.16
	BRP INC/CA- SUB VOTING	2,814	90.93	255,877.02
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	37.13	371,300.00
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,221	67.27	1,023,916.67

QUEBECOR INC -CL B	5,999	28.71	172,231.29
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	24,782	34.80	862,413.60
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,586	170.83	441,766.38
DOLLARAMA INC	13,514	77.00	1,040,578.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	42,716	53.71	2,294,276.36
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	39.56	289,974.80
LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	119.38	1,082,537.84
METRO INC	11,419	69.65	795,333.35
WESTON (GEORGE) LTD	3,705	155.15	574,830.75
SAPUTO INC	11,041	31.47	347,460.27
BAUSCH HEALTH COS INC	14,544	11.33	164,783.52
BANK MONTREAL	31,608	125.29	3,960,166.32
BANK NOVA SCOTIA	60,770	75.09	4,563,219.30
CANADIAN IMPERIAL BANK	44,598	62.96	2,807,890.08
NATIONAL BANK OF CANADA	16,160	88.96	1,437,593.60
ROYAL BANK OF CANADA	69,804	123.62	8,629,170.48
TORONTO-DOMINION BANK	90,808	82.03	7,448,980.24
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	69,288	61.98	4,294,470.24
IGM FINANCIAL INC	3,890	36.31	141,245.90
ONEX CORP	3,361	66.31	222,867.91
TMX GROUP LTD	2,508	125.70	315,255.60
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,198	680.26	814,951.48
GREAT-WEST LIFECO INC	12,491	30.63	382,599.33
IA FINANCIAL CORP INC	5,415	64.24	347,859.60
INTACT FINANCIAL CORP	8,967	178.30	1,598,816.10
MANULIFE FINANCIAL CORP	96,584	22.47	2,170,242.48
POWER CORP OF CANADA	25,684	34.18	877,879.12
SUN LIFE FINANCIAL INC	29,314	57.25	1,678,226.50
FIRSTSERVICE CORP	2,028	170.22	345,206.16
BLACKBERRY LIMITED	25,075	7.68	192,576.00
CGI INC - CL A	11,043	108.93	1,202,913.99
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,007	2,058.76	2,073,171.32
LIGHTSPEED COMMERCE INC	5,859	26.19	153,447.21
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,153	45.70	98,392.10
OPEN TEXT CORP	12,469	52.37	653,001.53
SHOPIFY INC - CLASS A	55,990	48.24	2,700,957.60
BCE INC	3,102	63.39	196,635.78
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	18,199	60.39	1,099,037.61
TELUS CORP	23,120	28.90	668,168.00
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	37,267	17.28	643,973.76
ALTAGAS INCOME LTD	14,516	27.51	399,335.16
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,264	49.06	307,311.84

	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	39.68	237,207.04
	EMERA INC	13,595	60.22	818,690.90
	FORTIS INC	22,342	60.10	1,342,754.20
	HYDRO ONE LTD	14,776	34.86	515,091.36
	NORTHLAND POWER INC	9,907	40.48	401,035.36
	カナダドル 小計	2,024,849		113,310,765.07 (11,964,483,683)
ユーロ	ENI	126,764	10.97	1,390,601.08
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	23,722	9.74	231,052.28
	NESTE OIL OYJ	21,882	45.75	1,001,101.50
	OMV AG	7,462	41.38	308,777.56
	REPSOL SA	68,089	12.03	819,110.67
	TENARIS SA	27,420	12.49	342,475.80
	TOTALENERGIES SE	122,539	48.54	5,948,043.06
	AIR LIQUIDE	26,132	129.34	3,379,912.88
	AKZO NOBEL	9,224	65.74	606,385.76
	ARCELORMITTAL	32,320	23.04	744,652.80
	ARKEMA	2,799	90.44	253,141.56
	BASF SE	44,781	43.14	1,931,852.34
	COVESTRO AG	10,438	33.44	349,046.72
	CRH PLC	39,369	35.27	1,388,741.47
	EVONIK INDUSTRIES AG	9,603	20.21	194,076.63
	HEIDELBERGCEMENT AG	6,738	48.55	327,129.90
	KONINKLIJKE DSM NV	8,702	151.25	1,316,177.50
	OCI NV	5,799	31.08	180,232.92
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,335	32.26	365,667.10
	SOLVAY SA	3,676	80.62	296,359.12
	STORA ENSO OYJ R	26,361	14.79	389,879.19
	SYMRISE AG	7,051	111.05	783,013.55
	UMICORE	9,946	33.43	332,494.78
	UPM KYMMENE OYJ	27,619	29.05	802,331.95
	VOESTALPINE AG	5,948	21.00	124,908.00
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	10,930	22.22	242,864.60
	ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	10,930	1.40	15,394.90
	AIRBUS SE	29,872	105.58	3,153,885.76
	ALSTOM	16,908	22.86	386,516.88
	BOUYGUES ORD	11,344	28.83	327,047.52
	BRENTAG SE	6,989	66.20	462,671.80
	CNH INDUSTRIAL NV	46,753	11.53	539,295.85
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	20,876	25.61	534,738.74
	DASSAULT AVIATION SA	1,210	141.30	170,973.00
	EIFFAGE	3,659	87.18	318,991.62



FERROVIAL SA	22,380	26.25	587,475.00
GEA GROUP AG	7,649	34.86	266,644.14
IMCD NV	3,050	146.75	447,587.50
KINGSPAN GROUP PLC	7,694	61.10	470,103.40
KION GROUP AG	3,430	44.69	153,286.70
KNORR-BREMSE AG	3,221	56.14	180,826.94
KONE OYJ-B	15,737	43.91	691,011.67
LEGRAND SA	13,075	78.46	1,025,864.50
MTU AERO ENGINES AG	2,396	192.50	461,230.00
PRYSMIAN SPA	11,275	28.38	319,984.50
RATIONAL AG	268	650.50	174,334.00
RHEINMETALL AG	2,442	181.50	443,223.00
SAFRAN SA	17,120	103.50	1,771,920.00
SAINT-GOBAIN	25,279	43.32	1,095,086.28
SCHNEIDER ELECTRIC SE	27,347	125.58	3,434,236.26
SIEMENS	38,409	105.42	4,049,076.78
SIEMENS ENERGY AG	24,753	15.28	378,349.60
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	12,322	17.91	220,687.02
THALES SA	5,540	119.85	663,969.00
VINCI S.A.	26,015	89.57	2,330,163.55
WARTSILA OYJ	18,738	8.77	164,407.21
BUREAU VERITAS SA	12,892	26.29	338,930.68
RANDSTAD NV	5,866	50.36	295,411.76
TELEPERFORMANCE	3,110	330.10	1,026,611.00
WOLTERS KLUWER	13,534	102.40	1,385,881.60
ADP	1,532	126.05	193,108.60
AENA SME SA	3,518	125.50	441,509.00
ATLANTIA SPA	26,089	22.54	588,046.06
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	38,499	6.04	232,533.96
DEUTSCHE POST AG-REG	48,367	37.97	1,836,736.82
GETLINK	18,993	19.05	361,816.65
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	16,643	77.10	1,283,175.30
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,582	72.65	187,582.30
CONTINENTAL AG	4,993	70.54	352,206.22
FERRARI NV	6,331	197.45	1,250,055.95
MERCEDES-BENZ GROUP AG	40,641	54.69	2,222,656.29
MICHELIN	33,216	28.24	938,019.84
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	6,979	68.98	481,411.42
RENAULT SA	8,441	25.83	218,031.03
STELLANTIS NV	113,390	12.64	1,434,156.72
VALEO SA	10,032	19.96	200,288.88
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,112	134.32	1,223,923.84

