

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年5月19日提出
【計算期間】	第19期(自 2022年2月23日至 2023年2月22日)
【ファンド名】	三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンド
【発行者名】	三菱ＵＦＪ国際投信株式会社 ※２０２３年１０月１日より三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社に変更
【代表者の役職氏名】	取締役社長 横川 直
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目１２番１号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【連絡場所】	東京都千代田区有楽町一丁目１２番１号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

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

信託金の限度額は、5,000億円です。

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

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

商品分類表

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
		債券		
		海外	不動産投信	MR F
追加型	内外	その他資産 ()	E T F	特殊型 ()
		資産複合		

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 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 年６回 （隔月） 年１２回	グローバル （日本を除く）	ファミリー ファンド	あり （ ）	日経２２５	ブル・ベア型
債券 一般	（毎月）	日本 北米 欧州 アジア	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
公債	日々	オセアニア			その他 （MSCIコク サイ・インデ ックス（配当込 み、円換算ベ ース））	ロング・ ショート型／ 絶対収益 追求型
社債 その他債券 クレジット 属性 （ ）	その他 （ ）	中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング				その他 （ ）
不動産投信						
その他資産 （投資信託証券 （株式 一般））						
資産複合 （ ）						

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

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

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

商品分類の定義

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

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

属性区分の定義

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

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

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

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

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

日本を除く世界の主要国の株式を実質的な主要投資対象とし、日本を除く世界の主要国の株式の指標であるMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）と連動する投資成果をめざします。

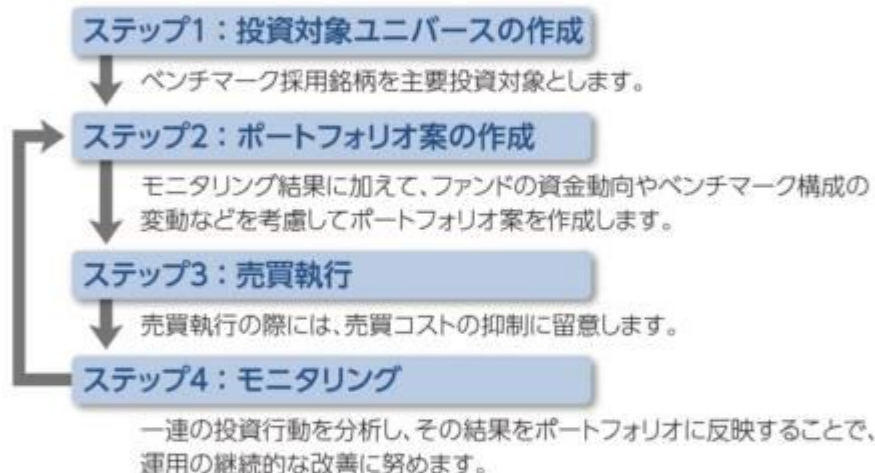
ファンドの特色

特色**1**

MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行い、海外の株式市場全体に投資するのと同じ投資効果をめざします。

- MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）をベンチマークとします。

＜運用プロセスのイメージ＞



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

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

特色**2**

日本を除く世界の主要国の株式へ幅広く投資を行います。

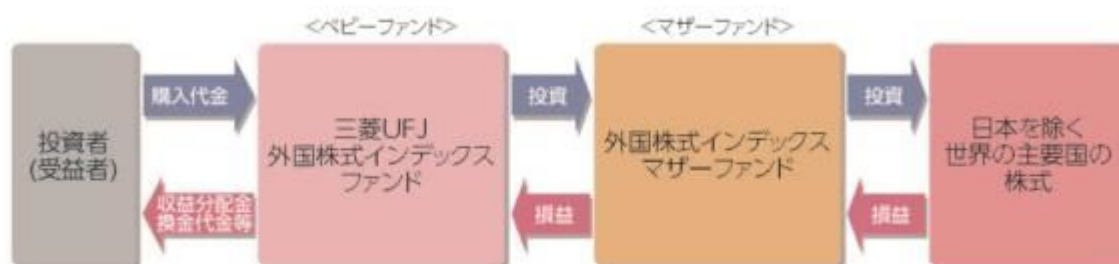
特色**3**

原則として、為替ヘッジは行いません。

- 為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

■ファンドの仕組み

運用は主に外国株式インデックスマザーファンドへの投資を通じて、日本を除く世界の主要国の株式へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。



■主な投資制限

株式	株式への実質投資割合に制限を設けません。
株式の一銘柄制限	同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
デリバティブ	デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。

■分配方針

- 年1回の決算時(2月22日(休業日の場合は翌営業日))に分配を行います。
- 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。
- 原則として、配当等収益の水準を考慮して分配します。
- 分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

 MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。

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

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

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2004年6月22日

設定日、信託契約締結、運用開始

2005年10月1日

ファンドの委託会社としての業務をユーエフジェイパートナーズ投信株式会社から三菱UFJ投信株式会社に承継

名称を「UFJパートナーズ 外国株式インデックスファンド」から「三菱UFJ 外国株式インデックスファンド」に変更

(3) 【ファンドの仕組み】

①委託会社およびファンドの関係法人の役割

投資家（受益者）

お申込金↓↑収益分配金、解約代金等

販売会社

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

お申込金↓↑収益分配金、解約代金等

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

②委託会社と関係法人との契約の概要

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

③委託会社の概況（2023年2月末現在）

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

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

外国株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界各国の株式に直接投資することがあります。
 受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合に、外国株式インデックスマザーファンドにおける株式の実質投資比率に当ファンドの当該マザーファンド受益証券への投資比率を乗じて得た割合を加算した比率）は信託財産の純資産総額を超える場合があります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

（２）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ａ．有価証券先物取引等

ｂ．スワップ取引

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

②有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、三菱ＵＦＪ国際投信株式会社を委託会社とし、三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社を受託会社とする外国株式インデックスマザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

１．株券または新株引受権証書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

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

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

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

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

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

１１．コマーシャル・ペーパー

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

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

１４．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）

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

１６．投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下16. に

において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 21. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 22. 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。）
 23. 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
 24. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいい、1. から23. に該当するものを除きます。）
 25. 外国の者に対する権利で23. および24. の有価証券の性質を有するもの
- なお、1. の証券または証書ならびに13. および19. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から6. までの証券ならびに16. の証券ならびに13. および19. の証券または証書のうち2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14. および15. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

③金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）は、次に掲げるものとします。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、1. から5. に該当するものを除きます。）
7. 投資事業有限責任組合契約に基づく権利（金融商品取引法第2条第2項第5号に該当するものをいいます。）
8. 外国の者に対する権利で5. から7. の権利の性質を有するもの

④その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

<外国株式インデックスマザーファンドの概要>

（基本方針）

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

（運用方法）

①投資対象

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

②投資態度

主として対象インデックスに採用されている株式に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

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

を行うことがあります。

・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

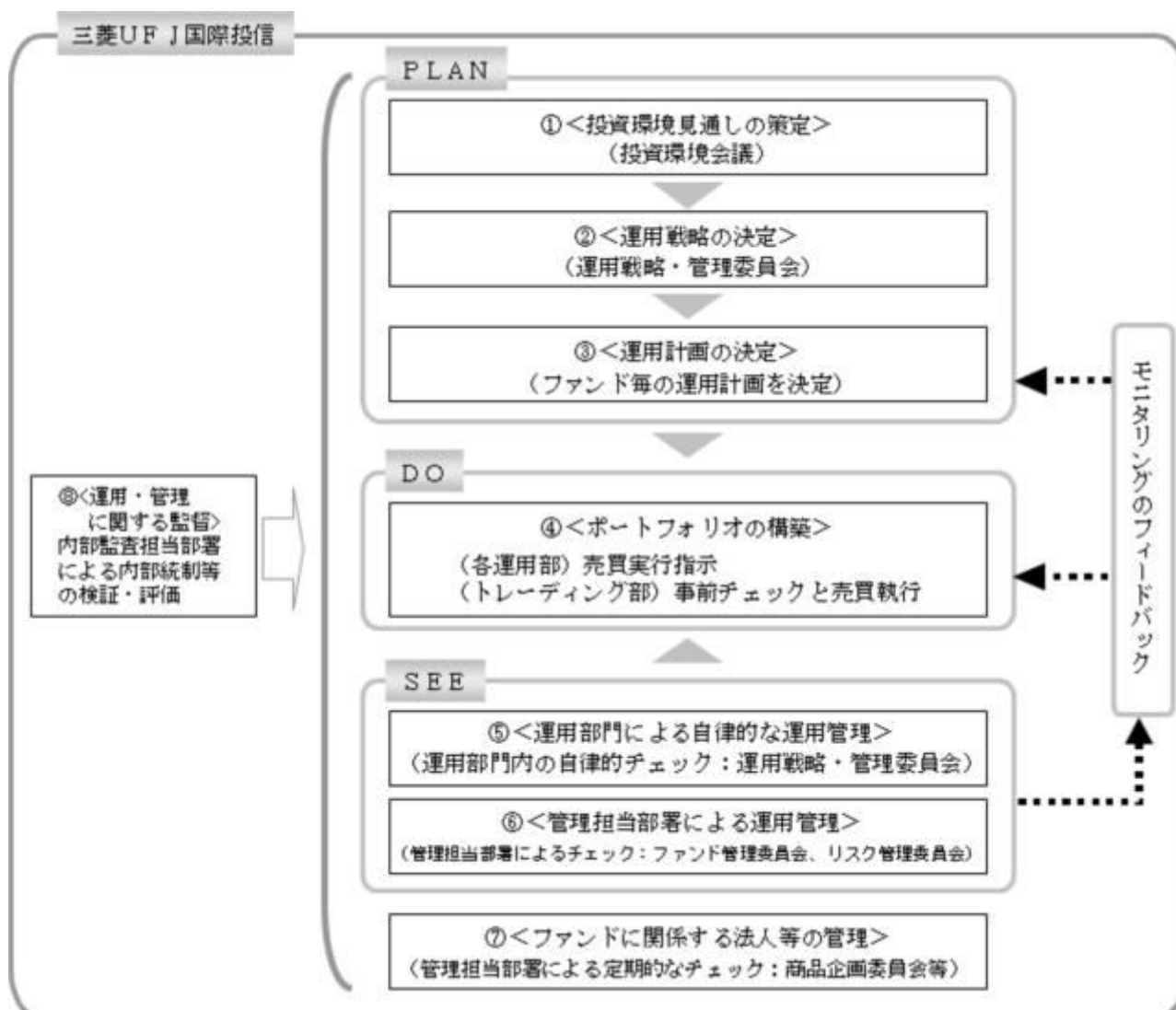
組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

（投資制限）

- ①株式への投資割合に制限を設けません。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
- ⑥有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑦スワップ取引を行うことができます。
- ⑧外国為替予約取引を行うことができます。
- ⑨デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- ⑩外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

（3）【運用体制】



①投資環境見通しの策定

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

②運用戦略の決定

運用戦略・管理委員会において、①で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

③運用計画の決定

②で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

④ポートフォリオの構築

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

⑤運用部門による自律的な運用管理

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、運用部門内の管理担当部署は逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また、運用戦略・管理委員会を通じて運用状況のモニタリングを行い、運用部門内での自律的牽制により運用改善を図ります。

⑥管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、（a）運用に関するパフォーマンス測定・分析、意図した運用成果が得られていない場合にはその原因の分析のほか、（b）リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、（a）についてはファンド管理委員会における審議を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバックされ、（b）についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

⑦ファンドに関係する法人等の管理

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

⑧運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

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

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

- ①分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ②収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ③収益の分配にあてなかった利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づいて運用を行います。

（５）【投資制限】

<信託約款に定められた投資制限>

①新株引受権証券および新株予約権証券

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

る投資の指図をしません。

- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

②投資信託証券

- a. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。以下同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

③同一銘柄の株式

同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。

④同一銘柄の転換社債等

- a. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債（新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

⑤スワップ取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異な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。）を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、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。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑥信用取引

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

⑦外国為替予約取引

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

- b. a. の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- c. b. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- d. b. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

⑧有価証券の借入れ

有価証券の借入れを行いません。

⑨資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

⑩投資する株式等の範囲

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

⑪有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. a. に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

⑫特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

⑬デリバティブ取引等

デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。）については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないことと

します。

⑭信用リスクの分散規制

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよ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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

<その他法令等に定められた投資制限>

・同一の法人の発行する株式への投資制限

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

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

（主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。）

①価格変動リスク

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動するため、当ファンドはその影響を受け株式の価格が下落した場合には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。

②為替変動リスク

実質的な主要投資対象である海外の株式は外貨建資産であり、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。そのため、為替相場が円高方向に進んだ場合には、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。

③信用リスク

信用リスクとは、有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等に、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払いや償還金の支払いが滞る等の債務が不履行となること等をいいます。当ファンドは、信用リスクを伴い、その影響を受けますので、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。

④流動性リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない、または取引が不可能となるリスクのことを流動性リスクといい、当ファンドはそのリスクを伴います。例えば、組み入れている株式の売却を十分な流動性の下で行えないときは、市場実勢から期待される価格で売却できない可能性があります。この場合、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。

※留意事項

- ・当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。
- ・当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

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

（２）投資リスクに対する管理体制

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

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

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

①コンプライアンス担当部署

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

②リスク管理担当部署

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

③内部監査担当部署

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

＊組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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



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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

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

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

4 【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

申込価額（発行価格）×2.2%（税抜 2%）を上限として販売会社が定める手数料率

申込手数料は販売会社にご確認ください。

申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

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

（２）【換金（解約）手数料】

かかりません。

ただし、解約時に信託財産留保額（当該基準価額の0.1%）が差し引かれます。

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

（３）【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年0.825%（税抜0.75%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

1万口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額×信託報酬率×（保有日数／365）

※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

- ・信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- ・信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.345%	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等
販売会社	0.345%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	0.06%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

（４）【その他の手数料等】

- ・信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、マザーファンドの解約に伴う信託財産留保額、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ・信託財産に係る監査費用（消費税等相当額を含みます。）は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。
- ・信託財産（投資している投資信託を含みます。）の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等（消費税等相当額を含みます。）、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

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

１．収益分配金の課税

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

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

２．解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

◇個別元本について

①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

③受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

◇収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、①当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回って

いる場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

※上記は2023年2月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

【三菱UFJ 外国株式インデックスファンド】

（１）【投資状況】

令和 5年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	12,835,814,142	99.99
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	1,276,650	0.01
純資産総額		12,837,090,792	100.00

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

令和 5年 2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	2,677,028,060	4.7685	12,765,650,754	4.7948	12,835,814,142	99.99

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 5年 2月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

①【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和5年2月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第10計算期間末日 (平成26年 2月24日)	3,952,455,106	3,975,043,519	17,498	17,598
第11計算期間末日 (平成27年 2月23日)	4,366,488,782	4,390,482,519	21,838	21,958
第12計算期間末日 (平成28年 2月22日)	3,723,352,779	3,723,352,779	18,228	18,228
第13計算期間末日 (平成29年 2月22日)	4,341,688,877	4,365,146,418	22,210	22,330
第14計算期間末日 (平成30年 2月22日)	6,148,298,330	6,176,190,540	24,247	24,357
第15計算期間末日 (平成31年 2月22日)	6,484,966,971	6,523,996,654	24,923	25,073
第16計算期間末日 (令和 2年 2月25日)	6,602,168,964	6,634,714,470	28,400	28,540
第17計算期間末日 (令和 3年 2月22日)	7,113,654,622	7,113,654,622	32,781	32,781
第18計算期間末日 (令和 4年 2月22日)	9,991,506,801	9,991,506,801	38,555	38,555
第19計算期間末日 (令和 5年 2月22日)	12,709,507,009	12,760,815,318	42,110	42,280
令和 4年 2月末日	10,103,879,073	—	38,928	—
3月末日	11,283,893,422	—	43,038	—
4月末日	10,761,074,848	—	41,172	—
5月末日	10,864,227,317	—	41,028	—
6月末日	10,841,069,845	—	40,040	—
7月末日	11,514,387,019	—	41,589	—
8月末日	11,802,329,737	—	41,842	—
9月末日	11,432,300,176	—	39,766	—
10月末日	12,714,439,748	—	43,541	—
11月末日	12,440,806,633	—	42,232	—
12月末日	11,791,904,632	—	39,616	—
令和 5年 1月末日	12,317,851,945	—	41,089	—
2月末日	12,837,090,792	—	42,336	—

②【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第10計算期間	100円
第11計算期間	120円
第12計算期間	0円
第13計算期間	120円
第14計算期間	110円
第15計算期間	150円
第16計算期間	140円
第17計算期間	0円
第18計算期間	0円
第19計算期間	170円

③【収益率の推移】

	収益率（％）
第10計算期間	33.65
第11計算期間	25.48
第12計算期間	△16.53
第13計算期間	22.50
第14計算期間	9.66
第15計算期間	3.40
第16計算期間	14.51
第17計算期間	15.42
第18計算期間	17.61
第19計算期間	9.66

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第10計算期間	1,977,294,504	2,092,661,644	2,258,841,302
第11計算期間	761,851,347	1,021,214,541	1,999,478,108
第12計算期間	663,910,004	620,787,130	2,042,600,982
第13計算期間	512,957,144	600,762,981	1,954,795,145
第14計算期間	1,770,910,835	1,190,050,445	2,535,655,535
第15計算期間	655,109,211	588,785,819	2,601,978,927
第16計算期間	364,908,296	642,208,156	2,324,679,067
第17計算期間	588,407,895	743,034,639	2,170,052,323
第18計算期間	847,931,479	426,489,915	2,591,493,887

