

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年8月21日提出
【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
【電話番号】	03-6250-4740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	三菱ＵＦＪ ＤＣ年金インデックス（先進国株式）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	１兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

三菱UFJ DC年金インデックス（先進国株式）（「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

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

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位

（７）【申込期間】

2023年 8月22日から2024年 8月19日まで

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

（８）【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、確定拠出年金制度を利用する場合の申込みに限り取り扱うものとします。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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

（９）【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

（１０）【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

（１１）【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

信託金の限度額は、5,000億円です。

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

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
		債券		
	海外	不動産投信	MRF	特殊型 ()
追加型	内外	その他資産 ()	ETF	
		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	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
	年2回				TOPIX	条件付運用型
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ()	年4回	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	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
不動産投信	年6回 (隔月)					その他 ()
その他資産 (投資信託証券 (株式 一 般))	年12回 (毎月)					
資産複合 ()	日々 その他 ()					

※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「MRF及びMMFの運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。
	MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MRF及びMMFの運営に関する規則」に規定するMRFをいいます。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

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。
		年4回	信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。
		年6回（隔月）	信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。
		年12回（毎月）	信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
		日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
		その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル		信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本		信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米		信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州		信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア		信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア		信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米		信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ		信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）		信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング		信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

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

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

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

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

ファンドの特色

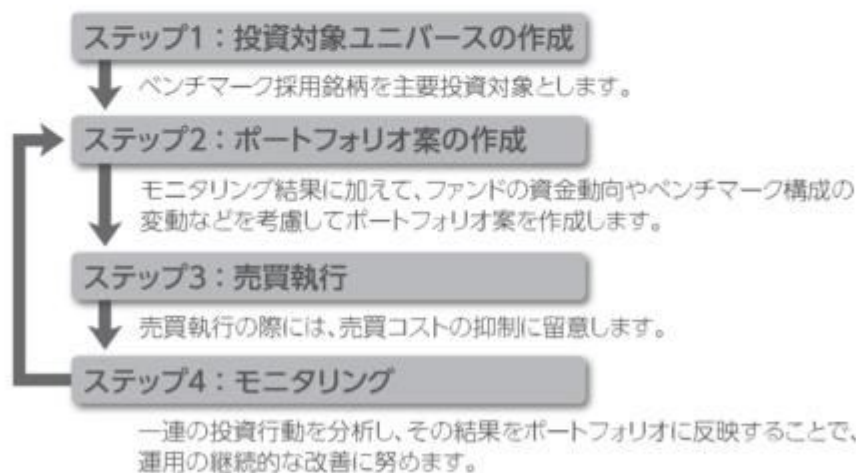
特色

1

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

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

<運用プロセスのイメージ>



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

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

特色

2

日本を除く世界各国の株式に投資を行います。

- 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。
※実際の運用は外国株式インデックスマザーファンドを通じて行います。

特色

3

原則として、為替ヘッジは行いません。

- 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。

特色

4

年1回の決算時(5月20日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。

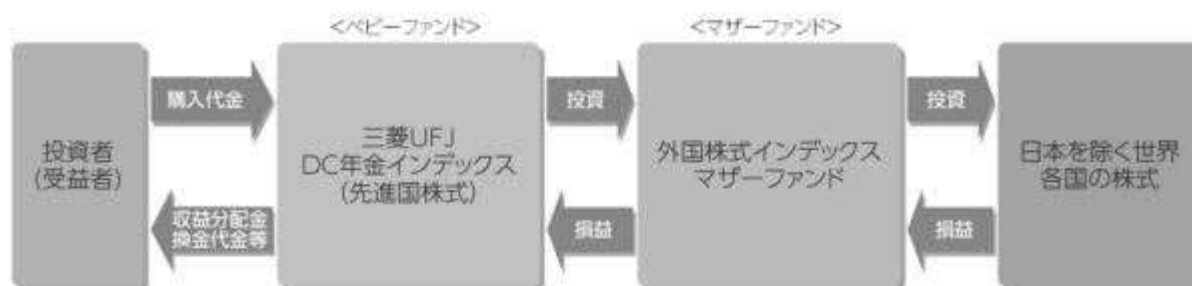
- 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ファンドの仕組み