VOLKSWAGEN STAMM	1,657	190.50	315,658.50
ADIDAS AG	8,492	176.62	1,499,857.04
ESSILORLUXOTTICA	14,035	154.90	2,174,021.50
HERMES INTERNATIONAL	1,565	1,205.00	1,885,825.00
KERING	3,703	531.30	1,967,403.90
LVMH	13,872	634.70	8,804,558.40
MONCLER SPA	9,963	43.61	434,486.43
PUMA SE	4,644	70.40	326,937.60
SEB SA	1,310	83.70	109,647.00
ACCOR	7,911	27.98	221,349.78
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8,339	97.02	809,049.78
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,332	33.94	180,968.08
SODEXO	3,888	75.06	291,833.28
BOLLORE SE	37,200	4.74	176,625.60
PUBLICIS GROUPE	11,624	50.26	584,222.24
SCOUT24 SE	4,128	54.72	225,884.16
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,969	41.10	204,225.90
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	36,953	21.42	791,533.26
VIVENDI SE	33,016	10.01	330,490.16
D' IETEREN GROUP	1,703	154.70	263,454.10
DELIVERY HERO SE	7,305	43.66	318,936.30
INDITEX	54,582	24.56	1,340,533.92
JUST EAT TAKEAWAY	8,459	18.57	157,100.54
PROSUS	41,585	68.59	2,852,315.15
ZALANDO SE	11,285	29.76	335,841.60
CARREFOUR	30,831	16.86	519,810.66
HELLOFRESH SE	7,756	26.67	206,852.52
JERONIMO MARTINS	13,062	21.20	276,914.40
KESKO OYJ-B SHS	14,326	24.13	345,686.38
KONINKLIJKE AHOLD NV	50,995	26.45	1,349,072.72
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	42,993	53.07	2,281,638.51
DANONE (GROUPE)	32,878	53.74	1,766,863.72
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	26,648	10.48	279,271.04
HEINEKEN HOLDING NV	5,127	75.00	384,525.00
HEINEKEN NV	12,980	95.08	1,234,138.40
JDE PEET'S BV	4,123	27.82	114,701.86
KERRY GROUP PLC-A	7,323	99.96	732,007.08
PERNOD-RICARD	10,396	185.50	1,928,458.00
REMY COINTREAU	1,020	182.50	186,150.00
BEIERSDORF AG	4,515	99.92	451,138.80
HENKEL AG & CO KGAA	4,647	60.70	282,072.90
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	8,553	61.28	524,127.84

LOREAL	12,190	353.60	4,310,384.00
AMPLIFON SPA	6,606	31.16	205,842.96
BIOMERIEUX	2,374	104.75	248,676.50
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,091	139.25	291,171.75
DIASORIN ITALIA SPA	1,418	140.90	199,796.20
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	9,705	44.69	433,716.45
FRESENIUS SE&CO KGAA	20,026	27.30	546,709.80
KONINKLIJKE PHILIPS	45,856	21.74	997,138.72
SARTORIUS AG-VORZUG	1,216	418.50	508,896.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,577	49.28	718,354.56
ARGENX SE	2,207	353.70	780,615.90
BAYER	48,711	56.79	2,766,297.69
EUROFINS SCIENTIFIC	6,490	83.10	539,319.00
GRIFOLS SA	14,240	16.43	234,034.40
IPSEN	1,866	91.75	171,205.50
MERCK KGAA	6,723	178.05	1,197,030.15
ORION OYJ-CLASS B	5,393	45.90	247,538.70
QIAGEN N.V.	11,006	46.89	516,071.34
RECORDATI SPA	5,195	42.90	222,865.50
SANOFI	56,690	97.36	5,519,338.40
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,235	376.30	464,730.50
UCB (GROUPE)	6,718	80.36	539,858.48
ABN AMRO BANK NV-CVA	19,718	9.70	191,304.03
BANCO BILBAO VIZCAYA	328,517	4.14	1,362,688.51
BANCO SANTANDER SA	847,548	2.43	2,062,084.28
BNP PARIBAS	54,846	43.81	2,403,077.49
CAIXABANK	219,234	2.82	619,116.81
COMMERZBANK AG	46,222	6.33	292,862.59
CREDIT AGRICOLE SA	64,475	8.51	548,875.67
ERSTE GROUP BANK AG	18,119	23.88	432,681.72
FINECOBANK SPA	27,362	11.23	307,412.07
ING GROEP NV-CVA	193,144	9.04	1,747,566.91
INTESA SANPAOLO	823,869	1.66	1,367,622.54
KBC GROEP NV	12,855	49.75	639,536.25
MEDIOBANCA	29,447	8.03	236,518.30
SOCIETE GENERALE	38,744	20.44	791,927.36
UNICREDIT SPA	103,949	8.50	883,566.50
AMUNDI SA	2,812	52.85	148,614.20
DEUTSCHE BANK NAMEN	101,640	8.26	839,749.68
DEUTSCHE BOERSE	9,759	161.15	1,572,662.85
EURAZEO SA	2,340	66.40	155,376.00
EURONEXT NV	4,500	77.46	348,570.00

EXOR NV	4,845	63.84	309,304.80
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,582	84.20	470,004.40
SOFINA	752	211.20	158,822.40
WENDEL	1,047	86.70	90,774.90
AEGON	79,881	4.06	324,556.50
AGEAS	8,621	40.90	352,598.90
ALLIANZ SE-REG	19,980	174.12	3,478,917.60
ASSICURAZIONI GENERALI	58,531	14.29	836,700.64
AXA SA	95,834	21.21	2,032,639.14
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,976	138.30	411,580.80
MUENCHENER RUECKVERSICH.	6,875	219.20	1,507,000.00
NN GROUP NV	13,557	43.95	595,830.15
POSTE ITALIANE SPA	25,777	8.09	208,639.03
SAMPO OYJ-A SHS	25,899	40.85	1,057,974.15
AROUNDTOWN SA	52,418	3.11	163,386.90
LEG IMMOBILIEN SE	3,774	87.18	329,017.32
VONOVIA SE	36,313	31.92	1,159,110.96
ADYEN NV	1,088	1,622.00	1,764,736.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	22,519	56.00	1,261,064.00
BECHTLE AG	4,296	40.08	172,183.68
CAPGEMINI SA	7,986	171.10	1,366,404.60
DASSAULT SYSTEMES SA	33,230	39.48	1,311,920.40
EDENRED	12,673	47.33	599,813.09
NEMETSCHKE SE	3,320	61.20	203,184.00
NEXI SPA	26,598	8.29	220,497.42
SAP SE	52,396	92.06	4,823,575.76
WORLDLINE SA	10,832	36.59	396,342.88
NOKIA OYJ	272,288	5.01	1,364,979.74
CELLNEX TELECOM SA	27,196	42.40	1,153,110.40
DEUTSCHE TELEKOM	158,666	18.16	2,882,009.22
ELISA A	6,367	52.90	336,814.30
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,877	9.94	147,996.39
KPN (KON.)	173,861	3.28	571,481.10
ORANGE	97,536	10.11	986,869.24
PROXIMUS	7,531	13.34	100,463.54
TELECOM ITALIA ORD	489,749	0.21	105,687.83
TELEFONICA	260,074	4.38	1,140,424.49
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	2.66	108,901.65
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,889	25.79	151,877.31
ACCIONA SA	1,278	184.70	236,046.60
E.ON SE	109,829	8.45	928,714.02
EDP RENOVAVEIS SA	15,418	24.00	370,032.00