第19計算期間	732,392,210	305,750,226	3,018,135,871
---------	-------------	-------------	---------------

(参考)

外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

令和 5年 2月28日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	アメリカ	1,469,518,761,227	66.14
	イギリス	97,699,188,110	4.40
	カナダ	76,238,013,091	3.43
	フランス	72,763,422,669	3.28
	スイス	63,900,214,978	2.88
	ドイツ	53,862,152,751	2.42
	オーストラリア	46,681,204,078	2.10
	オランダ	38,463,905,558	1.73
	スウェーデン	22,266,731,624	1.00
	デンマーク	18,953,936,908	0.85
	スペイン	16,888,981,160	0.76
	香港	16,385,428,171	0.74
	イタリア	11,724,096,820	0.53
	シンガポール	7,308,276,156	0.33
	フィンランド	6,238,011,577	0.28
	ベルギー	5,441,888,134	0.24
	アイルランド	4,805,569,911	0.22
	ノルウェー	4,584,177,266	0.21
	イスラエル	2,702,207,158	0.12
	ルクセンブルグ	1,482,702,919	0.07
	オーストリア	1,324,488,269	0.06
	ニュージーランド	1,219,913,007	0.05
	ポルトガル	1,112,249,570	0.05
	小計	2,041,565,521,112	91.89
投資証券	アメリカ	40,240,904,622	1.81
	オーストラリア	2,694,456,376	0.12
	イギリス	955,350,766	0.04
	フランス	929,261,219	0.04
	シンガポール	907,389,664	0.04
	香港	582,936,670	0.03
	カナダ	244,221,428	0.01

		ベルギー	210,721,851	0.01
		小計	46,765,242,596	2.10
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		—	133,399,478,212	6.01
純資産総額			2,221,730,241,920	100.00

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

その他の資産の投資状況

令和 5年 2月28日現在
（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	99,738,837,138	4.49
	買建	カナダ	5,118,558,891	0.23
	買建	ドイツ	17,542,646,330	0.79
	買建	オーストラリア	4,890,456,202	0.22
	買建	イギリス	6,524,435,725	0.29
	買建	スイス	4,200,605,589	0.19

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

令和 5年 2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5,025,400	19,858.03	99,794,590,559	20,165.93	101,341,882,713	4.56
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2,215,502	35,136.30	77,844,550,855	34,104.31	75,558,173,217	3.40
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2,866,864	14,413.14	41,320,514,547	12,782.30	36,645,118,001	1.65
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	778,463	22,411.23	17,446,317,591	32,038.91	24,941,108,564	1.12
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	832,993	32,070.94	26,714,873,574	28,306.19	23,578,864,707	1.06
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1,875,110	14,490.51	27,171,310,894	12,251.97	22,973,804,780	1.03
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1,734,634	14,278.88	24,768,633,821	12,283.33	21,307,087,055	0.96
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	1,302,862	12,261.87	15,975,526,290	15,071.28	19,635,799,958	0.88
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	292,541	67,261.52	19,676,754,703	65,891.01	19,275,823,595	0.87

アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	916,911	16,346.34	14,988,139,702	19,380.67	17,770,352,078	0.80
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	822,125	23,919.67	19,664,959,541	21,217.03	17,443,057,284	0.79
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	各種金融	406,797	41,884.89	17,038,649,978	41,534.29	16,896,027,742	0.76
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	713,286	24,189.52	17,254,051,514	23,113.38	16,486,456,216	0.74
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	511,158	27,126.02	13,865,684,736	30,040.31	15,355,347,590	0.69
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	746,140	20,481.80	15,282,294,714	18,968.95	14,153,496,979	0.64
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	859,270	17,374.46	14,929,357,942	15,826.67	13,599,387,199	0.61
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	269,766	44,788.55	12,082,429,327	48,462.58	13,073,558,622	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	320,089	39,166.97	12,536,919,032	40,355.04	12,917,205,455	0.58
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	581,439	22,280.42	12,954,709,345	22,197.25	12,906,347,192	0.58
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	792,132	12,509.60	9,909,260,474	14,909.04	11,809,934,644	0.53
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	552,744	20,696.37	11,439,799,686	21,032.99	11,625,860,351	0.52
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	126,914	74,306.14	9,430,489,722	86,115.25	10,929,231,473	0.49
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	252,567	40,905.08	10,331,274,957	43,164.80	10,902,005,203	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	2,261,221	4,790.07	10,831,426,129	4,663.84	10,545,993,978	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	1,284,384	8,655.98	11,117,612,569	8,155.26	10,474,486,230	0.47
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	431,475	23,359.31	10,078,961,806	23,981.81	10,347,551,599	0.47
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	517,205	15,000.69	7,758,436,308	19,632.07	10,153,805,799	0.46
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	126,199	75,697.14	9,552,904,042	79,814.39	10,072,497,276	0.45
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUIT	耐久消費財・アパレル	86,553	86,230.51	7,463,509,429	114,936.02	9,948,058,031	0.45
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,755,039	6,737.78	11,825,082,892	5,559.53	9,757,204,959	0.44

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 5年 2月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	エネルギー	5.30
	素材	4.16
	資本財	6.39
	商業・専門サービス	1.14
	運輸	1.81
	自動車・自動車部品	1.93
	耐久消費財・アパレル	1.63
	消費者サービス	1.89
	メディア・娯楽	4.71
	小売	4.16
	食品・生活必需品小売り	1.44
	食品・飲料・タバコ	4.02
	家庭用品・パーソナル用品	1.68
	ヘルスケア機器・サービス	4.49
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.35
	銀行	5.98
	各種金融	4.61
	保険	3.19
	不動産	0.33
	ソフトウェア・サービス	9.90
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.94
	電気通信サービス	1.38
	公益事業	2.88
	半導体・半導体製造装置	4.59
小計		91.89
投資証券	—	2.10
合計		94.00

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

投資不動産物件
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

令和 5年 2月28日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（％）
	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2303	買建	3,669	アメリカドル	748,091,382.37	101,987,298,159	731,598,600	99,738,837,138	4.49

株価指数先物取引	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602303	買建	209	カナダドル	51,755,734.75	5,195,240,654	50,991,820	5,118,558,891	0.23
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 2303	買建	2,851	ユーロ	119,421,656.93	17,269,565,808	121,310,050	17,542,646,330	0.79
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2303	買建	297	オーストラリアドル	54,665,241.75	5,023,735,716	53,214,975	4,890,456,202	0.22
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2303	買建	501	イギリスポンド	39,094,626.25	6,428,720,340	39,676,695	6,524,435,725	0.29
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX2303	買建	259	スイスフラン	28,946,329.15	4,216,901,230	28,834,470	4,200,605,589	0.19

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

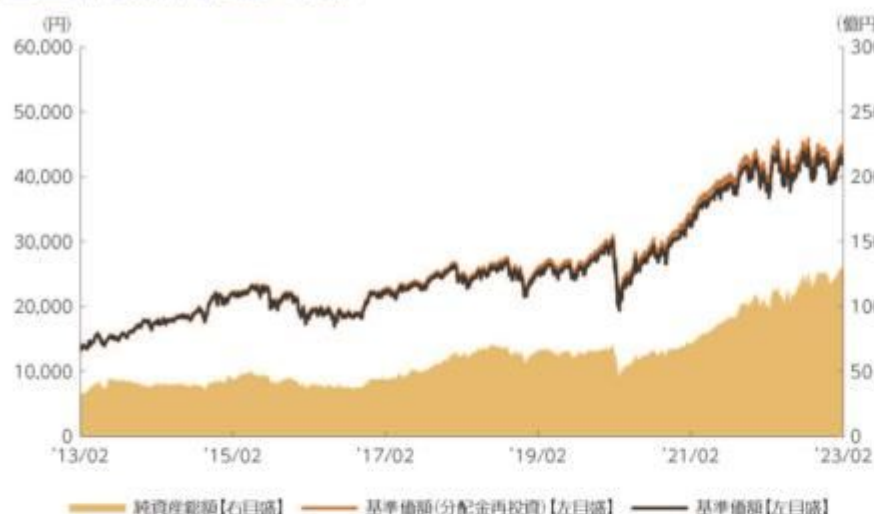
《参考情報》



運用実績

2023年2月28日現在

■基準価額・純資産の推移 2013年2月28日～2023年2月28日



- ・基準価額(分配金再投資)はグラフの起点における基準価額に合わせて指数化
- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	42,336円
純資産総額	128.3億円

・純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2023年2月	170円
2022年2月	0円
2021年2月	0円
2020年2月	140円
2019年2月	150円
2018年2月	110円
設定来累計	910円

・分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
1 アメリカドル	72.4%	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	4.6%
2 ユーロ	10.3%	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	3.4%
3 イギリスポンド	4.7%	3 AMAZON.COM INC	小売	アメリカ	1.6%
4 カナダドル	3.7%	4 NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	アメリカ	1.1%
5 スイスフラン	3.1%	5 TESLA INC	自動車・自動車部品	アメリカ	1.1%
6 オーストラリアドル	2.4%	6 ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	アメリカ	1.0%
7 スウェーデンクローネ	1.1%	7 ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	アメリカ	1.0%
8 デンマーククローネ	0.9%	8 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	アメリカ	0.9%
9 香港ドル	0.8%	9 UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	アメリカ	0.9%
10 シンガポールドル	0.4%	10 JPMORGAN CHASE & CO	銀行	アメリカ	0.8%

その他の資産の状況	比率
株価指数先物取引（買建）	6.2%

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

■年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2023年は年初から2月28日までの収益率を表示

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

1【申込（販売）手続等】

①申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

②申込単位

販売会社が定める単位

③申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

④申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑤申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑥申込手数料

申込価額（発行価格）×2.2%（税抜 2%）を上限として販売会社が定める手数料率

申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

⑦申込方法

取得申込者は、販売会社取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額および申込手数料（税込）を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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

⑧申込受付時間

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

⑨取得申込みの受付の中止および取消し

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

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

①解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。
ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

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

②解約単位

販売会社が定める単位（ただし、1万口を上回らないものとします。）

なお、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合等は1口単位

③解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差引いた価額

④信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%をかけた額

⑤解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑦支払開始日

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

⑧解約請求受付時間

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

⑨解約請求受付の中止および取消し

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

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

①基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（資産の評価方法）

・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

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

・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

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

・公社債等

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

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

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。

・外国為替予約取引

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

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

②基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

③基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限（2004年6月22日設定）

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

（４）【計算期間】

毎年２月23日から翌年２月22日まで

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

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

①ファンドの償還条件等

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

- ・受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合
- ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃されたときまたはやむを得ない事情が発生したとき

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

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

②信託約款の変更

委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。委託会社は、信託約款を変更しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。

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

③ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還または信託約款の変更のうち重大な内容の変更を行おうとする場合、あらかじめその旨およびその内容を公告し、かつ、原則としてこれらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。この公告および書面には、原則として、受益者で異議のあるものは一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。

④異議申立ておよび反対者の買取請求権

受益者は、委託会社がファンドの任意償還または信託約款について重大な内容の変更を行おうとする場合、原則として、一定の期間（１ヵ月以上）内に委託会社に対して異議を述べるすることができます。異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。なお、一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の２分の１を超えるときは、ファンドの償還または信託約款の変更を行いません。その場合、償還しない旨または信託約款を変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、原則として、これらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。

⑤関係法人との契約の更改

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

⑥運用報告書

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

⑦委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

⑧受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

⑨信託事務の再信託

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

⑩公告

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

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

①分配金受取コース（一般コース）

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

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

②分配金再投資コース（累積投資コース）

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

(2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、償還金について支払開始日から10年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

（３）換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（令和4年2月23日から令和5年2月22日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三菱UFJ 外国株式インデックスファンド】

（１）【貸借対照表】

(単位：円)

	第18期 [令和 4年 2月22日現在]	第19期 [令和 5年 2月22日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	49,079,243	61,185,644
親投資信託受益証券	9,987,857,487	12,704,993,526
未収入金	-	51,236,892
流動資産合計	10,036,936,730	12,817,416,062
資産合計	10,036,936,730	12,817,416,062
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	-	51,308,309
未払解約金	1,805,850	5,750,466
未払受託者報酬	4,400,376	4,051,293
未払委託者報酬	39,053,233	46,589,708
未払利息	18	15
その他未払費用	170,452	209,262
流動負債合計	45,429,929	107,909,053
負債合計	45,429,929	107,909,053
純資産の部		
元本等		
元本	2,591,493,887	3,018,135,871
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,400,012,914	9,691,371,138
（分配準備積立金）	2,685,622,498	3,306,647,313
元本等合計	9,991,506,801	12,709,507,009
純資産合計	9,991,506,801	12,709,507,009
負債純資産合計	10,036,936,730	12,817,416,062

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期 自 令和3年2月23日 至 令和4年2月22日	第19期 自 令和4年2月23日 至 令和5年2月22日
営業収益		
受取利息	79	192
有価証券売買等損益	1,332,873,261	1,123,486,500
営業収益合計	1,332,873,340	1,123,486,692
営業費用		
支払利息	5,630	10,744
受託者報酬	7,896,699	8,159,820
委託者報酬	70,083,021	87,988,845
その他費用	305,873	392,695
営業費用合計	78,291,223	96,552,104
営業利益又は営業損失（△）	1,254,582,117	1,026,934,588
経常利益又は経常損失（△）	1,254,582,117	1,026,934,588
当期純利益又は当期純損失（△）	1,254,582,117	1,026,934,588
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（△）	191,856,648	77,201,215
期首剰余金又は期首欠損金（△）	4,943,602,299	7,400,012,914
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,391,304,999	2,273,431,402
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,391,304,999	2,273,431,402
剰余金減少額又は欠損金増加額	997,619,853	880,498,242
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	997,619,853	880,498,242
分配金	-	51,308,309
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,400,012,914	9,691,371,138

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第18期 [令和 4年 2月22日現在]	第19期 [令和 5年 2月22日現在]
1. 期首元本額	2,170,052,323円	2,591,493,887円
期中追加設定元本額	847,931,479円	732,392,210円
期中一部解約元本額	426,489,915円	305,750,226円
2. 受益権の総数	2,591,493,887口	3,018,135,871口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第18期 自 令和 3年 2月23日 至 令和 4年 2月22日	第19期 自 令和 4年 2月23日 至 令和 5年 2月22日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>124,721,689円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>938,003,780円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>4,714,390,416円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>1,622,897,029円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>7,400,012,914円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>2,591,493,887口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>28,554円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>－円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>－円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	124,721,689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	938,003,780円	収益調整金額	C	4,714,390,416円	分配準備積立金額	D	1,622,897,029円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,400,012,914円	当ファンドの期末残存口数	F	2,591,493,887口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	28,554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	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>192,573,649円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>757,159,724円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>6,384,723,825円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>2,408,222,249円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>9,742,679,447円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>3,018,135,871口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>32,280円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>170円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>51,308,309円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	192,573,649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	757,159,724円	収益調整金額	C	6,384,723,825円	分配準備積立金額	D	2,408,222,249円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,742,679,447円	当ファンドの期末残存口数	F	3,018,135,871口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	32,280円	1万口当たり分配金額	H	170円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	51,308,309円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	124,721,689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	938,003,780円																																																											
収益調整金額	C	4,714,390,416円																																																											
分配準備積立金額	D	1,622,897,029円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,400,012,914円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,591,493,887口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	28,554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																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	192,573,649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	757,159,724円																																																											
収益調整金額	C	6,384,723,825円																																																											
分配準備積立金額	D	2,408,222,249円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,742,679,447円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	3,018,135,871口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	32,280円																																																											
1万口当たり分配金額	H	170円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	51,308,309円																																																											

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第18期 自 令和 3年 2月23日 至 令和 4年 2月22日	第19期 自 令和 4年 2月23日 至 令和 5年 2月22日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第18期 [令和 4年 2月22日現在]	第19期 [令和 5年 2月22日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左

区分	第18期 [令和 4年 2月22日現在]	第19期 [令和 5年 2月22日現在]
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。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第18期 [令和 4年 2月22日現在]	第19期 [令和 5年 2月22日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	1,254,959,786	1,094,733,260
合計	1,254,959,786	1,094,733,260

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	第18期 [令和 4年 2月22日現在]	第19期 [令和 5年 2月22日現在]
1口当たり純資産額	3.8555円	4.2110円
(1万口当たり純資産額)	(38,555円)	(42,110円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	2,664,302,631	12,704,993,526	
合計		2,664,302,631	12,704,993,526	

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[令和 5年 2月22日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	111,378,671,616
コール・ローン	483,579,799
株式	2,030,530,653,141
投資証券	47,170,236,933
派生商品評価勘定	722,640,479
未収入金	10,111,750
未収配当金	2,243,694,081
差入委託証拠金	17,822,421,498
流動資産合計	2,210,362,009,297
資産合計	2,210,362,009,297
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,185,089,202
未払金	1,331,470
未払解約金	402,545,985
未払利息	122
流動負債合計	2,588,966,779
負債合計	2,588,966,779
純資産の部	

[令和 5年 2月22日現在]