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、日本を除く世界各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

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

■ 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を問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCI Inc.とその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指数は、当ファンドまたは当ファンドの委託会社あるいは受益者に関わらず、MSCI Inc.により決定、作成、および計算されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数の決定、作成、あるいは計算において、当ファンドの委託会社または受益者の要求を考慮に入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は計算について責任を負うものではなく、参加しておりません。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、当ファンドの受益者に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

MSCI Inc.は、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、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。

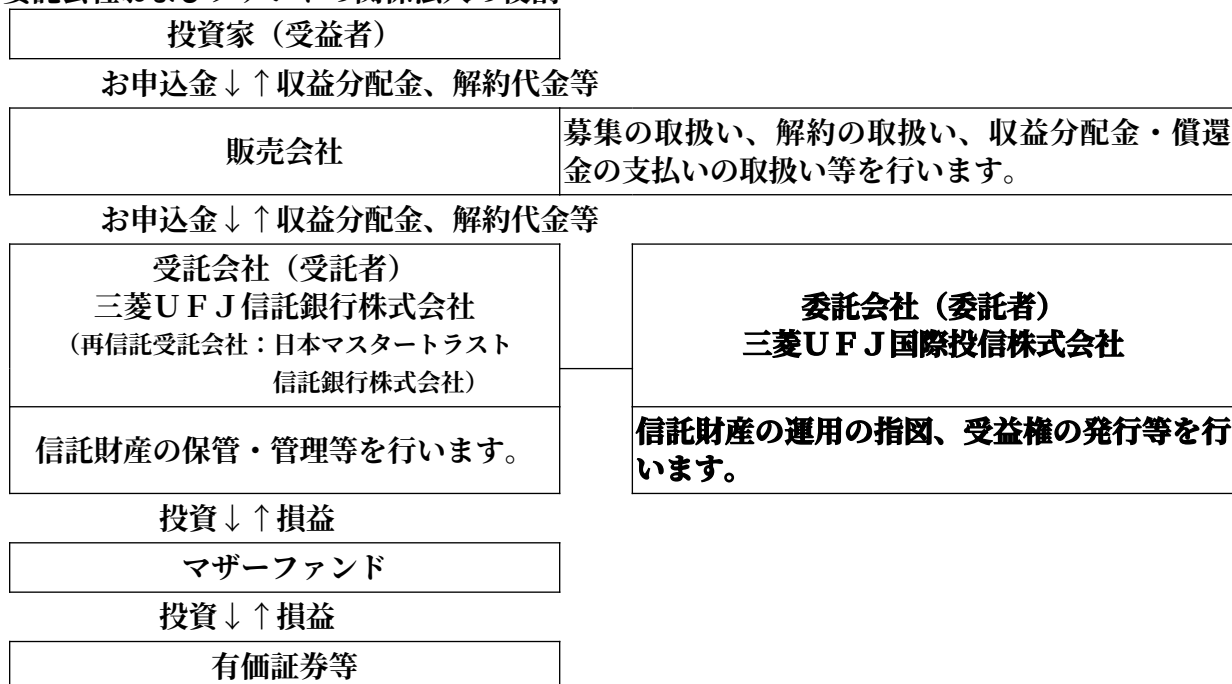
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2018年9月26日	設定日、信託契約締結、運用開始
2021年8月20日	ファンドの投資対象に「外国株式インデックスマザーファンド」を追加
2021年12月28日	ファンドの投資対象から「三菱UFJ 外国株式マザーファンド」を削除

(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



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5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。

外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を除く世界各国の株式に投資を行います。

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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）【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す。）
 - a. 有価証券先物取引等
 - b. スワップ取引
 - c. 金利先渡取引および為替先渡取引
 - 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（以下「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. で定めるものの以外のもの
 16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16. において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 21. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
 22. 外国の者に対する権利で21. の有価証券の性質を有するもの
 23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- なお、1. の証券または証書ならびに13. および19. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から6. までの証券ならびに16. の証券ならびに13. および19. の証券または証書のうち2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14. および15. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