	ELECTRICITE DE FRANCE	21,082	11.77	248,135.14
	ELIA GROUP SA/NV	1,604	143.80	230,655.20
	ENAGAS	11,944	18.74	223,830.56
	ENDESA	17,138	17.77	304,542.26
	ENEL	398,046	4.72	1,880,369.30
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	139,324	4.74	661,231.70
	ENGIE	91,232	11.41	1,041,504.51
	FORTUM OYJ	20,155	11.35	228,860.02
	IBERDROLA SA	284,072	9.99	2,838,447.42
	IBERDROLA SA-RTS	284,072	0.26	76,358.55
	NATURGY ENERGY GROUP SA	9,726	28.22	274,467.72
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,296	18.32	426,782.72
	RWE STAMM	31,648	37.52	1,187,432.96
	SNAM SPA	90,959	4.81	437,785.66
	TERNA SPA	63,339	7.19	455,914.12
	UNIPER SE	4,137	7.46	30,882.70
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	31,290	23.77	743,763.30
	VERBUND AG	3,100	106.40	329,840.00
	ASM INTERNATIONAL NV	2,248	274.15	616,289.20
	ASML HOLDING NV	20,078	522.50	10,490,755.00
	INFINEON TECHNOLOGIES	64,521	24.82	1,601,733.82
	STMICROELECTRONICS	34,099	33.93	1,156,979.07
	ユーロ 小計	9,351,564		205,537,252.25 (28,602,564,023)
イギリスポンド	BP PLC	975,033	3.83	3,737,301.48
	SHELL PLC-NEW	379,061	20.39	7,730,949.09
	ANGLO AMERICAN PLC	63,630	26.65	1,696,057.65
	ANTOFAGASTA PLC	17,358	10.76	186,772.08
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,013	70.50	494,416.50
	GLENCORE PLC	495,828	4.22	2,093,385.81
	JOHNSON MATTHEY PLC	8,824	21.18	186,892.32
	MONDI PLC	22,378	14.16	316,984.37
	RIO TINTO PLC REG	56,429	47.72	2,692,791.88
	ASHTREAD GROUP PLC	22,405	41.89	938,545.45
	BAE SYSTEMS PLC	156,168	7.80	1,218,110.40
	BUNZL PLC	15,472	30.43	470,812.96
	DCC PLC	4,499	52.56	236,467.44
	FERGUSON PLC	11,566	99.76	1,153,824.16
	MELROSE INDUSTRIES PLC	215,001	1.63	352,171.63
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	385,471	0.92	356,946.14
	SMITHS GROUP PLC	20,046	14.95	299,687.70
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,672	113.35	416,221.20

EXPERIAN PLC	46,007	28.34	1,303,838.38
INTERTEK GROUP PLC	7,435	45.17	335,838.95
RELX PLC	95,541	23.58	2,252,856.78
RENTOKIL INITIAL PLC	85,410	5.15	440,203.14
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	4.99	254,788.04
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,048	41.73	252,383.04
BURBERRY GROUP PLC	18,587	17.25	320,718.68
PERSIMMON PLC	14,327	18.57	266,124.02
TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	1.26	209,552.57
COMPASS GROUP PLC	90,247	18.54	1,673,179.38
ENTAIN PLC	26,944	11.80	317,939.20
INTERCONTINENTAL HOTELS	10,141	47.62	482,914.42
WHITBREAD PLC	10,170	26.90	273,573.00
AUTO TRADER GROUP PLC	43,890	6.12	268,782.36
INFORMA PLC	69,112	5.88	406,931.45
PEARSON	34,302	7.91	271,397.42
WPP PLC	56,693	8.71	494,136.18
JD SPORTS FASHION PLC	114,330	1.41	162,234.27
KINGFISHER PLC	96,593	2.65	256,357.82
NEXT PLC	6,143	66.86	410,720.98
OCADO GROUP PLC	23,500	7.91	186,026.00
SAINSBURY (J) PLC	82,018	2.20	180,767.67
TESCO PLC	393,967	2.59	1,021,950.39
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	15,871	16.99	269,648.29
BRITISH AMERICAN TOBACCO	109,104	34.20	3,731,902.32
COCA-COLA HBC AG-CDI	9,115	19.45	177,332.32
DIAGEO	115,944	37.20	4,313,116.80
IMPERIAL BRANDS PLC	45,617	18.55	846,195.35
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	35,301	62.68	2,212,666.68
UNILEVER PLC	126,231	39.11	4,937,525.56
SMITH & NEPHEW PLC	42,096	11.90	501,152.88
ASTRAZENECA	77,234	107.66	8,315,012.44
GSK PLC	203,541	17.43	3,548,126.71
HALEON PLC	254,427	3.16	805,261.45
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	8,586	17.11	146,906.46
BARCLAYS	811,088	1.57	1,280,221.29
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,012,138	5.15	5,214,534.97
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,573,042	0.43	1,544,626.05
NATWEST GROUP PLC	302,525	2.25	680,983.77
STANDARD CHARTERED PLC	124,429	5.72	712,729.31
3I GROUP PLC	45,010	12.37	556,773.70
ABRDN PLC	100,722	1.61	162,766.75

	HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,246	8.56	156,331.72
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	16,399	78.52	1,287,649.48
	M&G PLC	118,170	2.15	254,420.01
	SCHRODERS PLC	5,525	27.66	152,821.50
	ST JAMES'S PLACE PLC	26,728	11.85	316,726.80
	ADMIRAL GROUP PLC	9,872	17.35	171,328.56
	AVIVA PLC	138,721	3.91	543,370.15
	LEGAL & GENERAL GROUP	289,782	2.56	743,870.39
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	43,255	6.06	262,125.30
	PRUDENTIAL	138,731	10.02	1,390,778.27
	AVEVA GROUP PLC	4,523	23.93	108,235.39
	SAGE GROUP PLC	48,541	7.00	339,981.16
	HALMA PLC	17,484	22.82	398,984.88
	BT GROUP PLC	323,026	1.77	572,402.07
	VODAFONE GROUP PLC	1,374,547	1.29	1,773,440.53
	NATIONAL GRID PLC	179,691	11.03	1,982,890.18
	SEVERN TRENT PLC	11,927	29.31	349,580.37
	SSE PLC	50,382	17.27	870,349.05
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	10.77	374,064.90
	イギリスポンド 小計	14,270,572		88,628,386.21 (14,488,968,577)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	8,748	17.60	153,964.80
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	310	730.00	226,300.00
	GIVAUDAN-REG	454	3,269.00	1,484,126.00
	HOLCIM LTD	28,055	41.83	1,173,540.65
	SIKA AG-BR	7,320	228.10	1,669,692.00
	ABB LTD	79,686	27.55	2,195,349.30
	GEBERIT AG-REG	1,777	493.40	876,771.80
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	911	170.80	155,598.80
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,021	175.00	353,675.00
	VAT GROUP AG	1,440	261.80	376,992.00
	ADECCO GROUP AG-REG	6,959	33.53	233,335.27
	SGS SA	347	2,302.00	798,794.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,730	246.00	671,580.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	25,653	106.75	2,738,457.75
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,285	246.00	316,110.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	46.24	138,904.96
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	189	2,108.00	398,412.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	102,700.00	513,500.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	55	9,840.00	541,200.00
	NESTLE SA - REGISTERED	139,868	116.24	16,258,256.32
	ALCON INC	24,786	71.84	1,780,626.24

	SONOVA HOLDING AG-REG	2,490	339.90	846,351.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,767	125.25	722,316.75	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,950	63.75	124,312.50	
	LONZA GROUP AG-REG	3,643	551.20	2,008,021.60	
	NOVARTIS	108,984	82.95	9,040,222.80	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,394	394.60	550,072.40	
	ROCHE HOLDING GENUSS	34,930	325.20	11,359,236.00	
	VIFOR PHARMA AG/NEW	2,126	166.05	353,022.30	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	129,034	5.33	688,267.35	
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,425	45.35	472,773.75	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,152	957.40	1,102,924.80	
	UBS GROUP AG	175,968	15.92	2,802,290.40	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	150.70	351,733.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,612	485.00	781,820.00	
	SWISS RE LTD	15,298	71.54	1,094,418.92	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,419	408.80	3,032,887.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,622	87.65	317,468.30	
	TEMENOS AG - REG	3,520	76.66	269,843.20	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,298	53.24	441,785.52	
	SWISSCOM	1,331	513.60	683,601.60	
	スイスフラン 小計	856,900		70,098,557.08 (9,932,264,552)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	13,081	311.85	4,079,309.85	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,106	413.20	2,109,799.20	
	SCA SV CELLULOSA B	26,880	147.60	3,967,488.00	
	ALFA LAVAL AB	14,260	298.90	4,262,314.00	
	ASSA ABLOY AB-B	50,678	232.20	11,767,431.60	
	ATLAS COPCO A	132,288	110.22	14,580,783.36	
	ATLAS COPCO B	71,092	98.57	7,007,538.44	
	EPIROC AB-A	29,649	169.90	5,037,365.10	
	EPIROC AB-B	17,442	151.60	2,644,207.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	81.50	1,780,041.50	
	INDUTRADE AB	14,669	228.70	3,354,800.30	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,081	238.70	1,928,934.70	
	LIFCO AB-B SHS	13,590	188.50	2,561,715.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	80,939	93.66	7,580,746.74	
	SANDVIK AB	56,973	176.00	10,027,248.00	
	SKANSKA B	14,869	171.55	2,550,776.95	
	SKF AB-B	18,340	169.75	3,113,215.00	
	VOLVO AB-A SHS	8,748	183.30	1,603,508.40	
VOLVO B	71,980	176.94	12,736,141.20		
SECURITAS B	15,577	92.00	1,433,084.00		



	VOLVO CAR AB-B	35,544	78.00	2,772,432.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	12,053	144.12	1,737,078.36	
	EVOLUTION AB	9,622	939.70	9,041,793.40	
	EMBRACER GROUP AB	34,541	79.28	2,738,410.48	
	HENNES & MAURITZ B	33,524	134.46	4,507,637.04	
	SWEDISH MATCH AB	74,128	106.00	7,857,568.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	31,655	254.70	8,062,528.50	
	GETINGE AB-B SHS	12,650	230.70	2,918,355.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	9,481	218.70	2,073,494.70	
	NORDEA BANK ABP	161,977	96.40	15,614,582.80	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	82,855	107.60	8,915,198.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	70,420	88.78	6,251,887.60	
	SWEDBANK AB-A	40,897	137.00	5,602,889.00	
	EQT AB	15,478	252.90	3,914,386.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,848	252.30	1,727,750.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	249.10	2,149,982.10	
	INVESTOR AB-A SHS	23,000	199.85	4,596,550.00	
	INVESTOR AB-B SHS	90,842	183.06	16,629,536.52	
	KINNEVIK AB - B	10,757	177.65	1,910,981.05	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,093	461.40	1,888,510.20	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	32,478	63.94	2,076,643.32	
	SAGAX AB-B	9,400	254.20	2,389,480.00	
	SINCH AB	27,717	27.40	759,445.80	
	ERICSSON (LM) B	145,922	75.74	11,052,132.28	
	HEXAGON AB-B SHS	98,582	116.90	11,524,235.80	
	TELE2 AB-B SHS	24,520	114.45	2,806,314.00	
	TELIA CO AB	138,487	37.14	5,143,407.18	
	スウェーデンクローナ 小計	1,932,185		250,789,658.27 (3,340,518,248)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	13,206	315.00	4,159,890.00	
	EQUINOR ASA	47,036	342.90	16,128,644.40	
	NORSK HYDRO	61,358	59.60	3,656,936.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,719	407.60	3,146,264.40	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,500	339.60	1,528,200.00	
	ADEVINTA ASA	16,857	71.20	1,200,218.40	
	MOWI ASA	23,314	219.70	5,122,085.80	
	ORKLA	39,803	81.72	3,252,701.16	
	SALMAR ASA	2,953	683.00	2,016,899.00	
	DNB BANK ASA	46,261	186.25	8,616,111.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	202.40	2,257,367.20	
	TELENOR ASA	30,180	116.40	3,512,952.00	
		304,340		54,598,270.41	