元本等	
元本	462,983,353,969
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,744,789,688,549
元本等合計	2,207,773,042,518
純資産合計	2,207,773,042,518
負債純資産合計	2,210,362,009,297

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 5年 2月22日現在]
1. 期首	令和 4年 2月23日
期首元本額	315,012,076,401円
期中追加設定元本額	235,254,932,579円
期中一部解約元本額	87,283,655,011円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）	222,875,490円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）	1,003,465,357円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）	889,460,916円
MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信	3,027,709,594円
MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信	3,814,264,981円
三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	1,737,637,297円
三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	9,948,363,822円
三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	10,552,812,735円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	53,701,315円

	[令和 5年 2月22日現在]
三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）	138,582,286円
ファンド・マネジャー（海外株式）	781,311円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,555,839,800円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,133,562,813円
eMAXIS バランス（波乗り型）	132,196,931円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	1,792,380,649円
コアバランス	176,305円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	212,837,404円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	252,121,820円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	229,839,009円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	85,418,755,233円
海外株式セレクション（ラップ向け）	2,279,564,046円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	4,741,458,303円
つみたて先進国株式	21,906,322,911円
つみたて8資産均等バランス	2,213,918,294円
つみたて4資産均等バランス	720,984,544円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,867,568円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,226,956円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	4,970,447円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	175,873,749円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	189,189,275円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	120,899,487円
三菱UFJ DC年金バランス（株式15）	57,702,945円
三菱UFJ DC年金バランス（株式40）	441,984,978円
三菱UFJ DC年金バランス（株式65）	991,906,437円
eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）	39,755,585,652円
eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）	461,936,208円
三菱UFJ DC年金インデックス（先進国株式）	3,153,330,303円
eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）	157,949,598,300円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	105,356,150円
三菱UFJ DC年金バランス（株式25）	38,940,587円
つみたて全世界株式	178,180,326円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）	40,176,771円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	3,673,203,258円
三菱UFJ DC年金バランス（株式80）	13,940,147円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	5,890,965,457円

	[令和 5年 2月22日現在]
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	41,494,087円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	28,875,119,334円
eMAXIS 全世界株式インデックス	4,486,764,657円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	547,572,671円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	1,056,350,777円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	204,319,944円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	530,620,986円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	252,822,969円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	315,244,083円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	88,166,460円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	112,825,176円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	457,567,978円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	362,203,072円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	678,163,077円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA（適格機関投資家限定）	1,608,968,826円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）VA（適格機関投資家限定）	14,673円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	6,260,615円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	4,192,342,118円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	50,093,979円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	808,554,633円
MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	10,651,752,625円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	593,696円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	637,568,721円
MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	5,282,419,039円
アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）	9,208,601円
アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）	64,872,362円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	1,578,276,243円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	490,116,096円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	375,225,753円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	54,525,672円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	2,009,884,730円
MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	87,719,038円
MUKAM 外国株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	2,353,519,649円

	[令和 5年 2月22日現在]
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）	373,741,168円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付）	41,744,254円
マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）	121,714円
外国株式インデックスファンドV（適格機関投資家限定）	2,429,614,714円
海外株式インデックスファンドS	1,883,654,237円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,664,302,631円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	818,121円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	2,344,748円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	789,393円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	2,056,102円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	29,321,358円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	1,152,495円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	9,810,074円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	1,633,651円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	15,232,327円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	6,675,196,129円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	99,562,905円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	404,947,783円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	428,084,557円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	419,625,101円
合計	462,983,353,969円
2. 受益権の総数	462,983,353,969口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 4年 2月23日 至 令和 5年 2月22日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

区分	自 令和 4年 2月23日 至 令和 5年 2月22日
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに依拠して、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 5年 2月22日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	[令和 5年 2月22日現在]
--	-----------------

種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	74,079,329,734
投資証券	△2,523,688,798
合計	71,555,640,936

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

〔令和 5年 2月22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	134,485,507,593	—	133,023,204,843	△1,462,302,750
合計		134,485,507,593	—	133,023,204,843	△1,462,302,750

（注）時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

〔令和 5年 2月22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				
	アメリカドル	2,282,518,903	—	2,282,419,010	△99,893
	カナダドル	137,984,780	—	137,979,101	△5,679
	オーストラリアドル	48,703,759	—	48,701,018	△2,741
	イギリスポンド	163,160,026	—	163,154,836	△5,190
	スイスフラン	119,450,163	—	119,443,185	△6,978
	シンガポールドル	16,408,818	—	16,407,465	△1,353
	スウェーデンクローネ	33,851,754	—	33,850,974	△780
	ノルウェークローネ	13,773,880	—	13,772,934	△946
	デンマーククローネ	33,707,403	—	33,702,863	△4,540

	ユーロ	407,646,260	—	407,628,387	△17,873
合計		3,257,205,746	—	3,257,059,773	△145,973

（注）時価の算定方法

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

①為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

②当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 5年 2月22日現在]
1口当たり純資産額	4.7686円
(1万口当たり純資産額)	(47,686円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1)株式

（単位：円）

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	101,800	38.06	3,874,508.00	
	BAKER HUGHES CO	309,448	30.13	9,323,668.24	
	CHENIERE ENERGY INC	69,912	143.88	10,058,938.56	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	29,775	78.04	2,323,641.00	
	CHEVRON CORP	581,439	161.00	93,611,679.00	
	CONOCOPHILLIPS	398,099	105.31	41,923,805.69	
	COTERRA ENERGY INC	253,523	23.00	5,831,029.00	
	DEVON ENERGY CORP	196,754	53.73	10,571,592.42	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	52,814	134.21	7,088,166.94	
	EOG RESOURCES INC	183,298	119.23	21,854,620.54	

EQT CORP	101,061	30.44	3,076,296.84
EXXON MOBIL CORP	1,302,862	111.17	144,839,168.54
HALLIBURTON CO	286,727	36.40	10,436,862.80
HESS CORP	87,447	135.87	11,881,423.89
HF SINCLAIR CORP	47,286	52.77	2,495,282.22
KINDER MORGAN INC	642,148	17.35	11,141,267.80
MARATHON OIL CORP	217,347	25.42	5,524,960.74
MARATHON PETROLEUM CORP	154,611	123.07	19,027,975.77
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	291,156	59.82	17,416,951.92
ONEOK INC	138,754	66.13	9,175,802.02
OVINTIV INC	82,940	42.81	3,550,661.40
PHILLIPS 66	149,605	99.65	14,908,138.25
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	70,869	205.94	14,594,761.86
SCHLUMBERGER LTD	442,608	53.40	23,635,267.20
TARGA RESOURCES CORP	68,999	73.29	5,056,936.71
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,863	1,799.99	3,353,381.37
VALERO ENERGY CORP	122,641	132.20	16,213,140.20
WILLIAMS COS INC	382,001	30.79	11,761,810.79
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	69,195	277.51	19,202,304.45
ALBEMARLE CORP	36,700	241.96	8,879,932.00
ALCOA CORP	53,760	48.07	2,584,243.20
AMCOR PLC	478,670	11.08	5,303,663.60
AVERY DENNISON CORP	24,955	179.00	4,466,945.00
BALL CORP	101,553	57.05	5,793,598.65
CELANESE CORP	32,123	113.15	3,634,717.45
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	62,407	83.48	5,209,736.36
CLEVELAND-CLIFFS INC	151,119	19.84	2,998,200.96
CORTEVA INC	225,641	60.06	13,551,998.46
CROWN HOLDINGS INC	37,452	84.62	3,169,188.24
DOW INC	227,708	56.84	12,942,922.72
DUPONT DE NEMOURS INC	156,712	72.96	11,433,707.52
EASTMAN CHEMICAL CO	40,284	82.47	3,322,221.48
ECOLAB INC	80,351	158.19	12,710,724.69
FMC CORP	39,430	126.14	4,973,700.20
FREEMPORT-MCMORAN INC	446,713	42.66	19,056,776.58
INTERNATIONAL PAPER CO	111,608	36.11	4,030,164.88
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	79,918	93.74	7,491,513.32
LINDE PLC	155,608	324.56	50,504,132.48
LYONDELLBASELL INDU-CL A	80,174	94.94	7,611,719.56
MARTIN MARIETTA MATERIALS	19,157	359.70	6,890,772.90
MOSAIC CO/THE	113,000	48.86	5,521,180.00
NEWMONT CORP	248,777	45.17	11,237,257.09

NUCOR CORP	82,264	163.54	13,453,454.56
PACKAGING CORP OF AMERICA	30,858	134.17	4,140,217.86
PPG INDUSTRIES INC	73,192	126.20	9,236,830.40
RPM INTERNATIONAL INC	39,891	85.57	3,413,472.87
SEALED AIR CORP	49,467	48.55	2,401,622.85
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	76,969	223.22	17,181,020.18
STEEL DYNAMICS INC	56,193	121.78	6,843,183.54
VULCAN MATERIALS CO	40,584	180.52	7,326,223.68
WESTLAKE CORP	13,051	114.62	1,495,905.62
WESTROCK CO	81,719	30.95	2,529,203.05
3M CO	173,017	109.25	18,902,107.25
AERCAP HOLDINGS NV	45,293	58.74	2,660,510.82
ALLEGION PLC	26,361	115.01	3,031,778.61
AMETEK INC	71,543	143.00	10,230,649.00
BOEING CO/THE	176,458	205.52	36,265,648.16
CARLISLE COS INC	16,689	259.73	4,334,633.97
CARRIER GLOBAL CORP	262,743	43.83	11,516,025.69
CATERPILLAR INC	165,086	240.71	39,737,851.06
CUMMINS INC	44,170	251.30	11,099,921.00
DEERE & CO	90,794	427.17	38,784,472.98
DOVER CORP	45,752	148.53	6,795,544.56
EATON CORP PLC	124,458	170.76	21,252,448.08
EMERSON ELECTRIC CO	184,505	82.05	15,138,635.25
FASTENAL CO	180,413	51.46	9,284,052.98
FERGUSON PLC	63,831	143.63	9,168,046.53
FORTIVE CORP	105,645	66.96	7,073,989.20
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	38,725	60.91	2,358,739.75
GENERAC HOLDINGS INC	18,213	115.77	2,108,519.01
GENERAL DYNAMICS CORP	72,997	233.52	17,046,259.44
GENERAL ELECTRIC CO	342,669	82.26	28,187,951.94
HEICO CORP	12,279	175.02	2,149,070.58
HEICO CORP-CLASS A	22,744	138.34	3,146,404.96
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	210,669	196.76	41,451,232.44
HOWMET AEROSPACE INC	113,499	42.09	4,777,172.91
HUBBELL INC	17,543	248.73	4,363,470.39
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	13,307	222.02	2,954,420.14
IDEX CORP	24,460	224.88	5,500,564.80
ILLINOIS TOOL WORKS	96,916	233.40	22,620,194.40
INGERSOLL-RAND INC	128,498	56.38	7,244,717.24
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	52,400	50.54	2,648,296.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	214,635	62.69	13,455,468.15
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	60,154	212.43	12,778,514.22

LENNOX INTERNATIONAL INC	9,451	254.30	2,403,389.30
LOCKHEED MARTIN CORP	74,782	479.19	35,834,786.58
MASCO CORP	67,470	52.83	3,564,440.10
NORDSON CORP	16,618	211.91	3,521,520.38
NORTHROP GRUMMAN CORP	46,136	473.95	21,866,157.20
OTIS WORLDWIDE CORP	131,196	83.06	10,897,139.76
OWENS CORNING	29,948	97.31	2,914,239.88
PACCAR INC	164,608	73.86	12,157,946.88
PARKER HANNIFIN CORP	40,291	343.54	13,841,570.14
PENTAIR PLC	53,508	54.72	2,927,957.76
PLUG POWER INC	170,755	14.43	2,463,994.65
QUANTA SERVICES INC	45,857	148.70	6,818,935.90
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	462,549	100.65	46,555,556.85
ROCKWELL AUTOMATION INC	36,379	288.72	10,503,344.88
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	47,364	51.03	2,416,984.92
SMITH (A.O.) CORP	41,076	65.67	2,697,460.92
SNAP-ON INC	16,363	246.01	4,025,461.63
STANLEY BLACK & DECKER INC	44,255	83.74	3,705,913.70
TEXTRON INC	68,142	73.36	4,998,897.12
TRANE TECHNOLOGIES PLC	72,614	179.91	13,063,984.74
TRANSDIGM GROUP INC	16,103	737.20	11,871,131.60
UNITED RENTALS INC	22,028	445.62	9,816,117.36
WABTEC CORP	53,444	103.93	5,554,434.92
WW GRAINGER INC	14,094	656.19	9,248,341.86
XYLEM INC	55,430	103.28	5,724,810.40
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	40,983	97.00	3,975,351.00
CINTAS CORP	28,545	435.71	12,437,341.95
CLARIVATE PLC	115,796	10.40	1,204,278.40
COPART INC	136,293	69.04	9,409,668.72
COSTAR GROUP INC	123,594	76.02	9,395,615.88
EQUIFAX INC	39,313	203.81	8,012,382.53
JACOBS SOLUTIONS INC	40,785	119.00	4,853,415.00
LEIDOS HOLDINGS INC	38,646	100.01	3,864,986.46
REPUBLIC SERVICES INC	69,006	130.32	8,992,861.92
ROBERT HALF INTL INC	31,924	79.98	2,553,281.52
ROLLINS INC	65,665	35.38	2,323,227.70
TRANSUNION	63,235	66.31	4,193,112.85
VERISK ANALYTICS INC	48,167	174.69	8,414,293.23
WASTE CONNECTIONS INC	81,624	135.26	11,040,462.24
WASTE MANAGEMENT INC	129,107	152.54	19,693,981.78
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	40,475	99.79	4,039,000.25
CSX CORP	669,362	30.59	20,475,783.58

DELTA AIR LINES INC	42,389	37.10	1,572,631.90
EXPEDITORS INTL WASH INC	51,822	105.20	5,451,674.40
FEDEX CORP	77,215	205.65	15,879,264.75
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	367,326	3.40	1,248,908.40
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	25,635	184.00	4,716,840.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	49,106	58.27	2,861,406.62
NORFOLK SOUTHERN CORP	73,430	224.55	16,488,706.50
OLD DOMINION FREIGHT LINE	30,505	342.70	10,454,063.50
SOUTHWEST AIRLINES CO	50,383	33.76	1,700,930.08
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	27,432	55.80	1,530,705.60
UBER TECHNOLOGIES INC	464,613	34.20	15,889,764.60
UNION PACIFIC CORP	195,299	193.75	37,839,181.25
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	228,984	178.46	40,864,484.64
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	19,700	21.88	431,036.00
APTIV PLC	83,427	116.30	9,702,560.10
BORGWARNER INC	78,768	49.33	3,885,625.44
FORD MOTOR CO	1,236,567	12.20	15,086,117.40
GENERAL MOTORS CO	433,556	41.13	17,832,158.28
LEAR CORP	17,306	141.96	2,456,759.76
LUCID GROUP INC	108,300	9.90	1,072,170.00
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	88,300	19.08	1,684,764.00
TESLA INC	832,993	197.37	164,407,828.41
DR HORTON INC	104,075	90.26	9,393,809.50
GARMIN LTD	48,921	93.96	4,596,617.16
HASBRO INC	42,578	56.39	2,400,973.42
LENNAR CORP-A	77,896	95.77	7,460,099.92
LULULEMON ATHLETICA INC	36,575	314.11	11,488,573.25
MOHAWK INDUSTRIES INC	16,546	107.09	1,771,911.14
NEWELL BRANDS INC	130,633	14.27	1,864,132.91
NIKE INC -CL B	395,325	121.10	47,873,857.50
NVR INC	962	5,018.23	4,827,537.26
PULTEGROUP INC	69,042	52.76	3,642,655.92
VF CORP	98,705	25.53	2,519,938.65
WHIRLPOOL CORP	16,596	140.89	2,338,210.44
AIRBNB INC-CLASS A	120,389	128.78	15,503,695.42
ARAMARK	72,988	37.44	2,732,670.72
BOOKING HOLDINGS INC	12,403	2,425.49	30,083,352.47
CAESARS ENTERTAINMENT INC	67,558	51.22	3,460,320.76
CARNIVAL CORP	322,950	11.13	3,594,433.50
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	8,743	1,569.26	13,720,040.18
DARDEN RESTAURANTS INC	38,486	147.84	5,689,770.24
DOMINO'S PIZZA INC	10,935	350.23	3,829,765.05