<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。

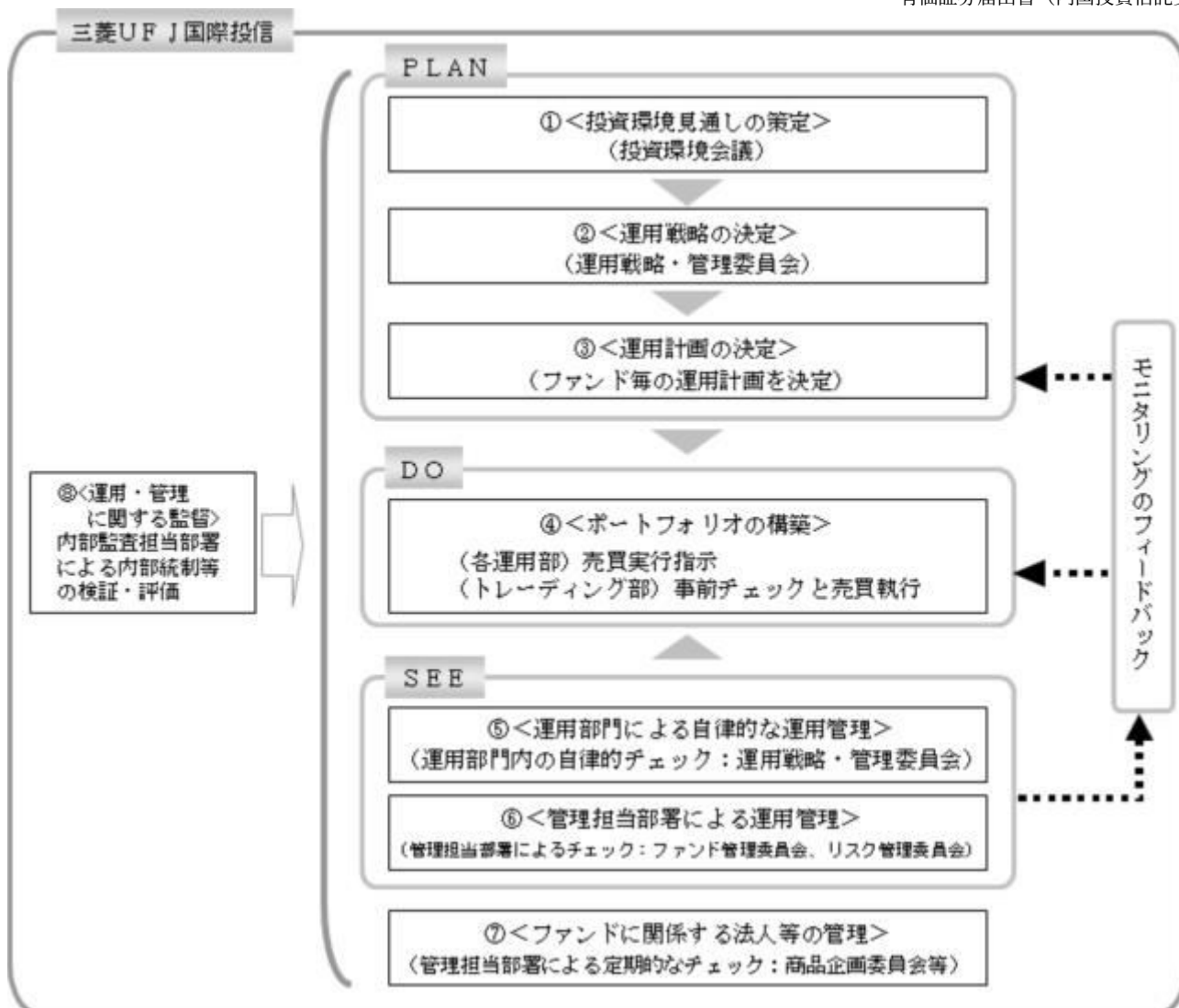
組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