ノルウェークローネ 小計				(748,542,287)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,314	469.90	2,497,048.60
	NOVOZYMES A/S	10,786	447.90	4,831,049.40
	ROCKWOOL A/S-B SHS	428	1,763.50	754,778.00
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	48,316	174.96	8,453,367.36
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	152	18,040.00	2,742,080.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	251	18,195.00	4,566,945.00
	DSV A/S	9,463	1,149.00	10,872,987.00
	PANDORA A/S	4,249	517.20	2,197,582.80
	CARLSBERG AS-B	4,526	940.20	4,255,345.20
	COLOPLAST-B	6,218	867.20	5,392,249.60
	DEMANT A/S	4,463	285.90	1,275,971.70
	GN STORE NORD A/S	6,740	254.70	1,716,678.00
	GENMAB A/S	3,223	2,606.00	8,399,138.00
	NOVO NORDISK A/S-B	83,884	840.40	70,496,113.60
	DANSKE BANK A/S	31,666	98.62	3,122,900.92
	TRYG A/S	16,972	163.10	2,768,133.20
ORSTED A/S	9,594	822.00	7,886,268.00	
デンマーククローネ 小計		246,245		142,228,636.38 (2,659,675,500)
オーストラリアドル	AMPOL LTD	12,821	32.57	417,579.97
	SANTOS	153,046	7.03	1,075,913.38
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,345	24.75	256,038.75
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	92,816	30.97	2,874,511.52
	BHP GROUP LTD	251,852	36.75	9,255,561.00
	BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	16.30	351,248.70
	EVOLUTION MINING LTD	88,310	2.34	206,645.40
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	85,584	17.83	1,525,962.72
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	20,170	34.89	703,731.30
	MINERAL RESOURCES LTD	10,000	46.82	468,200.00
	NEWCREST MINING LIMITED	45,440	19.26	875,174.40
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	58,122	7.12	413,828.64
	ORICA LTD	19,570	16.46	322,122.20
	RIO TINTO LTD	18,796	96.26	1,809,302.96
	SOUTH32 LTD	217,613	3.53	768,173.89
	REECE LTD	12,870	14.65	188,545.50
	BRAMBLES LTD	66,936	11.47	767,755.92
	AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	3.87	362,247.48
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	39,948	4.51	180,165.48
	TRANSURBAN GROUP	153,930	14.04	2,161,177.20
ARISTOCRAT LEISURE LTD	31,473	36.12	1,136,804.76	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,685	71.17	191,091.45	

	IDP EDUCATION LTD	12,550	26.53	332,951.50	
	LOTTERY CORP LTD/THE	98,817	4.44	438,747.48	
	REA GROUP LTD	3,000	122.75	368,250.00	
	SEEK LTD	17,113	22.48	384,700.24	
	WESFARMERS LTD	56,329	47.53	2,677,317.37	
	COLES GROUP LTD	68,071	18.86	1,283,819.06	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	58,785	7.97	468,516.45	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	63,525	37.25	2,366,306.25	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	11.84	408,243.20	
	COCHLEAR LIMITED	3,460	214.00	740,440.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,641	71.18	686,246.38	
	SONIC HEALTHCARE LTD	20,560	34.75	714,460.00	
	CSL LIMITED	24,011	293.47	7,046,508.17	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	140,921	22.59	3,183,405.39	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND -RTS	9,394	3.65	34,288.10	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	84,943	97.80	8,307,425.40	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	161,135	29.88	4,814,713.80	
	WESTPAC BANKING	178,990	21.07	3,771,319.30	
	ASX LTD	8,713	86.50	753,674.50	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	18,256	174.24	3,180,925.44	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	114,505	4.21	482,066.05	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	129,252	3.42	442,041.84	
	QBE INSURANCE GROUP	78,253	11.40	892,084.20	
	SUNCORP GROUP LIMITED	57,398	11.01	631,951.98	
	COMPUTERSHARE LIMITED	28,589	26.10	746,172.90	
	WISETECH GLOBAL LTD	6,445	49.21	317,158.45	
	XERO LTD	7,073	91.22	645,199.06	
	TELSTRA CORP	199,810	3.96	791,247.60	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	87,883	5.62	493,902.46	
	オーストラリアドル 小計	3,289,382		73,715,865.19 (6,933,714,279)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	64,661	7.30	472,025.30	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	24,554	21.82	535,768.28	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	104,543	4.96	518,533.28	
	MERCURY NZ LTD	19,343	5.85	113,156.55	
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	4.82	308,643.88	
	ニュージーランドドル 小計	277,135		1,948,127.29 (165,590,819)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	139,448	52.10	7,265,240.80	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	69,000	90.85	6,268,650.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	102,000	16.02	1,634,040.00	
	MTR CORP	82,500	40.85	3,370,125.00	

	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	81,000	27.35	2,215,350.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	97,000	44.90	4,355,300.00	
	SANDS CHINA LTD	127,000	17.86	2,268,220.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	89,600	15.48	1,387,008.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	83,000	22.80	1,892,400.00	
	WH GROUP LTD	446,619	5.90	2,635,052.10	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	191,500	28.35	5,429,025.00	
	HANG SENG BANK	39,600	128.20	5,076,720.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	58,600	351.60	20,603,760.00	
	AIA GROUP LTD	599,400	79.50	47,652,300.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	98,448	55.30	5,444,174.40	
	ESR GROUP LTD	92,400	19.44	1,796,256.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	115,000	14.12	1,623,800.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	79,761	27.10	2,161,523.10	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	76,250	26.15	1,993,937.50	
	SINO LAND CO	116,600	11.38	1,326,908.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	71,500	91.00	6,506,500.00	
	SWIRE PACIFIC A	20,000	44.85	897,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,000	18.54	1,279,260.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	81,000	33.80	2,737,800.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	48.45	1,550,400.00	
	CLP HOLDINGS	81,000	65.70	5,321,700.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	519,990	8.21	4,269,117.90	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	51.30	3,770,550.00	
	香港ドル 小計	3,732,716		152,732,117.80 (2,659,066,170)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	80,200	6.57	526,914.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	4.10	306,680.00	
	SINGAPORE AIRLINES	54,650	5.38	294,017.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	0.81	258,957.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	81,700	3.99	325,983.00	
	DBS GROUP	89,600	31.26	2,800,896.00	
	OCBC BANK	171,350	11.48	1,967,098.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	57,900	27.46	1,589,934.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	9.77	415,225.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	118,900	3.85	457,765.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	7.75	170,500.00	
	UOL GROUP LIMITED	24,800	7.34	182,032.00	
	VENTURE CORP LTD	14,300	17.33	247,819.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	420,880	2.65	1,115,332.00	
	シンガポールドル 小計	1,573,280		10,659,152.00 (1,047,901,233)	

イスラエルシェケル	ICL LTD	28,484	31.48	896,676.32
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,248	776.50	969,072.00
	BANK HAPOALIM BM	63,371	32.17	2,038,645.07
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,692	32.69	2,310,921.48
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,227	19.73	1,267,198.71
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,272	126.60	794,035.20
	AZRIELI GROUP	1,471	271.00	398,641.00
	NICE LTD	3,165	722.10	2,285,446.50
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	5,624	158.40	890,841.60
イスラエルシェケル 小計		244,554		11,851,477.88 (470,709,887)
合 計		55,001,553		316,506,290,789 (316,506,290,789)