EXPEDIA GROUP INC	48,175	108.03	5,204,345.25
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	85,489	144.08	12,317,255.12
LAS VEGAS SANDS CORP	109,170	56.35	6,151,729.50
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	86,490	170.68	14,762,113.20
MCDONALD'S CORP	229,992	268.55	61,764,351.60
MGM RESORTS INTERNATIONAL	91,154	42.98	3,917,798.92
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	71,580	71.76	5,136,580.80
STARBUCKS CORP	358,530	104.78	37,566,773.40
VAIL RESORTS INC	12,637	236.51	2,988,776.87
WYNN RESORTS LTD	33,881	107.15	3,630,349.15
YUM! BRANDS INC	90,052	130.61	11,761,691.72
ACTIVISION BLIZZARD INC	244,648	77.00	18,837,896.00
ALPHABET INC-CL A	1,875,110	91.79	172,116,346.90
ALPHABET INC-CL C	1,734,634	92.05	159,673,059.70
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	35,151	377.91	13,283,914.41
COMCAST CORP-CLASS A	1,376,697	37.84	52,094,214.48
DISH NETWORK CORP-A	84,434	12.93	1,091,731.62
ELECTRONIC ARTS INC	88,747	112.02	9,941,438.94
FOX CORP - CLASS A	94,197	36.17	3,407,105.49
FOX CORP - CLASS B	50,847	33.36	1,696,255.92
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	116,863	36.58	4,274,848.54
LIBERTY BROADBAND-C	37,365	88.57	3,309,418.05
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	22,942	33.37	765,574.54
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	50,965	33.26	1,695,095.90
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	58,729	69.03	4,054,062.87
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	51,866	75.05	3,892,543.30
MATCH GROUP INC	89,286	42.44	3,789,297.84
META PLATFORMS INC-CLASS A	713,286	172.08	122,742,254.88
NETFLIX INC	139,028	337.50	46,921,950.00
NEWS CORP - CLASS A	109,126	18.26	1,992,640.76
OMNICOM GROUP	63,760	91.44	5,830,214.40
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	194,365	22.93	4,456,789.45
PINTEREST INC- CLASS A	179,393	24.45	4,386,158.85
ROBLOX CORP -CLASS A	116,296	37.56	4,368,077.76
ROKU INC	38,981	65.63	2,558,323.03
SEA LTD-ADR	109,949	62.91	6,916,891.59
SIRIUS XM HOLDINGS INC	234,669	4.45	1,044,277.05
SNAP INC - A	350,310	9.81	3,436,541.10
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	50,531	112.02	5,660,482.62
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	143,640	56.75	8,151,570.00
WALT DISNEY CO/THE	569,835	102.09	58,174,455.15
WARNER BROS DISCOVERY INC	729,902	14.75	10,766,054.50

ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	90,161	25.52	2,300,908.72
ADVANCE AUTO PARTS INC	19,129	144.19	2,758,210.51
AMAZON.COM INC	2,866,864	94.58	271,147,997.12
AUTOZONE INC	6,092	2,573.14	15,675,568.88
BATH & BODY WORKS INC	70,761	40.76	2,884,218.36
BEST BUY CO INC	63,663	83.13	5,292,305.19
BURLINGTON STORES INC	21,172	222.05	4,701,242.60
CARMAX INC	49,982	68.59	3,428,265.38
CHEWY INC - CLASS A	31,027	40.60	1,259,696.20
DOLLAR GENERAL CORP	70,487	226.61	15,973,059.07
DOLLAR TREE INC	69,978	146.42	10,246,178.76
DOORDASH INC - A	77,241	58.06	4,484,612.46
EBAY INC	171,616	47.89	8,218,690.24
ETSY INC	41,138	124.84	5,135,873.61
GENUINE PARTS CO	45,108	174.34	7,864,128.72
HOME DEPOT INC	320,089	295.50	94,586,299.50
LKQ CORP	80,873	56.33	4,555,576.09
LOWE'S COS INC	194,048	201.85	39,168,588.80
MERCADOLIBRE INC	14,183	1,099.33	15,591,797.39
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	19,783	860.13	17,015,951.79
POOL CORP	11,764	357.55	4,206,218.20
ROSS STORES INC	109,791	112.91	12,396,501.81
TARGET CORP	143,882	166.22	23,916,066.04
TJX COMPANIES INC	362,770	78.82	28,593,531.40
TRACTOR SUPPLY COMPANY	33,889	234.04	7,931,381.56
ULTA BEAUTY INC	16,178	524.94	8,492,479.32
COSTCO WHOLESALE CORP	138,483	501.74	69,482,460.42
KROGER CO	214,168	44.62	9,556,176.16
SYSCO CORP	159,336	76.81	12,238,598.16
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	229,434	36.16	8,296,333.44
WALMART INC	471,311	147.33	69,438,249.63
ALTRIA GROUP INC	563,278	47.44	26,721,908.32
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	175,317	81.40	14,270,803.80
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	96,533	64.90	6,264,991.70
BUNGE LTD	49,109	96.17	4,722,812.53
CAMPBELL SOUP CO	67,404	53.35	3,596,003.40
COCA-COLA CO/THE	1,284,384	59.80	76,806,163.20
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	66,711	54.92	3,663,768.12
CONAGRA BRANDS INC	144,308	36.36	5,247,038.88
CONSTELLATION BRANDS INC-A	49,810	223.11	11,113,109.10
DARLING INGREDIENTS INC	46,660	65.00	3,032,900.00
GENERAL MILLS INC	186,107	80.16	14,918,337.12

HERSHEY CO/THE	46,600	240.90	11,225,940.00
HORMEL FOODS CORP	91,879	45.48	4,178,656.92
JM SMUCKER CO/THE	34,139	150.00	5,120,850.00
KELLOGG CO	77,861	68.91	5,365,401.51
KEURIG DR PEPPER INC	243,679	35.55	8,662,788.45
KRAFT HEINZ CO/THE	229,905	39.87	9,166,312.35
LAMB WESTON HOLDINGS INC	46,449	100.33	4,660,228.17
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	78,366	75.53	5,918,983.98
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	62,806	53.65	3,369,541.90
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	427,786	66.60	28,490,547.60
MONSTER BEVERAGE CORP	124,055	102.38	12,700,750.90
PEPSICO INC	431,475	176.18	76,017,265.50
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	484,606	99.98	48,450,907.88
TYSON FOODS INC-CL A	90,533	60.72	5,497,163.76
CHURCH & DWIGHT CO INC	76,721	83.99	6,443,796.79
CLOROX COMPANY	37,180	154.42	5,741,335.60
COLGATE-PALMOLIVE CO	248,345	74.26	18,442,099.70
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	72,334	249.99	18,082,776.66
KIMBERLY-CLARK CORP	105,792	129.23	13,671,500.16
PROCTER & GAMBLE CO/THE	746,140	139.91	104,392,447.40
ABBOTT LABORATORIES	547,245	103.65	56,721,944.25
ALIGN TECHNOLOGY INC	23,814	304.00	7,239,456.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	47,368	160.84	7,618,669.12
BAXTER INTERNATIONAL INC	161,736	40.70	6,582,655.20
BECTON DICKINSON AND CO	88,994	239.50	21,314,063.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	445,379	46.23	20,589,871.17
CARDINAL HEALTH INC	82,871	78.17	6,478,026.07
CENTENE CORP	178,830	72.27	12,924,044.10
CIGNA CORP	95,429	293.98	28,054,217.42
COOPER COS INC/THE	15,553	337.24	5,245,093.72
CVS HEALTH CORP	410,518	87.62	35,969,587.16
DAVITA INC	16,659	83.10	1,384,362.90
DENTSPLY SIRONA INC	64,432	35.40	2,280,892.80
DEXCOM INC	122,544	114.01	13,971,241.44
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	193,380	75.55	14,609,859.00
ELEVANCE HEALTH INC	75,051	478.82	35,935,919.82
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	117,163	72.47	8,490,802.61
HCA HEALTHCARE INC	71,820	256.09	18,392,383.80
HENRY SCHEIN INC	41,137	82.00	3,373,234.00
HOLOGIC INC	78,244	81.19	6,352,630.36
HUMANA INC	39,560	503.38	19,913,712.80
IDEXX LABORATORIES INC	25,962	478.17	12,414,249.54

INSULET CORP	22,107	292.18	6,459,223.26
INTUITIVE SURGICAL INC	111,424	233.58	26,026,417.92
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	29,015	247.32	7,175,989.80
MASIMO CORP	16,542	160.89	2,661,442.38
MCKESSON CORP	45,017	361.51	16,274,095.67
MEDTRONIC PLC	415,210	85.49	35,496,302.90
MOLINA HEALTHCARE INC	17,600	292.67	5,150,992.00
NOVOCURE LTD	30,832	80.78	2,490,608.96
QUEST DIAGNOSTICS INC	37,107	143.58	5,327,823.06
RESMED INC	46,772	215.28	10,069,076.16
STERIS PLC	31,354	185.01	5,800,803.54
STRYKER CORP	106,169	261.22	27,733,466.18
TELEFLEX INC	15,114	241.33	3,647,461.62
UNITEDHEALTH GROUP INC	292,541	491.31	143,728,318.71
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	20,248	148.56	3,008,042.88
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	44,426	169.63	7,535,982.38
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	64,308	124.00	7,974,192.00
ABBVIE INC	552,744	152.00	84,017,088.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	92,347	143.42	13,244,406.74
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	36,864	199.86	7,367,639.04
AMGEN INC	167,205	238.24	39,834,919.20
AVANTOR INC	217,209	24.18	5,252,113.62
BIO-RAD LABORATORIES-A	6,947	468.16	3,252,307.52
BIO-TECHNE CORP	47,945	73.66	3,531,628.70
BIOGEN INC	45,518	271.93	12,377,709.74
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	58,061	105.97	6,152,724.17
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	667,568	71.22	47,544,192.96
CATALENT INC	48,721	68.66	3,345,183.86
CHARLES RIVER LABORATORIES	15,602	243.60	3,800,647.20
DANAHER CORP	215,967	250.79	54,162,363.93
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	148,648	11.62	1,727,289.76
ELI LILLY & CO	252,567	327.51	82,718,218.17
EXACT SCIENCES CORP	56,656	61.26	3,470,746.56
GILEAD SCIENCES INC	391,604	84.64	33,145,362.56
HORIZON THERAPEUTICS PLC	69,187	109.88	7,602,267.56
ILLUMINA INC	48,052	202.84	9,746,867.68
INCYTE CORP	59,677	78.49	4,684,047.73
IQVIA HOLDINGS INC	58,385	212.98	12,434,837.30
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	20,987	145.02	3,043,534.74
JOHNSON & JOHNSON	822,125	158.00	129,895,750.00
MERCK & CO. INC.	792,132	109.07	86,397,837.24
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	7,022	1,459.03	10,245,308.66

MODERNA INC	103,959	160.09	16,642,796.31
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	31,737	102.11	3,240,665.07
PERKINELMER INC	38,316	128.31	4,916,325.96
PFIZER INC	1,755,039	42.70	74,940,165.30
REGENERON PHARMACEUTICALS	33,513	746.52	25,018,124.76
REPLIGEN CORP	15,344	178.00	2,731,232.00
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	111,881	37.29	4,172,042.49
SEAGEN INC	42,905	156.59	6,718,493.95
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	360,337	9.92	3,574,543.04
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	122,459	550.77	67,446,743.43
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	80,132	292.48	23,437,007.36
VIATRIS INC	379,530	11.50	4,364,595.00
WATERS CORP	18,156	320.20	5,813,551.20
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	23,847	306.68	7,313,397.96
ZOETIS INC	146,326	169.84	24,852,007.84
BANK OF AMERICA CORP	2,261,221	34.52	78,057,348.92
CITIGROUP INC	605,548	49.84	30,180,512.32
CITIZENS FINANCIAL GROUP	155,051	41.95	6,504,389.45
FIFTH THIRD BANCORP	218,270	36.06	7,870,816.20
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	3,794	743.70	2,821,597.80
FIRST HORIZON CORP	173,558	24.85	4,312,916.30
FIRST REPUBLIC BANK/CA	57,059	122.81	7,007,415.79
HUNTINGTON BANCSHARES INC	461,466	15.03	6,935,833.98
JPMORGAN CHASE & CO	916,911	139.63	128,028,282.93
KEYCORP	279,576	18.51	5,174,951.76
M & T BANK CORP	53,284	155.45	8,282,997.80
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	128,187	155.48	19,930,514.76
REGIONS FINANCIAL CORP	290,215	23.19	6,730,085.85
SIGNATURE BANK	19,656	116.78	2,295,427.68
SVB FINANCIAL GROUP	18,071	285.71	5,163,065.41
TRUIST FINANCIAL CORP	414,705	47.14	19,549,193.70
US BANCORP	441,462	47.69	21,053,322.78
WEBSTER FINANCIAL CORP	57,805	53.84	3,112,221.20
WELLS FARGO & CO	1,185,751	46.24	54,829,126.24
ALLY FINANCIAL INC	92,854	29.80	2,767,049.20
AMERICAN EXPRESS CO	199,341	173.48	34,581,676.68
AMERIPRISE FINANCIAL INC	33,811	340.48	11,511,969.28
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	147,838	20.88	3,086,857.44
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	122,843	69.35	8,519,162.05
ARES MANAGEMENT CORP - A	51,159	80.52	4,119,322.68
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	242,312	50.43	12,219,794.16
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	406,797	302.72	123,145,587.84

BLACKROCK INC	47,158	695.75	32,810,178.50
BLACKSTONE INC	219,544	90.73	19,919,227.12
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	120,337	108.15	13,014,446.55
CARLYLE GROUP INC/THE	60,998	34.05	2,076,981.90
CBOE GLOBAL MARKETS INC	32,452	128.46	4,168,783.92
CME GROUP INC	112,428	187.89	21,124,096.92
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	34,300	62.07	2,129,001.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	84,035	109.13	9,170,739.55
EQUITABLE HOLDINGS INC	115,779	31.33	3,627,356.07
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	12,356	421.91	5,213,119.96
FRANKLIN RESOURCES INC	95,796	29.90	2,864,300.40
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	20,000	46.55	931,000.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	106,737	361.12	38,544,865.44
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	174,637	104.16	18,190,189.92
INVESCO LTD	93,982	17.72	1,665,361.04
KKR & CO INC	175,223	55.70	9,759,921.10
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	24,619	245.81	6,051,596.39
MARKETAXESS HOLDINGS INC	11,374	355.25	4,040,613.50
MOODY'S CORP	51,695	294.84	15,241,753.80
MORGAN STANLEY	402,576	97.62	39,299,469.12
MSCI INC	25,218	524.82	13,234,910.76
NASDAQ INC	108,285	56.78	6,148,422.30
NORTHERN TRUST CORP	62,611	94.05	5,888,564.55
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	60,787	110.31	6,705,413.97
S&P GLOBAL INC	106,507	350.79	37,361,590.53
SCHWAB (CHARLES) CORP	454,729	79.90	36,332,847.10
SEI INVESTMENTS COMPANY	39,270	59.93	2,353,451.10
STATE STREET CORP	115,101	89.17	10,263,556.17
SYNCHRONY FINANCIAL	154,684	35.00	5,413,940.00
T ROWE PRICE GROUP INC	68,866	113.23	7,797,697.18
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	31,248	72.09	2,252,668.32
AFLAC INC	188,070	68.13	12,813,209.10
ALLSTATE CORP	84,624	134.41	11,374,311.84
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	23,305	132.16	3,079,988.80
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	237,263	59.72	14,169,346.36
AON PLC-CLASS A	65,955	304.68	20,095,169.40
ARCH CAPITAL GROUP LTD	112,743	67.55	7,615,789.65
ARTHUR J GALLAGHER & CO	65,709	186.55	12,258,013.95
ASSURANT INC	18,269	131.55	2,403,286.95
BROWN & BROWN INC	74,733	56.25	4,203,731.25
CHUBB LTD	130,563	208.77	27,257,637.51
CINCINNATI FINANCIAL CORP	47,190	124.86	5,892,143.40

ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	7,461	240.11	1,791,460.71
EVEREST RE GROUP LTD	12,726	381.73	4,857,895.98
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	86,645	41.99	3,638,223.55
GLOBE LIFE INC	30,200	120.79	3,647,858.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	99,553	77.38	7,703,411.14
LINCOLN NATIONAL CORP	44,118	31.68	1,397,658.24
LOEWS CORP	65,826	60.78	4,000,904.28
MARKEL CORP	4,198	1,337.32	5,614,069.36
MARSH & MCLENNAN COS	155,896	163.93	25,556,031.28
METLIFE INC	211,249	71.05	15,009,241.45
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	76,063	87.78	6,676,810.14
PROGRESSIVE CORP	182,981	142.58	26,089,430.98
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	117,748	98.10	11,551,078.80
TRAVELERS COS INC/THE	74,170	185.25	13,739,992.50
WILLIS TOWERS WATSON PLC	35,060	237.13	8,313,777.80
WR BERKLEY CORP	64,951	66.78	4,337,427.78
CBRE GROUP INC - A	100,186	85.79	8,594,956.94
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	356,100	4.68	1,666,548.00
ZILLOW GROUP INC - C	51,785	43.55	2,255,236.75
ACCENTURE PLC-CL A	197,847	269.15	53,250,520.05
ADOBE INC	146,371	346.70	50,746,825.70
AFFIRM HOLDINGS INC	52,787	12.81	676,201.47
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	48,096	76.40	3,674,534.40
ANSYS INC	27,667	265.81	7,354,165.27
ASPEN TECHNOLOGY INC	8,440	211.92	1,788,604.80
AUTODESK INC	67,944	215.55	14,645,329.20
AUTOMATIC DATA PROCESSING	129,964	224.68	29,200,311.52
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	61,932	40.01	2,477,899.32
BILL.COM HOLDINGS INC	28,947	90.87	2,630,413.89
BLACK KNIGHT INC	45,674	63.69	2,908,977.06
BLOCK INC	166,869	71.95	12,006,224.55
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	35,232	142.78	5,030,424.96
CADENCE DESIGN SYS INC	85,654	192.65	16,501,243.10
CERIDIAN HCM HOLDING INC	39,980	73.67	2,945,326.60
CHECK POINT SOFTWARE TECH	33,201	125.37	4,162,409.37
CLOUDFLARE INC - CLASS A	77,516	61.94	4,801,341.04
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	162,316	64.66	10,495,352.56
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	65,057	112.43	7,314,358.51
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	14,727	146.18	2,152,792.86
DATADOG INC - CLASS A	78,741	78.52	6,182,743.32
DOCUSIGN INC	61,926	59.61	3,691,408.86
DROPBOX INC-CLASS A	81,861	21.29	1,742,820.69