③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。

④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。

⑤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、当該売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内である場合においてできます。
- c. 信託財産の一部解約等の事由によりb. の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

⑥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。

⑦公社債の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. a. の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

⑧資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約

代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

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

⑨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。

⑩金利先渡取引および為替先渡取引

- 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、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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公社債の空売り

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債または借り入れた公社債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、売り付けた公社債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. の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

⑬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。

⑭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。

⑮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。）

価格変動 リスク	株式の価格は、株式市場全体の動向のほか、発行企業の業績や業績に対する市場の見通しなどの影響を受けて変動します。組入株式の価格の下落は、基準価額の下落要因となります。
為替変動 リスク	組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を受けます。
信用リスク	株式の発行企業の経営、財務状況が悪化したり、市場においてその懸念が高まった場合には、株式の価格が下落すること、配当金が減額あるいは支払いが停止されること、倒産等によりその価値がなくなること等があります。
流動性 リスク	株式を売買しようとする際に、その株式の取引量が十分でない場合や規制等により取引が制限されている場合には、売買が成立しなかったり、十分な数量の売買が出来なかったり、ファンドの売買自体によって市場価格が動き、結果として不利な価格での取引となる場合があります。

※留意事項

- ・ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

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

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

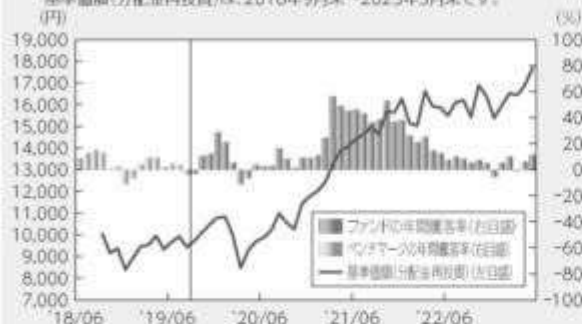
＊組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■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。

● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

ファンドの年間騰落率は、2019年9月～2023年5月です。
ベンチマークの年間騰落率は、2018年6月～2019年8月です。
基準価額(分配金再投資)は、2018年9月末～2023年5月末です。



● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2018年6月末～2023年5月末)

ファンドの年間騰落率はベンチマーク(2019年8月以前)の年間騰落率を含みます。



（注）全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	東証株価指数(TOPIX) (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に係る商標又は商標は、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に係る商標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の知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、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の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】

ありません。

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

（２）【換金（解約）手数料】

かかりません。

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

（３）【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年0.154%（税抜0.14%）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	0.06%	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	0.06%	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	0.02%	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、外国株式インデックス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。

確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて受益権の取得の申込みを行う資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記以外の場合の課税の取扱いは、次の通りです。

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。

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5月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

【三菱UFJ DC年金インデックス（先進国株式）】

(1)【投資状況】

2023年 5月31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	18,826,497,172	99.99
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	947,667	0.01
純資産総額		18,827,444,839	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

2023年 5月31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	3,669,095,744	5.0882	18,669,092,965	5.1311	18,826,497,172	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

2023年 5月31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2023年5月末日、同日前１年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末日 (2019年 5月20日)	962,249	962,249	9,622	9,622
第2計算期間末日 (2020年 5月20日)	146,382,489	146,382,489	9,346	9,346
第3計算期間末日 (2021年 5月20日)	2,005,366,651	2,005,366,651	13,663	13,663
第4計算期間末日 (2022年 5月20日)	7,037,307,575	7,037,307,575	14,877	14,877
第5計算期間末日 (2023年 5月22日)	18,159,874,038	18,159,874,038	17,522	17,522
2022年 5月末日	8,416,788,688	—	15,872	—
6月末日	9,167,506,428	—	15,498	—
7月末日	10,949,187,882	—	16,106	—
8月末日	11,534,818,700	—	16,214	—
9月末日	11,517,097,577	—	15,418	—
10月末日	12,989,276,733	—	16,891	—
11月末日	13,656,936,980	—	16,392	—
12月末日	13,534,810,918	—	15,385	—
2023年 1月末日	14,572,232,716	—	15,966	—
2月末日	15,586,477,679	—	16,525	—
3月末日	16,560,850,933	—	16,441	—
4月末日	17,455,030,849	—	16,890	—
5月末日	18,827,444,839	—	17,677	—