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	63,405	748,179.00	
		LENLEASE GROUP	36,448	359,741.76	
	オーストラリアドル 小計		99,853	1,107,920.76	(104,211,026)
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	130,000	911,300.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	2,023,900.00	
	香港ドル 小計		315,000	2,935,200.00	(51,101,832)
投資信託受益証券合計			414,853	155,312,858	(155,312,858)
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,686	1,154,590.92	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	16,172	588,175.64	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	22,709	5,895,256.40	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	71,103	457,903.32	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,916	1,371,097.00	
		BOSTON PROPERTIES	6,840	605,682.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,093	691,833.12	
		CROWN CASTLE INTL CORP	21,569	3,728,417.34	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,046	1,789,741.32	
		DUKE REALTY CORP	19,458	1,161,448.02	
		EQUINIX INC	4,536	2,965,546.08	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,979	644,692.20	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	17,656	1,294,361.36	
		ESSEX PROPERTY TRUST	3,024	828,001.44	

	EXTRA SPACE STORAGE INC	6,789	1,207,830.99
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	19,000	462,840.00
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	24,947	668,579.60
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,496	549,832.32
	INVITATION HOMES INC	30,792	1,122,368.40
	IRON MOUNTAIN INC	13,240	627,178.80
	KIMCO REALTY CORP	31,093	666,944.85
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	27,097	448,455.35
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,856	1,019,236.80
	PROLOGIS INC	36,906	4,683,371.40
	PUBLIC STORAGE	7,808	2,493,328.64
	REALTY INCOME CORP	29,689	2,118,310.15
	REGENCY CENTERS CORP	7,026	441,373.32
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5,468	1,754,189.08
	SIMON PROPERTY GROUP	16,262	1,686,044.16
	SUN COMMUNITIES INC	5,410	868,413.20
	UDR INC	14,820	684,239.40
	VENTAS INC	20,307	1,051,496.46
	VICI PROPERTIES INC	46,821	1,547,902.26
	VORNADO REALTY TRUST	7,639	226,343.57
	WELLTOWER INC	22,461	1,860,444.63
	WP CAREY INC	8,887	740,820.32
	アメリカドル 小計	646,601	50,106,289.86 (6,846,022,383)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,069	238,395.07
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	181,494.05
	カナダドル 小計	14,014	419,889.12 (44,336,092)
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	-
	COVIVIO(FP)	3,076	180,407.40
	GECINA SA	1,966	194,240.80
	KLEPIERRE	8,356	176,395.16
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,185	321,743.70
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,235	231,954.10
	ユーロ 小計	1,632,402	1,104,741.16 (153,735,779)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	39,175	191,604.92
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	235,399.03
	SEGRO PLC	63,208	682,646.40
	イギリスポンド 小計	134,515	1,109,650.35 (181,405,639)
オーストラリアドル	DEXUS	49,283	460,303.22
	GOODMAN GROUP	83,969	1,614,723.87

		GPT GROUP	85,529	384,880.50	
		MIRVAC GROUP	176,235	373,618.20	
		SCENTRE GROUP	234,255	665,284.20	
		STOCKLAND	121,481	464,057.42	
		VICINITY CENTERS	163,023	326,046.00	
	オーストラリアドル 小計		913,775	4,288,913.41	(403,415,195)
香港ドル		LINK REIT	107,800	6,883,030.00	
	香港ドル 小計		107,800	6,883,030.00	(119,833,552)
シンガポールドル		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	135,809	395,204.19	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	276,190	577,237.10	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	132,200	243,248.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	174,778	304,113.72	
	シンガポールドル 小計		718,977	1,519,803.01	(149,411,833)
投資証券合計			4,168,084	7,898,160,473	(7,898,160,473)
合計				8,053,473,331	(8,053,473,331)

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 604銘柄	97.2%			71.9%
	投資証券 36銘柄			2.8%	2.1%
カナダドル	株式 86銘柄	99.6%			3.7%
	投資証券 2銘柄			0.4%	0.0%
ユーロ	株式 225銘柄	99.5%			8.8%
	投資証券 6銘柄			0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 79銘柄	98.8%			4.5%
	投資証券 3銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 41銘柄	100.0%			3.1%
スウェーデンクローナ	株式 47銘柄	100.0%			1.0%
ノルウェークローネ	株式 12銘柄	100.0%			0.2%

デンマーククローネ	株式	17銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式	51銘柄	93.2%			2.1%
	投資信託受 益証券	2銘柄		1.4%		0.0%
	投資証券	7銘柄			5.4%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	28銘柄	94.0%			0.8%
	投資信託受 益証券	2銘柄		1.8%		0.0%
	投資証券	1銘柄			4.2%	0.0%
シンガポールドル	株式	14銘柄	87.5%			0.3%
	投資証券	4銘柄			12.5%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。



**【中間財務諸表】**

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期中間計算期間(2022年7月26日から2023年1月25日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【インデックスコレクション（外国株式）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第12期 （2022年 7月25日現在）	第13期中間計算期間 （2023年 1月25日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	167,321,370	146,130,584
親投資信託受益証券	70,489,921,325	75,707,865,504
未収入金	32,788,246	-
流動資産合計	70,690,030,941	75,853,996,088
資産合計	70,690,030,941	75,853,996,088
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	113,834,056	49,596,911
未払受託者報酬	7,090,317	8,238,305
未払委託者報酬	42,541,835	49,429,755
未払利息	68	73
その他未払費用	909,459	954,433
流動負債合計	164,375,735	108,219,477
負債合計	164,375,735	108,219,477
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	14,404,844,045	15,455,978,821
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	56,120,811,161	60,289,797,790
（分配準備積立金）	17,005,425,851	15,706,817,022
元本等合計	70,525,655,206	75,745,776,611
純資産合計	70,525,655,206	75,745,776,611
負債純資産合計	70,690,030,941	75,853,996,088

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期中間計算期間 自 2021年 7月27日 至 2022年 1月26日	第13期中間計算期間 自 2022年 7月26日 至 2023年 1月25日
営業収益		
受取利息	875	127
有価証券売買等損益	8,372,664	116,235,120
営業収益合計	8,371,789	116,235,247
営業費用		
支払利息	32,332	44,575
受託者報酬	6,435,974	8,238,305
委託者報酬	38,615,772	49,429,755
その他費用	909,370	954,433
営業費用合計	45,993,448	58,667,068
営業利益又は営業損失（ ）	54,365,237	57,568,179
経常利益又は経常損失（ ）	54,365,237	57,568,179
中間純利益又は中間純損失（ ）	54,365,237	57,568,179
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（ ）	180,894,021	97,682,904
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	39,255,121,485	56,120,811,161
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,196,724,228	8,829,652,762
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,196,724,228	8,829,652,762
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,243,049,068	4,620,551,408
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,243,049,068	4,620,551,408
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	45,973,537,387	60,289,797,790

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第12期 (2022年 7月25日現在)	第13期中間計算期間 (2023年 1月25日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	14,404,844,045口	15,455,978,821口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 4.8960円 (48,960円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 4.9007円 (49,007円)

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

	第13期中間計算期間 (2023年 1月25日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	第12期	第13期中間計算期間
	自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日	自 2022年 7月26日 至 2023年 1月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	11,167,433,861円	14,404,844,045円
期中追加設定元本額	5,769,271,220円	2,235,338,797円
期中一部解約元本額	2,531,861,036円	1,184,204,021円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 外国株式マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2023年 1月25日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	9,637,390,656
コール・ローン	1,123,526,051
株式	327,492,882,697
投資信託受益証券	133,002,263
投資証券	7,680,320,951
派生商品評価勘定	277,859,364
未収入金	23,432,035
未収配当金	261,614,338
差入委託証拠金	3,552,981,847
流動資産合計	350,183,010,202