DYNATRACE INC	58,672	42.50	2,493,560.00
EPAM SYSTEMS INC	18,298	323.17	5,913,364.66
FAIR ISAAC CORP	7,640	665.00	5,080,600.00
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	190,030	67.11	12,752,913.30
FISERV INC	189,755	113.82	21,597,914.10
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	23,091	209.68	4,841,720.88
FORTINET INC	209,581	59.71	12,514,081.51
GARTNER INC	25,127	338.23	8,498,705.21
GEN DIGITAL INC	182,160	20.74	3,777,998.40
GLOBAL PAYMENTS INC	86,971	113.12	9,838,159.52
GODADDY INC - CLASS A	50,548	76.21	3,852,263.08
HUBSPOT INC	14,849	386.00	5,731,714.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	282,461	131.71	37,202,938.31
INTUIT INC	83,794	396.26	33,204,210.44
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	21,825	166.58	3,635,608.50
MASTERCARD INC - A	269,766	355.96	96,025,905.36
MICROSOFT CORP	2,215,502	252.67	559,790,890.34
MONGODB INC	20,794	210.61	4,379,424.34
OKTA INC	47,660	72.17	3,439,622.20
ORACLE CORP	500,077	86.20	43,106,637.40
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	525,499	8.47	4,450,976.53
PALO ALTO NETWORKS INC	93,513	166.89	15,606,384.57
PAYCHEX INC	101,457	111.52	11,314,484.64
PAYCOM SOFTWARE INC	15,597	296.51	4,624,666.47
PAYLOCITY HOLDING CORP	12,042	203.96	2,456,086.32
PAYPAL HOLDINGS INC	343,509	75.24	25,845,617.16
PTC INC	36,419	129.44	4,714,075.36
ROPER TECHNOLOGIES INC	33,128	423.21	14,020,100.88
SALESFORCE INC	312,712	161.62	50,540,513.44
SERVICENOW INC	63,190	431.86	27,289,233.40
SNOWFLAKE INC-CLASS A	69,734	151.26	10,547,964.84
SPLUNK INC	48,503	101.64	4,929,844.92
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	71,344	60.10	4,287,774.40
SYNOPSYS INC	47,768	352.35	16,831,054.80
TOAST INC-CLASS A	71,887	19.53	1,403,953.11
TWILIO INC - A	50,201	66.49	3,337,864.49
TYLER TECHNOLOGIES INC	13,376	333.26	4,457,685.76
UNITY SOFTWARE INC	72,232	36.48	2,635,023.36
VERISIGN INC	30,362	203.87	6,189,900.94
VISA INC-CLASS A SHARES	511,158	220.62	112,771,677.96
VMWARE INC-CLASS A	66,052	114.49	7,562,293.48
WESTERN UNION CO	135,549	13.47	1,825,845.03

WIX.COM LTD	16,678	80.87	1,348,749.86
WORKDAY INC-CLASS A	63,683	181.92	11,585,211.36
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	69,126	72.47	5,009,561.22
ZSCALER INC	28,648	127.84	3,662,360.32
AMPHENOL CORP-CL A	186,146	77.92	14,504,496.32
APPLE INC	5,025,400	148.48	746,171,392.00
ARISTA NETWORKS INC	77,216	134.53	10,387,868.48
ARROW ELECTRONICS INC	18,289	120.20	2,198,337.80
CDW CORP/DE	41,579	205.50	8,544,484.50
CISCO SYSTEMS INC	1,294,565	49.69	64,326,934.85
COGNEX CORP	56,700	47.21	2,676,807.00
CORNING INC	254,100	34.61	8,794,401.00
DELL TECHNOLOGIES -C	82,035	41.89	3,436,446.15
F5 INC	17,424	142.98	2,491,283.52
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	396,034	15.98	6,328,623.32
HP INC	324,391	29.00	9,407,339.00
JUNIPER NETWORKS INC	105,432	31.46	3,316,890.72
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	56,675	182.98	10,370,391.50
MOTOROLA SOLUTIONS INC	52,060	268.42	13,973,945.20
NETAPP INC	65,481	65.95	4,318,471.95
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	62,439	67.08	4,188,408.12
TE CONNECTIVITY LTD	100,466	126.68	12,727,032.88
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	15,065	428.91	6,461,529.15
TRIMBLE INC	81,451	53.12	4,326,677.12
WESTERN DIGITAL CORP	92,989	40.05	3,724,209.45
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	16,368	307.00	5,024,976.00
AT&T INC	2,227,379	19.21	42,787,950.59
LIBERTY GLOBAL PLC- C	82,999	21.06	1,747,958.94
LIBERTY GLOBAL PLC-A	55,653	20.41	1,135,877.73
LUMEN TECHNOLOGIES INC	280,122	3.65	1,022,445.30
T-MOBILE US INC	195,618	147.09	28,773,451.62
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,312,795	39.20	51,461,564.00
AES CORP	215,104	25.57	5,500,209.28
ALLIANT ENERGY CORP	78,245	53.34	4,173,588.30
AMEREN CORPORATION	78,384	86.04	6,744,159.36
AMERICAN ELECTRIC POWER	160,516	90.85	14,582,878.60
AMERICAN WATER WORKS CO INC	57,068	147.66	8,426,660.88
ATMOS ENERGY CORP	44,651	116.05	5,181,748.55
CENTERPOINT ENERGY INC	197,928	28.91	5,722,098.48
CMS ENERGY CORP	92,467	61.16	5,655,281.72
CONSOLIDATED EDISON INC	112,923	92.73	10,471,349.79
CONSTELLATION ENERGY	102,382	80.37	8,228,441.34

DOMINION ENERGY INC	260,834	58.10	15,154,455.40
DTE ENERGY COMPANY	58,893	113.24	6,669,043.32
DUKE ENERGY CORP	240,759	97.68	23,517,339.12
EDISON INTERNATIONAL	117,509	66.71	7,839,025.39
ENTERGY CORP	61,506	107.60	6,618,045.60
ESSENTIAL UTILITIES INC	74,924	45.39	3,400,800.36
EVERGY INC	71,920	61.13	4,396,469.60
EVERSOURCE ENERGY	108,330	78.36	8,488,738.80
EXELON CORP	309,562	42.23	13,072,803.26
FIRSTENERGY CORP	165,348	40.49	6,694,940.52
NEXTERA ENERGY INC	614,250	73.66	45,245,655.00
NISOURCE INC	122,940	26.95	3,313,233.00
NRG ENERGY INC	77,774	34.06	2,648,982.44
P G & E CORP	474,569	15.45	7,332,091.05
PPL CORP	225,781	27.82	6,281,227.42
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	155,984	61.15	9,538,421.60
SEMPRA ENERGY	98,168	155.42	15,257,270.56
SOUTHERN CO/THE	340,384	65.55	22,312,171.20
UGI CORP	62,839	38.15	2,397,307.85
VISTRA CORP	119,689	22.57	2,701,380.73
WEC ENERGY GROUP INC	98,739	91.49	9,033,631.11
XCEL ENERGY INC	171,591	67.20	11,530,915.20
ADVANCED MICRO DEVICES	504,432	76.77	38,725,244.64
ANALOG DEVICES INC	160,268	185.97	29,805,039.96
APPLIED MATERIALS INC	268,938	111.28	29,927,420.64
BROADCOM INC	126,199	581.54	73,389,766.46
ENPHASE ENERGY INC	43,002	201.65	8,671,353.30
ENTEGRIS INC	47,458	80.72	3,830,809.76
FIRST SOLAR INC	30,588	160.99	4,924,362.12
INTEL CORP	1,283,676	26.06	33,452,596.56
KLA CORP	44,297	378.34	16,759,326.98
LAM RESEARCH CORP	42,834	478.29	20,487,073.86
MARVELL TECHNOLOGY INC	265,687	42.60	11,318,266.20
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	172,489	80.68	13,916,412.52
MICRON TECHNOLOGY INC	344,595	57.60	19,848,672.00
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	14,391	481.92	6,935,310.72
NVIDIA CORP	778,463	206.55	160,791,532.65
NXP SEMICONDUCTORS NV	81,883	181.41	14,854,395.03
ON SEMICONDUCTOR	137,273	79.28	10,883,003.44
QORVO INC	33,116	100.32	3,322,197.12
QUALCOMM INC	351,153	123.70	43,437,626.10
SKYWORKS SOLUTIONS INC	51,093	112.49	5,747,451.57

	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	17,872	294.51	5,263,482.72	
	TERADYNE INC	48,350	101.16	4,891,086.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	285,503	170.76	48,752,492.28	
	WOLFSPEED INC	36,225	72.02	2,608,924.50	
	アメリカドル 小計	106,692,421		10,812,808,324.92 (1,458,647,843,031)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	192,700	14.39	2,772,953.00	
	CAMECO CORP	142,600	36.77	5,243,402.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	350,700	74.71	26,200,797.00	
	CENOVUS ENERGY INC	422,100	24.94	10,527,174.00	
	ENBRIDGE INC	630,100	51.55	32,481,655.00	
	IMPERIAL OIL LTD	65,500	68.07	4,458,585.00	
	KEYERA CORP	76,700	30.01	2,301,767.00	
	PARKLAND CORP	57,100	29.50	1,684,450.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	177,532	44.65	7,926,803.80	
	SUNCOR ENERGY INC	430,700	45.44	19,571,008.00	
	TC ENERGY CORP	316,300	54.52	17,244,676.00	
	TOURMALINE OIL CORP	95,200	56.39	5,368,328.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	145,040	62.96	9,131,718.40	
	BARRICK GOLD CORP	554,700	22.47	12,464,109.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	42,500	60.53	2,572,525.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	175,900	26.61	4,680,699.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	58,700	176.50	10,360,550.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	193,100	12.28	2,371,268.00	
	KINROSS GOLD CORP	392,200	5.14	2,015,908.00	
	LUNDIN MINING CORP	222,100	8.63	1,916,723.00	
	NUTRIEN LTD	169,659	101.62	17,240,747.58	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	75,100	21.21	1,592,871.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	155,300	58.63	9,105,239.00	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	18,200	101.77	1,852,214.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	141,300	56.76	8,020,188.00	
	CAE INC	97,800	30.59	2,991,702.00	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	28,300	111.06	3,142,998.00	
	WSP GLOBAL INC	40,300	168.51	6,790,953.00	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	51,900	40.39	2,096,241.00	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	32,700	83.16	2,719,332.00	
	THOMSON REUTERS CORP	52,132	165.44	8,624,718.08	
	AIR CANADA	62,200	20.32	1,263,904.00	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	183,700	157.37	28,908,869.00	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	290,800	103.91	30,217,028.00	
	TFI INTERNATIONAL INC	22,900	167.30	3,831,170.00	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	88,900	75.00	6,667,500.00	

BRP INC/CA- SUB VOTING	9,100	118.46	1,077,986.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	57,100	38.76	2,213,196.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	93,010	91.69	8,528,086.90
QUEBECOR INC -CL B	39,300	32.47	1,276,071.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	146,400	39.52	5,785,728.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	15,700	169.22	2,656,754.00
DOLLARAMA INC	86,700	78.26	6,785,142.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	255,500	63.66	16,265,130.00
EMPIRE CO LTD 'A'	55,300	36.37	2,011,261.00
LOBLAW COMPANIES LTD	50,700	116.88	5,925,816.00
METRO INC/CN	74,600	71.05	5,300,330.00
WESTON (GEORGE) LTD	21,811	168.39	3,672,754.29
SAPUTO INC	76,200	36.54	2,784,348.00
BANK OF MONTREAL	209,800	132.34	27,764,932.00
BANK OF NOVA SCOTIA	374,100	71.82	26,867,862.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	284,300	61.42	17,461,706.00
NATIONAL BANK OF CANADA	104,800	100.02	10,482,096.00
ROYAL BANK OF CANADA	435,100	138.23	60,143,873.00
TORONTO-DOMINION BANK	568,500	91.99	52,296,315.00
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	113,787	46.63	5,305,887.81
BROOKFIELD CORP	439,550	46.67	20,513,798.50
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	115,800	19.41	2,247,678.00
IGM FINANCIAL INC	20,700	42.73	884,511.00
ONEX CORPORATION	24,300	64.00	1,555,200.00
TMX GROUP LTD	16,000	134.43	2,150,880.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	6,900	908.55	6,268,995.00
GREAT-WEST LIFECO INC	86,000	36.45	3,134,700.00
IA FINANCIAL CORP INC	34,100	88.51	3,018,191.00
INTACT FINANCIAL CORP	55,900	199.60	11,157,640.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	594,600	26.72	15,887,712.00
POWER CORP OF CANADA	168,700	35.82	6,042,834.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	184,100	67.68	12,459,888.00
FIRSTSERVICE CORP	13,900	187.62	2,607,918.00
CGI INC	65,300	124.65	8,139,645.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	6,300	2,355.02	14,836,626.00
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	24,900	101.20	2,519,880.00
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	17,800	43.11	767,358.00
OPEN TEXT CORP	91,800	47.17	4,330,206.00
SHOPIFY INC - CLASS A	371,900	56.06	20,848,714.00
BCE INC	22,600	61.11	1,381,086.00
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	112,600	65.97	7,428,222.00
TELUS CORP	145,100	27.39	3,974,289.00

	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	193,900	10.36	2,008,804.00	
	ALTAGAS LTD	94,600	23.66	2,238,236.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	39,350	39.19	1,542,126.50	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	38,000	36.20	1,375,600.00	
	EMERA INC	89,100	54.15	4,824,765.00	
	FORTIS INC	152,100	55.43	8,430,903.00	
	HYDRO ONE LTD	95,400	35.89	3,423,906.00	
	NORTHLAND POWER INC	79,600	33.43	2,661,028.00	
	カナダドル 小計	12,725,371		759,627,388.86 (75,727,254,395)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	82,331	31.69	2,609,069.39	
	SANTOS LTD	979,535	6.81	6,670,633.35	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	64,847	28.39	1,841,006.33	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	594,778	34.50	20,519,841.00	
	BHP GROUP LTD	1,585,506	48.30	76,579,939.80	
	BLUESCOPE STEEL LTD	157,082	18.62	2,924,866.84	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	534,912	23.30	12,463,449.60	
	IGO LTD	196,762	13.42	2,640,546.04	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	129,210	32.40	4,186,404.00	
	MINERAL RESOURCES LTD	53,520	84.97	4,547,594.40	
	NEWCREST MINING LTD	261,737	23.74	6,213,636.38	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	369,774	11.00	4,067,514.00	
	ORICA LTD	158,310	15.95	2,525,044.50	
	PILBARA MINERALS LTD	735,369	4.39	3,228,269.91	
	RIO TINTO LTD	117,797	126.13	14,857,735.61	
	SOUTH32 LTD	1,389,438	4.58	6,363,626.04	
	REECE LTD	53,600	16.87	904,232.00	
	BRAMBLES LTD	460,976	12.03	5,545,541.28	
	AURIZON HOLDINGS LTD	607,049	3.44	2,088,248.56	
	QANTAS AIRWAYS LTD	240,658	6.40	1,540,211.20	
	TRANSURBAN GROUP	963,395	14.07	13,554,967.65	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	180,742	35.64	6,441,644.88	
	IDP EDUCATION LTD	66,233	30.94	2,049,249.02	
	LOTTERY CORP LTD/THE	673,112	4.85	3,264,593.20	
	REA GROUP LTD	16,523	125.56	2,074,627.88	
	SEEK LTD	111,070	23.90	2,654,573.00	
	WESFARMERS LTD	358,795	49.77	17,857,227.15	
	COLES GROUP LTD	423,676	18.13	7,681,245.88	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	449,953	6.69	3,010,185.57	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	380,600	36.72	13,975,632.00	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	206,438	13.67	2,822,007.46	
	COCHLEAR LTD	20,154	223.86	4,511,674.44	