②【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円
第2計算期間	0円
第3計算期間	0円
第4計算期間	0円
第5計算期間	0円

③【収益率の推移】

	収益率（％）
--	--------

第1計算期間	△3.78
第2計算期間	△2.86
第3計算期間	46.19
第4計算期間	8.88
第5計算期間	17.77

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	1,000,000	—	1,000,000
第2計算期間	179,696,012	24,070,699	156,625,313
第3計算期間	1,499,344,008	188,207,981	1,467,761,340
第4計算期間	3,951,303,124	688,618,347	4,730,446,117
第5計算期間	7,062,404,781	1,429,026,730	10,363,824,168

（参考）

外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

2023年 5月31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	1,778,418,423,116	69.51
	イギリス	104,731,297,949	4.09
	カナダ	84,297,429,016	3.29
	フランス	84,086,149,896	3.29
	スイス	76,999,235,615	3.01
	ドイツ	62,742,136,696	2.45
	オーストラリア	51,514,921,286	2.01
	オランダ	44,657,527,175	1.75
	スウェーデン	24,017,388,581	0.94
	デンマーク	23,241,547,810	0.91
	スペイン	19,378,275,007	0.76
	香港	17,465,717,812	0.68
	イタリア	13,316,314,482	0.52
	シンガポール	8,078,450,430	0.32
	フィンランド	6,780,045,025	0.26

	アイルランド	5,790,501,426	0.23
	ベルギー	5,617,330,719	0.22
	ノルウェー	4,504,606,766	0.18
	イスラエル	3,134,063,364	0.12
	ニュージーランド	1,521,760,082	0.06
	ルクセンブルグ	1,475,625,619	0.06
	オーストリア	1,356,130,067	0.05
	ポルトガル	1,232,210,009	0.05
	小計	2,424,357,087,948	94.75
投資証券	アメリカ	43,493,915,951	1.70
	オーストラリア	2,942,579,425	0.12
	シンガポール	1,086,665,781	0.04
	イギリス	1,012,693,637	0.04
	フランス	788,478,233	0.03
	香港	730,083,446	0.03
	カナダ	236,612,136	0.01
	ベルギー	200,186,081	0.01
	小計	50,491,214,690	1.97
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	83,835,126,919	3.28
純資産総額		2,558,683,429,557	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

2023年 5月31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	62,477,294,827	2.44
	買建	カナダ	2,951,799,404	0.12
	買建	ドイツ	10,330,081,454	0.40
	買建	オーストラリア	2,729,108,350	0.11
	買建	イギリス	7,399,192,263	0.29
	買建	スイス	2,596,737,938	0.10