	2023年 1月25日現在
項目	金額（円）
資産合計	350,183,010,202
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,973,276
前受金	277,657,359
未払解約金	49,506,108
未払利息	566
流動負債合計	338,137,309
負債合計	338,137,309
純資産の部	
元本等	
元本	76,778,591,222
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	273,066,281,671
元本等合計	349,844,872,893
純資産合計	349,844,872,893
負債純資産合計	350,183,010,202

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 1月25日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

2023年 1月25日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2023年 1月25日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	76,778,591,222口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産 の額	1口当たり純資産額 4.5565円 (1万口当たり純資産額) (45,565円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

2023年 1月25日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

## (その他の注記)

元本の移動

区分	2023年 1月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月26日
期首元本額	74,737,903,542円
期中追加設定元本額	4,212,227,332円
期中一部解約元本額	2,171,539,652円
期末元本額	76,778,591,222円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,486,879,007円
D C 外国株式インデックスファンド	5,053,254,740円
D C 外国株式インデックスファンド L	28,025,693,097円



区分	2023年 1月25日現在
DCバランスファンド30	618,436,478円
DCバランスファンド50	1,260,148,586円
DCバランスファンド70	856,535,323円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	280,306,662円
外国株式インデックスe	4,592,294,793円
インデックスコレクション（外国株式）	16,615,355,098円
インデックスコレクション（バランス株式30）	3,189,036,522円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,021,192,868円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,055,844,437円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,241,396,670円
外国株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	1,441,690,416円
外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	368,725,506円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	18,855,934円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	219,591,501円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	28,182,112円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	61,677,719円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	119,285,558円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	202,721,126円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	166,490,125円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	3,260,312,312円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	353,108,185円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	88,166,463円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	546,513,366円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	11,030,021円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	67,320,867円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	71,156,257円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	229,518,020円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	7,853,642円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	54,562,738円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	160,406,272円
私募外国株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	5,048,801円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 1月25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	14,944,216,995	-	15,221,874,354	277,657,359
合計		14,944,216,995	-	15,221,874,354	277,657,359

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2023年 1月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,784,705,072	-	1,773,933,801	10,771,271
	アメリカドル	1,375,564,300	-	1,365,113,595	10,450,705
	カナダドル	51,652,157	-	51,651,256	901
	ユーロ	248,397,295	-	248,140,010	257,285
	イギリスポンド	48,120,540	-	48,077,460	43,080
	スイスフラン	22,635,280	-	22,616,880	18,400
	スウェーデンクローナ	38,335,500	-	38,334,600	900
合計		1,784,705,072	-	1,773,933,801	10,771,271

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【インデックスコレクション（外国株式）】

## 【純資産額計算書】

(2023年 2月28日現在)

資産総額	78,825,801,781円
負債総額	113,860,293円
純資産総額（ - ）	78,711,941,488円
発行済口数	15,505,584,328口
1口当たり純資産額（ / ）	5.0764円
（1万口当たり純資産額）	（50,764円）

(参考)

## 外国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2023年 2月28日現在)

資産総額	363,897,313,840円
負債総額	267,222,226円
純資産総額（ - ）	363,630,091,614円
発行済口数	77,029,927,166口
1口当たり純資産額（ / ）	4.7206円
（1万口当たり純資産額）	（47,206円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

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

ません。

#### 受益権の譲渡

- イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。
- ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（2023年 2月28日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ D0（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

委託会社の機構は2023年 4月25日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年2月28日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	535	14,367,379
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	68	210,009
単位型公社債投資信託	53	181,820
合計	656	14,759,208

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36期事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第37期事業年度の中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

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

（単位：百万円）

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



## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：百万円 )

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

（単位：百万円）

	前事業年度	当事業年度
	（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
営業外収益		
受取利息	2	2
収益分配金	101	16
金銭の信託運用益	3,038	-
投資有価証券売却益	1	0
投資有価証券償還益	54	219
その他	45	8
営業外収益合計	3,243	247
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	332
投資有価証券売却損	0	0
投資有価証券償還損	0	-
為替差損	158	291
デリバティブ費用	3,782	1,191
その他	5	33
営業外費用合計	3,946	1,848
経常利益	10,281	9,545
特別損失		
退職給付費用	-	120
システム統合費用	110	-
特別損失合計	110	120
税引前当期純利益	10,170	9,425
法人税、住民税及び事業税	3,242	3,403
法人税等調整額	65	465
法人税等合計	3,177	2,937
当期純利益	6,993	6,487

## （ 3 ）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	-	3,136	3,330	3,330
当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					

当期変動額合計	-	-	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	791	65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	444	295	295
当期変動額合計	149	444	295	3,394
当期末残高	941	509	431	64,219

## 注記事項

（重要な会計方針）

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### （1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### （2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

### 2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 4．固定資産の減価償却の方法

#### （1）有形固定資産

定額法によっております。

#### （2）無形固定資産

定額法によっております。

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

### 5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

### 6．引当金の計上基準

#### （1）賞与引当金

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

#### （2）退職給付引当金

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

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

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

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当事業年度末の自己都合要支給額を退職給付債

務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

## 7. 収益及び費用の計上基準

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

### (1) 投資信託委託業務

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

### (2) 投資一任業務

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

### (3) 投資助言業務

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

### (4) 成功報酬

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

## 8. ヘッジ会計の会計処理

### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

### (3) ヘッジ方針

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

### (4) ヘッジ有効性評価の方法

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

## 9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## 10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

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

## (会計方針の変更)

### 1. 「収益認識に関する会計基準」等の適用

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

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

### 2. 「時価の算定に関する会計基準」等の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-21項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来に

わたって適用することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

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

（未適用の会計基準等）

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

（1）概要

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

（2）適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

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

（追加情報）

退職給付債務及び費用の算定方法の変更

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

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

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3．剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
----	-------	-----------------	-----------------	-----	-------

2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日
----------------------	------	-------	-----------	------------	------------

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

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## （1）金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

## （2）金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファ

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針8．ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

#### 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それら的一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用してあります。

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

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

## 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

### (1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）（*1）
金銭の信託	10,857
投資有価証券 その他有価証券	9,950



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

（\*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

当事業年度（2022年3月31日）

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

（\*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（\*2）投資有価証券のうち、投資信託（貸借対照表計上額6,474百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額133百万円）は上記に含めておりません。

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

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

（2）時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

#### 金銭の信託

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

#### デリバティブ取引

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

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,589	-	-	-
未収委託者報酬	8,471	-	-	-

未収運用受託報酬	6,151	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	10	5,751	0

当事業年度(2022年3月31日)

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

## 1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:百万円)

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

## 2. その他有価証券

前事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度(2022年3月31日)

(単位:百万円)