	RAMSAY HEALTH CARE LTD	55,070	65.92	3,630,214.40	
	SONIC HEALTHCARE LTD	142,034	32.72	4,647,352.48	
	CSL LTD	150,594	298.44	44,943,273.36	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	938,863	24.62	23,114,807.06	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	532,550	101.52	54,064,476.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	993,015	30.10	29,889,751.50	
	WESTPAC BANKING CORP	1,096,495	22.84	25,043,945.80	
	ASX LTD	59,402	68.83	4,088,639.66	
	MACQUARIE GROUP LTD	115,292	190.39	21,950,443.88	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	762,528	4.81	3,667,759.68	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	936,375	3.06	2,865,307.50	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	445,102	15.00	6,676,530.00	
	SUNCORP GROUP LTD	404,738	12.75	5,160,409.50	
	LENDLEASE GROUP	244,789	7.62	1,865,292.18	
	COMPUTERSHARE LTD	169,145	23.73	4,013,810.85	
	WISETECH GLOBAL LTD	43,885	55.79	2,448,344.15	
	XERO LTD	42,700	77.33	3,301,991.00	
	TELSTRA GROUP LTD	1,175,261	4.16	4,889,085.76	
	APA GROUP	397,094	10.76	4,272,731.44	
	ORIGIN ENERGY LTD	540,177	7.01	3,786,640.77	
	オーストラリアドル 小計	21,868,991		516,535,845.33 (47,758,904,259)	
イギリスポンド	BP PLC	5,890,625	5.50	32,416,109.37	
	SHELL PLC	2,272,097	24.85	56,472,970.93	
	ANGLO AMERICAN PLC	397,883	31.54	12,549,229.82	
	ANTOFAGASTA PLC	124,065	17.22	2,136,399.30	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	45,330	69.80	3,164,034.00	
	GLENCORE PLC	3,056,730	5.03	15,384,522.09	
	JOHNSON MATTHEY PLC	58,854	21.63	1,273,012.02	
	MONDI PLC	141,279	14.65	2,070,443.74	
	RIO TINTO PLC	352,284	62.04	21,855,699.36	
	ASHTAD GROUP PLC	135,004	54.90	7,411,719.60	
	BAE SYSTEMS PLC	1,000,726	9.06	9,074,583.36	
	BUNZL PLC	102,308	30.37	3,107,093.96	
	DCC PLC	30,399	45.96	1,397,138.04	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	1,211,674	1.43	1,742,387.21	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,661,015	1.09	2,926,584.29	
	SMITHS GROUP PLC	113,243	17.57	1,990,245.72	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	22,203	118.85	2,638,826.55	
	EXPERIAN PLC	292,420	29.26	8,556,209.20	
	INTERTEK GROUP PLC	47,531	44.39	2,109,901.09	
	RELX PLC	601,028	24.91	14,971,607.48	

RENTOKIL INITIAL PLC	814,870	5.08	4,144,428.82
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	290,184	4.53	1,316,564.80
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	32,323	41.62	1,345,283.26
BURBERRY GROUP PLC	126,278	25.92	3,273,125.76
PERSIMMON PLC	103,740	14.15	1,467,921.00
TAYLOR WIMPEY PLC	1,180,533	1.20	1,416,639.60
COMPASS GROUP PLC	552,832	19.24	10,639,251.84
ENTAIN PLC	169,917	13.77	2,339,757.09
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	57,197	55.40	3,168,713.80
PEARSON PLC	194,698	9.13	1,778,371.53
WHITBREAD PLC	65,187	30.94	2,016,885.78
AUTO TRADER GROUP PLC	265,668	5.95	1,581,787.27
INFORMA PLC	468,909	6.73	3,159,508.84
WPP PLC	321,777	10.11	3,253,165.47
JD SPORTS FASHION PLC	728,558	1.80	1,316,868.58
KINGFISHER PLC	567,509	2.72	1,543,624.48
NEXT PLC	41,419	68.12	2,821,462.28
OCADO GROUP PLC	164,438	6.27	1,031,355.13
SAINSBURY (J) PLC	620,861	2.62	1,631,001.84
TESCO PLC	2,341,521	2.49	5,849,119.45
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	119,280	19.69	2,348,623.20
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	669,161	31.55	21,112,029.55
COCA-COLA HBC AG-DI	61,536	21.08	1,297,178.88
DIAGEO PLC	712,358	35.78	25,491,731.03
IMPERIAL BRANDS PLC	279,066	20.46	5,709,690.36
HALEON PLC	1,597,387	3.35	5,364,025.54
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	224,553	57.20	12,844,431.60
UNILEVER PLC	797,242	42.38	33,791,102.17
SMITH & NEPHEW PLC	282,738	12.10	3,422,543.49
ASTRAZENECA PLC	484,630	115.70	56,071,691.00
GSK PLC	1,273,814	14.81	18,875,375.85
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	54,192	17.79	964,075.68
BARCLAYS PLC	5,102,640	1.71	8,746,945.48
HSBC HOLDINGS PLC	6,249,780	6.47	40,467,325.50
LLOYDS BANKING GROUP PLC	21,381,710	0.50	10,898,257.58
NATWEST GROUP PLC	1,665,358	2.79	4,656,340.96
STANDARD CHARTERED PLC	758,385	7.71	5,853,215.43
3I GROUP PLC	319,724	16.32	5,217,895.68
ABRDN PLC	590,816	2.09	1,236,577.88
HARGREAVES LANSDOWN PLC	123,322	8.57	1,057,362.82
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	100,521	75.72	7,611,450.12
M&G PLC	725,660	2.00	1,452,045.66

	SCHRODERS PLC	246,806	4.94	1,219,221.64	
	ST JAMES'S PLACE PLC	165,599	12.27	2,031,899.73	
	ADMIRAL GROUP PLC	63,019	22.02	1,387,678.38	
	AVIVA PLC	840,084	4.41	3,711,491.11	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,879,875	2.55	4,801,200.75	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	222,425	6.26	1,394,159.90	
	PRUDENTIAL PLC	863,225	12.56	10,846,422.12	
	SAGE GROUP PLC/THE	304,183	7.53	2,290,497.99	
	HALMA PLC	121,077	22.09	2,674,590.93	
	BT GROUP PLC	2,143,878	1.39	2,986,422.05	
	VODAFONE GROUP PLC	8,474,128	1.01	8,614,798.52	
	NATIONAL GRID PLC	1,148,865	10.71	12,304,344.15	
	SEVERN TRENT PLC	83,766	28.23	2,364,714.18	
	SSE PLC	329,177	17.66	5,814,911.70	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	204,910	10.51	2,153,604.10	
	イギリスポンド 小計	88,330,007		597,429,426.46 (97,727,505,580)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	60,430	15.84	957,211.20	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2,396	718.00	1,720,328.00	
	GIVAUDAN-REG	2,911	2,851.00	8,299,261.00	
	HOLCIM LTD	173,536	57.38	9,957,495.68	
	SIG GROUP AG	103,650	21.56	2,234,694.00	
	SIKA AG-REG	46,065	273.90	12,617,203.50	
	ABB LTD-REG	488,644	31.19	15,240,806.36	
	GEBERIT AG-REG	11,028	510.80	5,633,102.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	7,216	189.20	1,365,267.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	12,662	196.95	2,493,780.90	
	VAT GROUP AG	8,759	281.80	2,468,286.20	
	ADECCO GROUP AG-REG	43,353	34.26	1,485,273.78	
	SGS SA-REG	2,020	2,177.00	4,397,540.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	17,625	239.70	4,224,712.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	163,003	144.45	23,545,783.35	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	9,553	327.70	3,130,518.10	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	11,657	60.10	700,585.70	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	1,062	1,954.00	2,075,148.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	350	10,520.00	3,682,000.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	33	105,200.00	3,471,600.00	
	NESTLE SA-REG	859,270	109.62	94,193,177.40	
	ALCON INC	158,200	67.92	10,744,944.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	17,404	237.90	4,140,411.60	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	33,827	127.80	4,323,090.60	
	BACHEM HOLDING AG	12,632	89.75	1,133,722.00	

	LONZA GROUP AG-REG	23,486	560.20	13,156,857.20	
	NOVARTIS AG-REG	675,789	80.73	54,556,445.97	
	ROCHE HOLDING AG-BR	8,133	299.40	2,435,020.20	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	219,746	281.90	61,946,397.40	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	9,251	82.70	765,057.70	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,077,527	2.65	2,862,989.23	
	JULIUS BAER GROUP LTD	66,539	61.06	4,062,871.34	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	7,088	904.60	6,411,804.80	
	UBS GROUP AG-REG	1,044,390	20.23	21,128,009.70	
	BALOISE HOLDING AG - REG	13,536	152.50	2,064,240.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	9,590	561.00	5,379,990.00	
	SWISS RE AG	93,903	96.50	9,061,639.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	46,870	440.80	20,660,296.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	22,533	80.75	1,819,539.75	
	TEMENOS AG - REG	22,921	71.90	1,648,019.90	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	55,125	52.36	2,886,345.00	
	SWISSCOM AG-REG	8,185	574.00	4,698,190.00	
	BKW AG	6,450	135.40	873,330.00	
	スイスフラン 小計	5,658,348		440,652,987.16 (64,119,416,161)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	805,868	48.15	38,802,544.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	418,500	99.40	41,598,900.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	656,000	16.96	11,125,760.00	
	MTR CORP	448,500	40.20	18,029,700.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	352,000	16.28	5,730,560.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	691,000	51.65	35,690,150.00	
	SANDS CHINA LTD	775,600	27.65	21,445,340.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	562,000	23.00	12,926,000.00	
	WH GROUP LTD	2,846,000	4.72	13,433,120.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,166,000	26.90	31,365,400.00	
	HANG SENG BANK LTD	249,300	128.20	31,960,260.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	375,600	329.40	123,722,640.00	
	AIA GROUP LTD	3,724,200	82.50	307,246,500.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	652,868	50.25	32,806,617.00	
	ESR GROUP LTD	632,800	14.16	8,960,448.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	724,000	16.10	11,656,400.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	415,641	27.45	11,409,345.45	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	552,250	21.60	11,928,600.00	
	SINO LAND CO	913,400	10.34	9,444,556.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	441,500	111.00	49,006,500.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	145,000	66.60	9,657,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	305,600	20.80	6,356,480.00	

	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	534,000	42.70	22,801,800.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	1,165,000	10.44	12,162,600.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	160,500	43.25	6,941,625.00	
	CLP HOLDINGS LTD	481,000	57.00	27,417,000.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	982,500	5.18	5,089,350.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	3,603,348	7.51	27,061,143.48	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	421,500	43.00	18,124,500.00	
	香港ドル 小計	25,201,475		963,900,839.13 (16,579,094,433)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	30,200	28.95	874,290.00	
	KEPPEL CORP LTD	477,500	7.14	3,409,350.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	529,600	3.58	1,895,968.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	378,640	5.78	2,188,539.20	
	GENTING SINGAPORE LTD	1,914,500	1.01	1,933,645.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	670,600	3.98	2,668,988.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	565,900	34.86	19,727,274.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,080,900	13.04	14,094,936.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	368,300	30.65	11,288,395.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	236,500	8.92	2,109,580.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	802,000	3.82	3,063,640.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	118,100	7.88	930,628.00	
	UOL GROUP LTD	194,000	6.70	1,299,800.00	
	VENTURE CORP LTD	76,900	18.30	1,407,270.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,616,560	2.43	6,358,240.80	
	シンガポールドル 小計	10,060,200		73,250,544.00 (7,377,794,791)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	357,185	8.61	3,075,362.85	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	175,116	25.79	4,516,241.64	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	630,447	5.28	3,328,760.16	
	MERCURY NZ LTD	216,705	6.09	1,319,733.45	
	MERIDIAN ENERGY LTD	445,023	5.26	2,340,820.98	
	ニュージーランドドル 小計	1,824,476		14,580,919.08 (1,222,610,064)	
スウェーデンクローネ	BOLIDEN AB	89,974	444.15	39,961,952.10	
	HOLMEN AB-B SHARES	33,017	420.40	13,880,346.80	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	189,562	145.90	27,657,095.80	
	ALFA LAVAL AB	92,471	341.00	31,532,611.00	
	ASSA ABLOY AB-B	314,779	249.80	78,631,794.20	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	845,763	124.10	104,959,188.30	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	483,052	108.84	52,575,379.68	
	EPIROC AB-A	209,247	200.30	41,912,174.10	
	EPIROC AB-B	107,310	172.00	18,457,320.00	

	HUSQVARNA AB-B SHS	159,232	90.86	14,467,819.52	
	INDUTRADE AB	83,800	224.00	18,771,200.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	58,459	224.00	13,094,816.00	
	LIFCO AB-B SHS	71,700	208.40	14,942,280.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	495,296	117.45	58,172,515.20	
	SANDVIK AB	327,600	213.90	70,073,640.00	
	SKANSKA AB-B SHS	104,733	190.75	19,977,819.75	
	SKF AB-B SHARES	113,171	195.55	22,130,589.05	
	VOLVO AB-A SHS	62,474	214.20	13,381,930.80	
	VOLVO AB-B SHS	472,668	205.45	97,109,640.60	
	SECURITAS AB-B SHS	156,813	89.12	13,975,174.56	
	VOLVO CAR AB-B	142,600	50.11	7,145,686.00	
	ELECTROLUX AB-B	84,165	131.96	11,106,413.40	
	EVOLUTION AB	56,065	1,325.60	74,319,764.00	
	EMBRACER GROUP AB	170,300	55.64	9,475,492.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	218,689	127.34	27,847,857.26	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	194,331	279.10	54,237,782.10	
	GETINGE AB-B SHS	64,924	230.70	14,977,966.80	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	60,727	236.60	14,368,008.20	
	NORDEA BANK ABP	1,053,594	129.52	136,461,494.88	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	492,784	129.30	63,716,971.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	455,890	108.10	49,281,709.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	273,927	212.50	58,209,487.50	
	EQT AB	87,471	238.80	20,888,074.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	33,271	283.30	9,425,674.30	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	53,600	282.00	15,115,200.00	
	INVESTOR AB-A SHS	153,400	204.70	31,400,980.00	
	INVESTOR AB-B SHS	572,876	200.75	115,004,857.00	
	KINNEVIK AB - B	80,928	153.75	12,442,680.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	24,225	487.40	11,807,265.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	147,348	50.40	7,426,339.20	
	SAGAX AB-B	64,700	254.00	16,433,800.00	
	ERICSSON LM-B SHS	878,419	59.15	51,958,483.85	
	HEXAGON AB-B SHS	628,643	116.05	72,954,020.15	
	TELE2 AB-B SHS	156,738	94.46	14,805,471.48	
	TELIA CO AB	756,548	26.14	19,776,164.72	
	スウェーデンクローネ 小計	11,377,284		1,686,252,930.30 (21,955,013,152)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	103,871	276.80	28,751,492.80	
	EQUINOR ASA	299,488	315.05	94,353,694.40	
	NORSK HYDRO ASA	434,804	80.94	35,193,035.76	
	YARA INTERNATIONAL ASA	49,574	467.00	23,151,058.00	

	KONGSBERG GRUPPEN ASA	32,500	433.80	14,098,500.00	
	ADEVINTA ASA	106,857	80.70	8,623,359.90	
	MOWI ASA	135,763	171.20	23,242,625.60	
	ORKLA ASA	202,392	69.26	14,017,669.92	
	SALMAR ASA	25,891	418.60	10,837,972.60	
	DNB BANK ASA	287,728	199.95	57,531,213.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	50,151	183.10	9,182,648.10	
	TELENOR ASA	211,605	116.30	24,609,661.50	
	ノルウェークローネ 小計	1,940,624		343,592,932.18 (4,504,503,340)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	33,357	500.80	16,705,185.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	62,014	348.20	21,593,274.80	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	3,501	1,770.00	6,196,770.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	321,595	203.25	65,364,183.75	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1,039	15,820.00	16,436,980.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,524	15,970.00	24,338,280.00	
	DSV A/S	57,928	1,280.50	74,176,804.00	
	PANDORA A/S	26,106	649.20	16,948,015.20	
	CARLSBERG AS-B	31,440	983.20	30,911,808.00	
	COLOPLAST-B	36,267	810.80	29,405,283.60	
	DEMANT A/S	21,128	210.70	4,451,669.60	
	GENMAB A/S	20,841	2,768.00	57,687,888.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	517,205	1,000.20	517,308,441.00	
	DANSKE BANK A/S	221,483	156.85	34,739,608.55	
	TRYG A/S	114,270	160.25	18,311,767.50	
	ORSTED A/S	60,759	639.80	38,873,608.20	
	デンマーククローネ 小計	1,530,457		973,449,567.80 (18,797,311,154)	
イスラエルシェケル	ICL GROUP LTD	211,785	26.02	5,510,645.70	
	ELBIT SYSTEMS LTD	7,200	602.70	4,339,440.00	
	BANK HAPOLIM BM	386,829	30.32	11,728,655.28	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	443,979	29.30	13,008,584.70	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	403,741	17.69	7,142,178.29	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	48,267	112.40	5,425,210.80	
	AZRIELI GROUP LTD	14,806	204.00	3,020,424.00	
	NICE LTD	19,783	781.00	15,450,523.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	572,400	5.20	2,978,769.60	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	35,700	148.00	5,283,600.00	
	イスラエルシェケル 小計	2,144,490		73,888,031.37 (2,735,807,804)	
ユーロ	ENI SPA	781,185	14.26	11,145,947.58	
	GALP ENERGIA SGPS SA	151,355	11.42	1,728,474.10	

NESTE OYJ	134,607	44.46	5,984,627.22
OMV AG	44,483	46.66	2,075,576.78
REPSOL SA	426,893	14.74	6,294,537.28
TENARIS SA	134,483	16.24	2,184,676.33
TOTALENERGIES SE	777,988	58.64	45,621,216.32
AIR LIQUIDE SA	163,278	150.92	24,641,915.76
AKZO NOBEL N.V.	58,755	69.04	4,056,445.20
ARCELORMITTAL	157,243	28.43	4,471,204.70
ARKEMA	19,014	94.90	1,804,428.60
BASF SE	286,508	52.49	15,038,804.92
COVESTRO AG	56,071	41.74	2,340,403.54
CRH PLC	239,258	44.15	10,564,436.99
EVONIK INDUSTRIES AG	76,974	20.24	1,557,953.76
HEIDELBERGCEMENT AG	47,261	64.14	3,031,320.54
KONINKLIJKE DSM NV	53,334	122.50	6,533,415.00
OCI NV	34,955	30.00	1,048,650.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	72,855	35.85	2,611,851.75
SOLVAY SA	24,153	111.55	2,694,267.15
STORA ENSO OYJ-R SHS	184,408	13.45	2,481,209.64
SYMRISE AG	42,629	96.46	4,111,993.34
UMICORE	62,556	32.25	2,017,431.00
UPM-KYMMENE OYJ	160,063	34.21	5,475,755.23
VOESTALPINE AG	39,061	35.14	1,372,603.54
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	64,621	27.01	1,745,413.21
AIRBUS SE	185,095	122.82	22,733,367.90
ALSTOM	96,250	27.01	2,599,712.50
BOUYGUES SA	69,916	31.23	2,183,476.68
BRENTAG SE	49,586	73.00	3,619,778.00
CNH INDUSTRIAL NV	324,390	15.29	4,961,545.05
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	153,561	53.10	8,154,089.10
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	136,111	30.89	4,204,468.79
DASSAULT AVIATION SA	6,763	167.50	1,132,802.50
EIFFAGE	24,432	103.55	2,529,933.60
FERROVIAL SA	157,922	25.97	4,101,234.34
GEA GROUP AG	42,462	40.59	1,723,532.58
IMCD NV	18,078	149.15	2,696,333.70
KINGSPAN GROUP PLC	46,132	62.82	2,898,012.24
KNORR-BREMSE AG	25,881	63.22	1,636,196.82
KONE OYJ-B	105,985	48.24	5,112,716.40
LEGRAND SA	80,593	87.88	7,082,512.84
MTU AERO ENGINES AG	16,223	230.40	3,737,779.20
PRYSMIAN SPA	81,681	36.54	2,984,623.74

RATIONAL AG	1,276	612.50	781,550.00
RHEINMETALL AG	12,710	257.20	3,269,012.00
SAFRAN SA	106,909	134.36	14,364,293.24
SCHNEIDER ELECTRIC SE	169,526	153.04	25,944,259.04
SIEMENS AG-REG	239,011	143.74	34,355,441.14
SIEMENS ENERGY AG	137,504	18.41	2,532,136.16
THALES SA	33,295	132.00	4,394,940.00
VINCI SA	167,477	108.90	18,238,245.30
WARTSILA OYJ ABP	161,062	9.15	1,475,005.79
BUREAU VERITAS SA	94,880	26.08	2,474,470.40
RANDSTAD NV	34,242	57.68	1,975,078.56
TELEPERFORMANCE	18,129	259.40	4,702,662.60
WOLTERS KLUWER	82,203	104.40	8,581,993.20
ADP	10,260	133.50	1,369,710.00
AENA SME SA	24,220	140.30	3,398,066.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	179,416	9.66	1,734,773.30
DEUTSCHE POST AG-REG	310,641	40.22	12,495,534.22
GETLINK SE	132,190	16.33	2,159,323.65
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	105,547	98.70	10,417,488.90
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	18,227	90.60	1,651,366.20
CONTINENTAL AG	34,400	68.78	2,366,032.00
DR ING HC F PORSCHE AG	34,570	113.30	3,916,781.00
FERRARI NV	39,489	246.10	9,718,242.90
MERCEDES-BENZ GROUP AG	251,461	74.59	18,756,475.99
MICHELIN (CGDE)	215,236	30.04	6,465,689.44
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	45,820	54.86	2,513,685.20
RENAULT SA	57,337	40.83	2,341,069.71
STELLANTIS NV	704,483	15.86	11,178,736.24
VALEO	72,083	20.87	1,504,372.21
VOLKSWAGEN AG	8,950	165.45	1,480,777.50
VOLKSWAGEN AG-PREF	59,893	131.08	7,850,774.44
ADIDAS AG	55,623	137.42	7,643,712.66
HERMES INTERNATIONAL	9,913	1,704.00	16,891,752.00
KERING	23,404	585.30	13,698,361.20
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	86,553	808.90	70,012,721.70
MONCLER SPA	63,271	58.66	3,711,476.86
PUMA SE	32,556	59.74	1,944,895.44
SEB SA	9,694	101.30	982,002.20
ACCOR SA	57,043	30.26	1,726,121.18
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	52,758	156.85	8,275,092.30
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	27,020	37.66	1,017,573.20
SODEXO SA	26,938	86.98	2,343,067.24

BOLLORE SE	271,925	5.10	1,386,817.50
PUBLICIS GROUPE	70,257	75.48	5,302,998.36
SCOUT24 SE	27,257	52.10	1,420,089.70
UBISOFT ENTERTAINMENT	20,939	20.37	426,527.43
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	228,537	22.27	5,089,518.99
VIVENDI SE	236,529	9.83	2,325,080.07
D'IETEREN GROUP	8,226	181.70	1,494,664.20
DELIVERY HERO SE	54,469	39.19	2,134,640.11
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	338,760	28.44	9,634,334.40
JUST EAT TAKEAWAY	57,881	20.97	1,213,764.57
PROSUS NV	258,955	69.37	17,963,708.35
ZALANDO SE	72,249	39.11	2,825,658.39
CARREFOUR SA	175,137	18.16	3,181,363.60
HELLOFRESH SE	45,738	21.74	994,344.12
JERONIMO MARTINS	95,613	19.53	1,867,321.89
KESKO OYJ-B SHS	93,457	20.20	1,887,831.40
KONINKLIJKE Ahold DELHAIZE N	321,391	30.06	9,661,013.46
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	269,584	55.56	14,978,087.04
DANONE	203,761	52.31	10,658,737.91
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	156,074	10.44	1,630,192.93
HEINEKEN HOLDING NV	30,217	81.05	2,449,087.85
HEINEKEN NV	80,548	96.92	7,806,712.16
JDE PEET'S NV	24,300	28.00	680,400.00
KERRY GROUP PLC-A	47,682	92.80	4,424,889.60
PERNOD RICARD SA	64,425	199.30	12,839,902.50
REMY COINTREAU	6,746	170.00	1,146,820.00
BEIERSDORF AG	29,811	113.75	3,391,001.25
HENKEL AG & CO KGAA	28,270	64.85	1,833,309.50
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	57,517	68.12	3,918,058.04
L'OREAL	75,549	385.85	29,150,581.65
AMPLIFON SPA	42,891	27.05	1,160,201.55
BIOMERIEUX	13,869	96.76	1,341,964.44
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	11,510	131.15	1,509,536.50
DIASORIN SPA	9,103	115.25	1,049,120.75
ESSILORLUXOTTICA	90,599	175.75	15,922,774.25
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	67,833	37.16	2,520,674.28
FRESENIUS SE & CO KGAA	129,848	28.85	3,746,114.80
KONINKLIJKE PHILIPS NV	285,870	15.88	4,541,330.82
SIEMENS HEALTHINEERS AG	83,492	50.28	4,197,977.76
ARGENX SE	16,640	347.10	5,775,744.00
BAYER AG-REG	307,118	59.25	18,196,741.50
EUROFINS SCIENTIFIC	39,698	68.78	2,730,428.44

GRIFOLS SA	82,564	14.35	1,185,206.22
IPSEN	13,860	109.50	1,517,670.00
MERCK KGAA	40,311	183.35	7,391,021.85
ORION OYJ-CLASS B	34,824	46.18	1,608,172.32
QIAGEN N.V.	73,322	44.34	3,251,097.48
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	32,103	40.59	1,303,060.77
SANOFI	356,795	89.45	31,915,312.75
SARTORIUS AG-VORZUG	7,294	420.00	3,063,480.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	8,551	331.90	2,838,076.90
UCB SA	38,461	79.10	3,042,265.10
ABN AMRO BANK NV-CVA	133,234	16.64	2,217,679.93
AIB GROUP PLC	297,214	3.99	1,185,883.86
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,896,626	6.96	13,215,689.96
BANCO SANTANDER SA	5,238,634	3.52	18,455,707.58
BANK OF IRELAND GROUP PLC	351,816	10.07	3,544,546.20
BNP PARIBAS	347,142	65.40	22,703,086.80
CAIXABANK SA	1,332,848	4.01	5,354,050.41
COMMERZBANK AG	350,612	11.23	3,937,372.76
CREDIT AGRICOLE SA	373,329	11.62	4,338,082.98
ERSTE GROUP BANK AG	110,379	35.85	3,957,087.15
FINECOBANK SPA	186,022	16.57	3,083,314.65
ING GROEP NV	1,170,060	13.14	15,383,948.88
INTESA SANPAOLO	5,260,087	2.55	13,429,002.11
KBC GROUP NV	79,725	70.90	5,652,502.50
MEDIOBANCA SPA	181,481	10.11	1,835,680.31
SOCIETE GENERALE SA	258,996	27.28	7,065,410.88
UNICREDIT SPA	601,152	18.60	11,181,427.20
AMUNDI SA	21,837	62.15	1,357,169.55
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	646,303	11.59	7,494,529.58
DEUTSCHE BOERSE AG	60,276	169.30	10,204,726.80
EURAZEO SE	11,669	63.90	745,649.10
EURONEXT NV	28,504	76.84	2,190,247.36
EXOR NV	35,414	75.64	2,678,714.96
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	32,086	79.22	2,541,852.92
SOFINA	5,291	228.60	1,209,522.60
WENDEL	9,312	100.40	934,924.80
AEGON NV	589,592	5.00	2,947,960.00
AGEAS	51,936	42.29	2,196,373.44
ALLIANZ SE-REG	127,593	217.40	27,738,718.20
ASSICURAZIONI GENERALI	355,557	18.34	6,522,693.16
AXA SA	584,480	28.11	16,429,732.80
HANNOVER RUECK SE	17,884	181.70	3,249,522.80

MUENCHENER RUECKVER AG-REG	43,785	326.20	14,282,667.00
NN GROUP NV	91,002	38.97	3,546,347.94
POSTE ITALIANE SPA	144,825	10.08	1,459,836.00
SAMPO OYJ-A SHS	153,542	45.96	7,056,790.32
AROUNDTOWN SA	379,138	2.41	917,134.82
LEG IMMOBILIEN SE	21,715	69.68	1,513,101.20
VONOVIA SE	216,231	24.95	5,394,963.45
ADYEN NV	6,905	1,440.80	9,948,724.00
AMADEUS IT GROUP SA	138,455	55.00	7,615,025.00
BECHTLE AG	26,787	40.36	1,081,123.32
CAPGEMINI SE	51,162	182.00	9,311,484.00
DASSAULT SYSTEMES SE	205,125	37.17	7,625,521.87
EDENRED	81,610	52.96	4,322,065.60
NEMETSCHEK SE	20,683	51.28	1,060,624.24
NEXI SPA	160,933	7.56	1,216,653.48
SAP SE	326,568	107.76	35,190,967.68
WORLDLINE SA	76,356	39.57	3,021,406.92
NOKIA OYJ	1,704,229	4.41	7,519,058.34
CELLNEX TELECOM SA	175,248	37.74	6,613,859.52
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,009,756	20.91	21,113,997.96
ELISA OYJ	43,016	53.60	2,305,657.60
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	114,083	10.35	1,180,759.05
KONINKLIJKE KPN NV	1,065,750	3.26	3,480,739.50
ORANGE	626,892	10.78	6,762,910.89
TELECOM ITALIA SPA	3,630,827	0.30	1,094,331.25
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	297,838	2.91	868,197.77
TELEFONICA SA	1,669,173	3.76	6,286,105.51
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	30,096	20.64	621,181.44
ACCIONA SA	8,326	185.30	1,542,807.80
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	19,200	37.40	718,080.00
E.ON SE	715,946	10.24	7,331,287.04
EDP RENOVAVEIS SA	96,779	20.14	1,949,129.06
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	850,867	4.82	4,107,985.87
ELIA GROUP SA/NV	10,658	128.90	1,373,816.20
ENAGAS SA	82,825	16.98	1,406,782.62
ENDESA SA	108,855	18.83	2,049,739.65
ENEL SPA	2,542,116	5.31	13,511,346.54
ENGIE	560,325	14.25	7,984,631.25
FORTUM OYJ	136,337	14.38	1,961,207.74
IBERDROLA SA	1,914,742	10.96	20,985,572.32
NATURGY ENERGY GROUP SA	45,200	26.07	1,178,364.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	131,018	16.27	2,131,662.86

RWE AG	203,358	40.39	8,213,629.62	
SNAM SPA	600,034	4.78	2,873,562.82	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE	409,767	7.37	3,019,982.79	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	203,582	28.50	5,802,087.00	
VERBUND AG	22,697	82.45	1,871,367.65	
ASM INTERNATIONAL NV	14,362	315.95	4,537,673.90	
ASML HOLDING NV	126,914	596.90	75,754,966.60	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	406,670	34.52	14,038,248.40	
STMICROELECTRONICS NV	218,245	45.01	9,824,298.67	
ユーロ 小計	57,848,276		1,484,469,145.52 (213,377,594,977)	
合 計	347,202,420		2,030,530,653,141 (2,030,530,653,141)	

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
アメリカ ドル	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	49,695	7,825,471.65	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	96,734	3,176,744.56	
		AMERICAN TOWER CORP	145,565	29,789,877.25	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	44,541	7,832,980.26	
		BOSTON PROPERTIES INC	47,057	3,220,581.08	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	32,617	3,850,436.85	
		CROWN CASTLE INC	135,416	18,505,950.56	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	88,070	9,547,668.70	
		EQUINIX INC	28,449	20,003,060.88	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	57,122	4,071,084.94	
		EQUITY RESIDENTIAL	115,240	7,420,303.60	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	20,085	4,648,271.55	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	42,486	6,734,880.72	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	77,391	4,064,575.32	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	114,571	2,364,745.44	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	171,442	4,388,915.20	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	217,220	3,690,567.80	
		INVITATION HOMES INC	186,993	6,030,524.25	
		IRON MOUNTAIN INC	93,347	4,729,892.49	
		KIMCO REALTY CORP	187,223	3,828,710.35	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	177,787	2,229,448.98	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	36,527	6,024,398.11	

		PROLOGIS INC	288,523	35,626,820.04	
		PUBLIC STORAGE	49,436	14,776,420.40	
		REALTY INCOME CORP	193,841	12,642,310.02	
		REGENCY CENTERS CORP	47,157	2,966,646.87	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	33,098	9,028,803.42	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	102,842	12,404,802.04	
		SUN COMMUNITIES INC	39,952	6,220,526.40	
		UDR INC	100,713	4,416,265.05	
		VENTAS INC	126,173	6,306,126.54	
		VICI PROPERTIES INC	294,244	9,916,022.80	
		WELLTOWER INC	141,740	10,888,466.80	
		WEYERHAEUSER CO	228,909	7,043,529.93	
		WP CAREY INC	60,540	4,999,998.60	
アメリカドル合計			3,872,746	301,215,829.45 (40,634,015,392)	
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	23,300	1,148,224.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	58,600	1,283,926.00	
カナダドル合計			81,900	2,432,150.00 (242,461,033)	
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS/AU	314,109	2,713,901.76	
		GOODMAN GROUP	547,446	10,735,416.06	
		GPT GROUP	656,296	3,038,650.48	
		MIRVAC GROUP	1,162,900	2,570,009.00	
		SCENTRE GROUP	1,734,337	5,012,233.93	
		STOCKLAND	680,065	2,557,044.40	
		VICINITY CENTRES	1,315,193	2,696,145.65	
オーストラリアドル合計			6,410,346	29,323,401.28 (2,711,241,682)	
イギリスポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	317,051	1,392,805.04	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	198,733	1,365,295.71	
		SEGRO PLC	367,806	3,041,020.00	
イギリスポンド合計			883,590	5,799,120.75 (948,620,172)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	659,600	34,793,900.00	
香港ドル合計			659,600	34,793,900.00 (598,455,080)	
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,134,200	3,175,760.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,553,771	3,029,853.45	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,029,700	1,740,193.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	650,700	1,112,697.00	
シンガポールドル合計			4,368,371	9,058,503.45 (912,372,467)	

ユーロ	投資証券	COVIVIO	13,302	824,724.00	
		GECINA SA	16,340	1,756,550.00	
		KLEPIERRE	71,486	1,658,475.20	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	35,721	2,086,820.82	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	50,808	1,486,642.08	
ユーロ合計			187,657	7,813,212.10 (1,123,071,107)	
合計				47,170,236,933 (47,170,236,933)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 602銘柄	97.29%	—	70.20%
	投資証券 35銘柄	—	2.71%	1.96%
カナダドル	株式 86銘柄	99.68%	—	3.64%
	投資証券 2銘柄	—	0.32%	0.01%
オーストラリアドル	株式 52銘柄	94.63%	—	2.30%
	投資証券 7銘柄	—	5.37%	0.13%
イギリスポンド	株式 77銘柄	99.04%	—	4.70%
	投資証券 3銘柄	—	0.96%	0.05%
スイスフラン	株式 43銘柄	100.00%	—	3.09%
香港ドル	株式 29銘柄	96.52%	—	0.80%
	投資証券 1銘柄	—	3.48%	0.03%
シンガポールドル	株式 15銘柄	88.99%	—	0.36%
	投資証券 4銘柄	—	11.01%	0.04%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.00%	—	0.06%
スウェーデンクローネ	株式 45銘柄	100.00%	—	1.06%
ノルウェークローネ	株式 12銘柄	100.00%	—	0.22%
デンマーククローネ	株式 16銘柄	100.00%	—	0.90%
イスラエルシェケル	株式 10銘柄	100.00%	—	0.13%
ユーロ	株式 221銘柄	99.48%	—	10.27%
	投資証券 5銘柄	—	0.52%	0.05%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