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

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

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

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

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	109	1	0

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2021年3月31日）

#### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

##### （1）通貨関連

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

##### （2）株式関連

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

#### 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

当事業年度（2022年3月31日）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## (2) 株式関連

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

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

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

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

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

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

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

(単位：百万円)

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

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

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

## (5) 年金資産に関する事項

該当事項はありません。

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

## (資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (収益認識関係)

## 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

## 2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

## 3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において

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

## （セグメント情報等）

## 〔セグメント情報〕

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

## 〔関連情報〕

## 1．製品及びサービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

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

## 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

## （関連当事者情報）

## 1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

## 運用受託報酬

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

## 投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

## 運用受託報酬

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

## 投信販売代行手数料等

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

## (エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

前事業年度（2021年3月31日）

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

当事業年度（2022年3月31日）

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

## (1株当たり情報)

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



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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022年9月30日)

#### 資産の部

##### 流動資産

現金及び預金		21,051
金銭の信託		13,989
未収委託者報酬		9,325
未収運用受託報酬		5,831
短期差入証拠金		4,507
その他		3,041
流動資産合計		57,747

##### 固定資産

有形固定資産	1	895
無形固定資産		6,915
投資その他の資産		
投資有価証券		4,202
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,228
その他		31
投資その他の資産合計		11,098

固定資産合計		18,909
--------	--	--------

資産合計		76,657
------	--	--------

#### 負債の部

##### 流動負債

未払金		7,649
未払法人税等		1,537
賞与引当金		321
その他	2	2,111
流動負債合計		11,619

##### 固定負債

退職給付引当金		871
---------	--	-----

資産除去債務	153
その他	20
固定負債合計	1,045
負債合計	12,665

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022年9月30日)

純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	42,655
利益剰余金合計	45,255
株主資本合計	64,494
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	278
繰延ヘッジ損益	780
評価・換算差額等合計	502
純資産合計	63,992
負債・純資産合計	76,657

## 中間損益計算書

(単位：百万円)

第37期中間会計期間

(自 2022年4月1日

至 2022年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		20,422
運用受託報酬		5,485
その他営業収益		178
営業収益合計		26,086
営業費用		15,618
一般管理費	1	6,047
営業利益		4,421
営業外収益	2	2,365
営業外費用	3	1,945
経常利益		4,840
税引前中間純利益		4,840
法人税、住民税及び事業税		1,402
法人税等調整額		90

法人税等合計	1,492
中間純利益	3,347

## 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
別途積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当中間期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
中間純利益			3,347	3,347	3,347
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	-	-	706	706	706
当中間期末残高	500	2,100	42,655	45,255	64,494

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額 等 合計	
当期首残高	941	509	431	64,219
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,641
中間純利益				3,347
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	663	270	933	933
当中間期変動額合計	663	270	933	227
当中間期末残高	278	780	502	63,992

## 注記事項

(重要な会計方針)

## 第37期中間会計期間

(自 2022年4月1日

至 2022年9月30日)

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

## (1) 有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

## (2) デリバティブ

時価法によっております。

## (3) 金銭の信託

時価法によっております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定額法によっております。

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

## (2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

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

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

## 4. 収益及び費用の計上基準

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

## (1) 投資信託委託業務

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

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

第37期中間会計期間  
(自 2022年4月1日  
至 2022年9月30日)

「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 2021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り扱いに従って、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って適用することといたしました。これによる中間財務諸表への影響はありません。

(追加情報)

第37期中間会計期間  
(自 2022年4月1日  
至 2022年9月30日)

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の適用

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21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。

## （表示方法の変更）

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
従来「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。	

## （中間貸借対照表関係）

第37期中間会計期間末 （2022年9月30日）	
1 有形固定資産の減価償却累計額	777百万円
2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

## （中間損益計算書関係）

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	95百万円
無形固定資産	608百万円
2 営業外収益の主要項目	
デリバティブ利益	2,027百万円
投資有価証券売却益	317百万円
3 営業外費用の主要項目	
為替差損	1,011百万円
金銭の信託運用損	904百万円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

## 1．発行済株式に関する事項

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

## 2．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

### 3. 配当に関する事項

#### (1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの  
該当事項はありません。

#### (リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

#### (金融商品関係)

第37期中間会計期間末（2022年9月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（(1)\*2、\*3及び(注2)参照）。

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

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

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

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

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

#### (1) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区 分	中間貸借対照表計上額（百万円）(*1)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	952	12,129	-	13,081
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,978	-	3,978
資産計	952	16,107	-	17,060
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	804	(0)	-	804
ヘッジ会計が適用されているもの	-	22	-	22
デリバティブ取引計	804	21	-	826

(\*1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2)金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額908百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は13,989百万円であります。

(\*3)投資有価証券のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額223百万円）は上記に含めておりません。

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

（2）時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

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

（注2）市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
関係会社株式	5,636

（有価証券関係）

第37期中間会計期間末（2022年9月30日）

1．子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2．その他有価証券

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	2,657	1,966	690
小計	2,657	1,966	690



貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,321	1,615	293
小計	1,321	1,615	293
合計	3,978	3,581	397

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額0百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額223百万円）は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	6,412	-	5	5
	英ポンド	250	-	1	1
	カナダドル	111	-	1	1
	スイスフラン	164	-	1	1
	香港ドル	219	-	0	0
	ユーロ	721	-	0	0
	買建				
	米ドル	259	-	0	0
	香港ドル	2	-	0	0
合計		8,141	-	0	0

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	13,818	-	804	804
合計		13,818	-	804	804

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

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

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		3,036	-	2
	英ポンド		3,333	-	19
	スイスフラン		70	-	0
	香港ドル		87	-	0
	ユーロ		82	-	0
	買建				
	米ドル		93	-	0
	英ポンド		77	-	2
	スイスフラン		53	-	0
	香港ドル		3	-	0
	ユーロ		60	-	1
	合計		6,898	-	22

## （資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## （収益認識関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

## 1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

## 2．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針4．収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

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

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

## （セグメント情報等）

## 〔セグメント情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

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

## 〔関連情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

## 1．製品及びサービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,950百万円

## 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
1株当たり純資産額	21,330,712円74銭
1株当たり中間純利益	1,115,947円92銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
中間純利益	3,347百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	3,347百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

## 4【利害関係人との取引制限】

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

## (1)自己又はその役員との取引

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

## (2)運用財産相互間の取引

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

## (3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2023年4月25日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2022年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2022年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・

償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

### 3【資本関係】

#### (1)受託会社

該当事項はありません。

#### (2)販売会社

該当事項はありません。

#### (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2022年3月末日現在）

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

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

### 第3【その他】

- (1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。
- (3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用すること

があります。

- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

2022年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝

**監査意見**

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

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

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。



# 独立監査人の監査報告書

2022年10月5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスコレクション（外国株式）の2021年7月27日から2022年7月25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、インデックスコレクション（外国株式）の2022年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2022年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022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（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2023年4月6日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘

## 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」に掲げられているインデックスコレクション（外国株式）の2022年7月26日から2023年1月25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、インデックスコレクション（外国株式）の2023年1月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年7月26日から2023年1月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。