２【ファンドの現況】

【三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンド】

【純資産額計算書】

令和 5年 2月28日現在

(単位：円)

I 資産総額	12,845,782,149
II 負債総額	8,691,357
III 純資産総額（I－II）	12,837,090,792
IV 発行済口数	3,032,185,267口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	4.2336
（10,000口当たり）	（42,336）

(参考)

外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 5年 2月28日現在

(単位：円)

I 資産総額	2,230,237,064,217
II 負債総額	8,506,822,297
III 純資産総額（I－II）	2,221,730,241,920
IV 発行済口数	463,362,942,243口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	4.7948
（10,000口当たり）	（47,948）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、委託会社は、この信託の受益権を取扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

（２）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

該当事項はありません。

（４）受益権の譲渡

- ①受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとし、ます。
- ②上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- ③上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（５）受益権の譲渡の対抗要件

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、解約請求の受付け、解約代金および償還金の支払い等については、信託約款の規定のほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額等

2023年2月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近５年間に於ける資本金の額の増減はありません。

（２）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

・投資運用の意思決定機構

①投資環境見通しの策定

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

②運用戦略の決定

運用戦略・管理委員会において、①で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

③運用計画の決定

②で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

④ポートフォリオの構築

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

⑤運用部門による自律的な運用管理

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、運用部門内の管理担当部署は逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また、運用戦略・管理委員会を通じて運用状況のモニタリングを行い、運用部門内での自律的牽制により運用改善を図ります。

⑥管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署は、（a）運用に関するパフォーマンス測定・分析、意図した運用成果が得られていない場合にはその原因の分析のほか、（b）リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、（a）についてはファンド管理委員会における審議を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバックされ、（b）についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

⑦ファンドに係る法人等の管理

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

⑧運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年 2月28日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本 数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	875	22,978,971
追加型公社債投資信託	16	1,462,576
単位型株式投資信託	91	408,675
単位型公社債投資信託	50	117,863
合 計	1,032	24,968,085

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

3【委託会社等の経理状況】

（1）財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和52年大蔵省令第38号）」（以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

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

（2）監査証明について

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

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第38期事業年度に係る中間会計期間（自 令和4年4月1日 至 令和4年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第36期 (令和3年3月31日現在)		第37期 (令和4年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	※2	56,803,388	※2	51,593,362
有価証券		2,001		293,326
前払費用		598,135		645,109
未収入金		31,359		61,092
未収委託者報酬		13,216,357		15,750,264
未収収益	※2	662,230	※2	783,790
金銭の信託		2,300,000		8,401,300
その他		269,506		295,584
流動資産合計		73,882,978		77,823,830
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	548,902	※1	391,042
器具備品	※1	1,435,369	※1	1,079,023
土地		628,433		628,433
有形固定資産合計		2,612,705		2,098,499
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		3,569,171		4,381,293
ソフトウェア仮勘定		1,895,190		1,581,652
無形固定資産合計		5,480,184		5,978,768
投資その他の資産				
投資有価証券		18,616,670		16,803,642
関係会社株式		320,136		159,536
投資不動産	※1	814,684	※1	810,684
長期差入保証金		538,497		524,244
前払年金費用		258,835		189,708
繰延税金資産		916,962		982,406
その他		45,230		45,230
貸倒引当金		△23,600		△23,600
投資その他の資産合計		21,487,417		19,491,852
固定資産合計		29,580,307		27,569,120
資産合計		103,463,286		105,392,950

(単位：千円)

	第36期 (令和3年3月31日現在)	第37期 (令和4年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		

預り金	533,622	565,222
未払金		
未払収益分配金	158,856	197,334
未払償還金	133,877	7,418
未払手数料	※2 5,200,810	※2 6,423,139
その他未払金	※2 4,412,521	※2 4,565,457
未払費用	※2 4,755,909	※2 4,328,968
未払消費税等	752,617	1,112,923
未払法人税等	873,027	769,692
賞与引当金	933,381	942,287
役員賞与引当金	160,710	149,028
その他	691,143	5,517
流動負債合計	18,606,476	19,066,990
固定負債		
長期未払金	21,600	10,800
退職給付引当金	1,145,514	1,246,300
役員退職慰労引当金	117,938	117,938
時効後支払損引当金	245,426	250,214
固定負債合計	1,530,479	1,625,252
負債合計	20,136,956	20,692,243
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金	3,572,096	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712	44,732,712
利益剰余金		
利益準備金	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金	26,951,289	29,000,498
利益剰余金合計	34,291,879	36,341,088
株主資本合計	81,024,723	83,073,932

(単位：千円)

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

（２）【損益計算書】

(単位：千円)				
	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)		第37期 (自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		67,963,712		79,977,953
投資顧問料		2,443,980		2,711,169
その他営業収益		21,613		13,459
営業収益合計		70,429,306		82,702,582
営業費用				
支払手数料	※2	26,689,896	※2	31,644,834
広告宣伝費		668,150		720,785
公告費		250		500
調査費				
調査費		2,077,942		2,430,158
委託調査費		12,035,954		14,557,009
事務委託費		798,528		1,450,062
営業雑経費				
通信費		296,490		138,868
印刷費		378,180		379,428
協会費		51,841		49,590
諸会費		16,613		17,729
事務機器関連費		1,977,769		2,172,978
その他営業雑経費		8,391		649
営業費用合計		45,000,009		53,562,596
一般管理費				
給料				
役員報酬		352,879		414,260
給料・手当		6,461,546		6,496,233
賞与引当金繰入		933,381		942,287
役員賞与引当金繰入		160,710		149,028
福利厚生費		1,272,568		1,282,310
交際費		2,721		4,874
旅費交通費		22,768		21,698
租税公課		402,939		430,233
不動産賃借料		666,331		724,961
退職給付費用		481,135		494,615
役員退職慰労引当金繰入		11,763		-
固定資産減価償却費		1,358,911		2,249,287
諸経費		413,538		379,054
一般管理費合計		12,541,193		13,588,846
営業利益		12,888,103		15,551,139

(単位：千円)

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

営業外収益			
受取配当金		170,807	243,133
受取利息	※2	2,726	※2 7,408
投資有価証券償還益		81,557	1,089,101
収益分配金等時効完成分		275,835	137,485
受取賃貸料	※2	65,808	※2 65,808
その他		12,504	36,211
営業外収益合計		609,239	1,579,148
営業外費用			
投資有価証券償還損		95,946	3,074
時効後支払損引当金繰入		16,395	16,548
事務過誤費		-	76,076
賃貸関連費用		13,472	15,780
その他		2,932	7,585
営業外費用合計		128,747	119,066
経常利益		13,368,595	17,011,221
特別利益			
投資有価証券売却益		2,007,655	605,706
特別利益合計		2,007,655	605,706
特別損失			
投資有価証券売却損		51,737	28,188
投資有価証券評価損		26,317	36,558
固定資産除却損	※1	536	※1 13,094
特別損失合計		78,591	77,840
税引前当期純利益		15,297,659	17,539,087
法人税、住民税及び事業税	※2	4,755,427	※2 5,366,608
法人税等調整額		△19,122	22,446
法人税等合計		4,736,304	5,389,054
当期純利益		10,561,354	12,150,032

（３）【株主資本等変動計算書】

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

（単位：千円）

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

	評価・換算差額等	
--	----------	--

	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
当期首残高	1,815	1,815	79,922,854
当期変動額			
剰余金の配当			△9,457,670
当期純利益			10,561,354
株主資本以外の 項目の当期変動額 （純額）	2,299,791	2,299,791	2,299,791
当期変動額合計	2,299,791	2,299,791	3,403,475
当期末残高	2,301,606	2,301,606	83,326,329

第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日）

（単位：千円）

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

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

[注記事項]

（重要な会計方針）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	5年～50年
器具備品	2年～20年
投資不動産	3年～47年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

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

① 退職給付見込額の期間帰属方法

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

② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5) 役員退職慰労引当金

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

(6) 時効後支払損引当金

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

6. 収益及び費用の計上基準

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

(1) 委託者報酬

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

(2) 投資顧問料

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

7. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(1) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

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

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

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

（会計方針の変更）

(1) 収益認識に関する会計基準等の適用

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

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

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

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

1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

(2) 時価の算定に関する会計基準等の適用

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

（未適用の会計基準等）

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

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

令和5年3月期の期首より適用します。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

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

(貸借対照表関係)

※1.有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	第36期 (令和3年3月31日現在)	第37期 (令和4年3月31日現在)
建物	643,920千円	805,250千円
器具備品	1,545,179千円	2,054,366千円
投資不動産	151,833千円	157,995千円

※2.関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

(損益計算書関係)

※1.固定資産除却損の内訳

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

※2.関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

(株主資本等変動計算書関係)

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項

(1)配当金支払額

令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

④ 効力発生日

令和2年6月29日

- (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
令和3年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

①	配当金の総額	10,576,511千円
②	配当の原資	利益剰余金
③	1株当たり配当額	49,988円
④	基準日	令和3年3月31日
⑤	効力発生日	令和3年6月29日

第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項

(1)配当金支払額

令和3年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

①	配当金の総額	10,576,511千円
②	1株当たり配当額	49,988円
③	基準日	令和3年3月31日
④	効力発生日	令和3年6月29日

- (2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
令和4年6月28日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり
提案しております。

①	配当金の総額	6,075,125千円
②	配当の原資	利益剰余金
③	1株当たり配当額	28,713円
④	基準日	令和4年3月31日
⑤	効力発生日	令和4年6月29日

(リース取引関係)

〈借主側〉

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

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

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

2.金融商品の時価等に関する事項

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

第36期(令和3年3月31日現在)

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

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

(注4) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第36期(令和3年3月31日現在)

(単位：千円)

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

第37期(令和4年3月31日現在)

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

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

(注2) 市場価格のない株式等

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

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

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

(注4) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第37期(令和4年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超

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

3.金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

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

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

（有価証券関係）

1.子会社株式及び関連会社株式

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

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

2.その他有価証券

第36期(令和3年3月31日現在)

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

	小計	6,076,354	6,207,447	△131,093
合計		20,887,311	17,569,919	3,317,392

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

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

第37期(令和4年3月31日現在)

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

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

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

3.売却したその他有価証券

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

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

第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日）

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

4.減損処理を行った有価証券

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

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

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

（退職給付関係）

1.採用している退職給付制度の概要

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

2.確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)	第37期 (自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,718,736 千円	3,729,235 千円
勤務費用	203,106	198,457
利息費用	19,110	21,549
数理計算上の差異の 発生額	△18,826	△46,069
退職給付の支払額	△192,890	△179,650
過去勤務費用の発生額	—	—
退職給付債務の期末残高	3,729,235	3,723,521

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)	第37期 (自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)
勤務費用	203,106 千円	198,457 千円
利息費用	19,110	21,549
期待運用収益	△44,130	△47,588
数理計算上の差異の 費用処理額	41,361	△3,547
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361

その他	44,446	109,013
確定給付制度に係る退職給付費用	329,255	343,245

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

(5)年金資産に関する事項

①年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

②長期期待運用収益率の設定方法

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

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3.確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

繰延税金負債

前払年金費用	△79,225	△58,088
連結納税適用による時価評価	△1,203	△1,149
その他有価証券評価差額金	△1,015,785	△717,957
その他	△101	△101
繰延税金負債 合計	△1,096,346	△777,296
繰延税金資産の純額	916,962	982,406

2.法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳 第36期（令和3年3月31日現在）及び第37期（令和4年3月31日現在）

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

（収益認識関係）

1.顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

2.顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

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

1.製品及びサービスごとの情報

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

2.地域ごとの情報

（1）営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3.主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（1）財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

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

第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（2）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

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

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

第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社に関する注記

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

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

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

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

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

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

3. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

第38期中間会計期間
(令和4年9月30日現在)

(資産の部)

流動資産

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

固定資産

有形固定資産

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

無形固定資産

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

投資その他の資産

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

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

(単位：千円)

第38期中間会計期間

(令和4年9月30日現在)

(負債の部)

流動負債

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

固定負債

退職給付引当金	1,299,571
役員退職慰労引当金	75,667
時効後支払損引当金	261,505

固定負債合計	1,636,744
--------	-----------

負債合計	19,944,625
------	------------

(純資産の部)

株主資本

資本金	2,000,131
資本剰余金	
資本準備金	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712

利益剰余金	
利益準備金	342,589

その他利益剰余金	
別途積立金	6,998,000
繰越利益剰余金	28,593,826

利益剰余金合計	35,934,416
---------	------------

株主資本合計	82,667,260
--------	------------

(単位：千円)

第38期中間会計期間

(令和4年9月30日現在)

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	813,447
--------------	---------

評価・換算差額等合計	813,447
------------	---------

純資産合計	83,480,707
-------	------------

負債純資産合計	103,425,332
---------	-------------

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

	第38期中間会計期間 (自 令和4年4月1日 至 令和4年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	40,789,208
投資顧問料	1,442,097
その他営業収益	5,655
営業収益合計	42,236,961
営業費用	
支払手数料	15,949,349
広告宣伝費	237,620
公告費	250
調査費	
調査費	1,359,939
委託調査費	7,988,301
事務委託費	709,248
営業雑経費	
通信費	64,639
印刷費	194,724
協会費	27,550
諸会費	9,245
事務機器関連費	1,088,738
営業費用合計	27,629,607
一般管理費	
給料	
役員報酬	204,466
給料・手当	2,770,641
賞与引当金繰入	954,015
役員賞与引当金繰入	86,040
福利厚生費	637,045
交際費	4,351
旅費交通費	22,970
租税公課	219,318
不動産賃借料	362,988
退職給付費用	193,777
固定資産減価償却費	※1 1,198,877
諸経費	182,304
一般管理費合計	6,836,796
営業利益	7,770,556

(単位：千円)

	第38期中間会計期間 (自 令和4年4月1日 至 令和4年9月30日)
営業外収益	
受取配当金	31,240
受取利息	5,115
投資有価証券償還益	780
収益分配金等時効完成分	93,217
受取賃貸料	32,904
その他	32,041
営業外収益合計	195,299
営業外費用	

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

(3)中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 令和4年4月1日 至 令和4年9月30日）

（単位：千円）

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

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

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	5年～50年
器具備品	2年～20年
投資不動産	3年～47年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

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

① 退職給付見込額の期間帰属方法

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

② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5) 役員退職慰労引当金

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

(6) 時効後支払損引当金

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

5. 収益および費用の計上基準

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

(1) 委託者報酬

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

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

(2)投資顧問料

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

6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

7. その他中間財務諸表作成のための重要な事項

グループ通算制度の適用

当中間会計期間からグループ通算制度を適用しております。

[会計方針の変更]

(時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用)

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

(追加情報)

当社は、当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日。以下「実務対応報告第42号」という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項(1)に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

※1 減価償却累計額

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

※2 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

※1 減価償却実施額

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第38期中間会計期間（自 令和4年4月1日 至 令和4年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

令和4年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

①	配当金の総額	6,075,125千円
②	配当の原資	利益剰余金
③	1株当たり配当額	28,713円
④	基準日	令和4年3月31日
⑤	効力発生日	令和4年6月29日

（リース取引関係）

第38期中間会計期間（令和4年9月30日現在）

〈借主側〉

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

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

（金融商品関係）

第38期中間会計期間（令和4年9月30日現在）

1. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（注2）市場価格のない株式等

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

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

（注3）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

- レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

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

時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産

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

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

金銭の信託

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

（有価証券関係）

第38期中間会計期間（令和4年9月30日現在）

1. 子会社及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

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

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

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

3. 減損処理を行った有価証券

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

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

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

ます。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第38期中間会計期間（自 令和4年4月1日 至 令和4年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第38期中間会計期間（自 令和4年4月1日 至 令和4年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

（1株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

4【利害関係人との取引制限】

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

- ①自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ②運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、も

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

- ③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④⑤において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ④委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ⑤上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5【その他】

①定款の変更等

定款について2023年10月1日付で以下の変更を行います。

- ・商号の変更（三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更）

②訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（1）受託会社

①名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

（再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）

②資本金の額：324,279百万円（2022年9月末現在）

③事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

（2）販売会社

①名称	②資本金の額 (2022年9月末現在)	③事業の内容
株式会社 三菱UFJ銀行	1,711,958 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社 八十二銀行	52,243 百万円	銀行業務を営んでいます。
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

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

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

3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2023年2月末現在）

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

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

第３【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2022年 5月20日	有価証券届出書
2022年 5月20日	有価証券報告書
2022年11月21日	有価証券届出書の訂正届出書
2022年11月21日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

令和4年6月10日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

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

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

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

令和5年4月26日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員

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」に掲げられている三菱UFJ 外国株式インデックスファンドの令和4年2月23日から令和5年2月22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、三菱UFJ 外国株式インデックスファンドの令和5年2月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

令和4年12月2日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 青木 裕 晃

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 伊藤 鉄 也

中間監査意見

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

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。