（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

2023年 5月31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	5,567,367	24,279.53	135,173,093,817	24,781.22	137,966,152,015	5.39
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア・ サービス	2,478,257	43,338.77	107,404,628,349	46,293.22	114,726,500,731	4.48
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	3,213,639	15,670.42	50,359,077,809	17,004.41	54,646,061,500	2.14
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	860,930	39,932.35	34,378,962,449	56,063.14	48,266,443,167	1.89
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディ ア・娯楽	2,089,954	16,297.44	34,060,900,356	17,285.35	36,125,598,705	1.41
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディ ア・娯楽	1,917,465	16,343.80	31,338,667,534	17,420.93	33,404,028,911	1.31
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディ ア・娯楽	787,011	32,947.13	25,929,761,000	36,692.42	28,877,338,471	1.13
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・ 自動車部 品	939,557	24,032.33	22,579,746,827	28,116.13	26,416,709,761	1.03
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケ ア機器・ サービス	326,731	68,325.27	22,323,985,999	67,068.63	21,913,402,019	0.86
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネル ギー	1,441,112	14,786.22	21,308,608,699	14,541.67	20,956,176,290	0.82
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サー ビス	455,391	45,094.71	20,535,726,917	45,032.49	20,507,393,523	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	913,928	22,500.61	20,563,945,729	21,576.29	19,719,180,045	0.77
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1,025,918	19,006.72	19,499,344,280	19,212.78	19,710,741,141	0.77
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サー ビス	569,527	32,289.98	18,390,021,025	30,978.62	17,643,162,107	0.69
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	282,526	60,871.65	17,197,825,305	59,715.33	16,871,134,680	0.66
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用 品・パー ソナル用 品	828,983	21,586.40	17,894,759,453	20,012.26	16,589,830,461	0.65
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・ 半導体製 造装置	145,823	87,745.60	12,795,327,366	112,282.83	16,373,419,382	0.64
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲 料・タバ コ	961,859	17,772.41	17,094,557,899	16,717.94	16,080,306,245	0.63
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サー ビス	300,266	53,579.68	16,088,158,286	51,365.47	15,423,305,716	0.60
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	356,946	40,223.85	14,357,744,902	40,868.74	14,587,936,124	0.57
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・ 半導体製 造装置	140,979	89,034.85	12,552,044,443	102,492.32	14,449,265,345	0.56

アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	642,751	21,836.78	14,035,613,156	21,401.58	13,755,888,489	0.54
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	886,431	16,428.08	14,562,361,214	15,258.69	13,525,776,633	0.53
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	578,163	23,298.15	13,470,130,765	22,487.39	13,001,382,646	0.51
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	480,764	27,306.06	13,127,772,653	25,383.62	12,203,535,349	0.48
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	耐久消費財・アパレル	96,884	133,177.88	12,902,806,669	125,433.44	12,152,493,401	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	1,434,040	8,926.80	12,801,398,774	8,355.45	11,982,050,378	0.47
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	618,865	20,491.54	12,681,497,942	19,070.21	11,801,890,958	0.46
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	154,964	70,159.79	10,872,242,134	71,007.35	11,003,583,466	0.43
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	245,433	43,597.38	10,700,236,315	44,425.84	10,903,569,398	0.43

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2023年 5月31日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	エネルギー	4.75
	素材	3.91
	資本財	6.34
	商業・専門サービス	1.54
	運輸	1.76
	自動車・自動車部品	1.86
	耐久消費財・アパレル	1.66
	消費者サービス	2.04
	メディア・娯楽	5.78
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.20
	生活必需品流通・小売り	1.71
	食品・飲料・タバコ	3.97
	家庭用品・パーソナル用品	1.69
	ヘルスケア機器・サービス	4.47

	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.36
	銀行	5.13
	金融サービス	6.26
	保険	2.98
	ソフトウェア・サービス	9.23
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.79
	電気通信サービス	1.26
	公益事業	2.85
	半導体・半導体製造装置	5.93
	不動産管理・開発	0.29
	小計	94.75
投資証券	—	1.97
合計		96.72

（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

2023年 5月31日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2306	買建	2,121	アメリカドル	441,155,161.3	61,660,256,894	447,000,750	62,477,294,827	2.44
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602306	買建	121	カナダドル	29,681,628.5	3,048,006,430	28,744,760	2,951,799,404	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 2306	買建	1,603	ユーロ	69,171,495.32	10,378,491,158	68,848,850	10,330,081,454	0.40
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2306	買建	166	オーストラリアドル	30,149,609	2,745,724,891	29,967,150	2,729,108,350	0.11
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2306	買建	566	イギリスポンド	43,749,176.25	7,598,794,423	42,599,990	7,399,192,263	0.29
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX2306	買建	149	スイスフラン	17,154,507.65	2,647,112,075	16,828,060	2,596,737,938	0.10

（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。

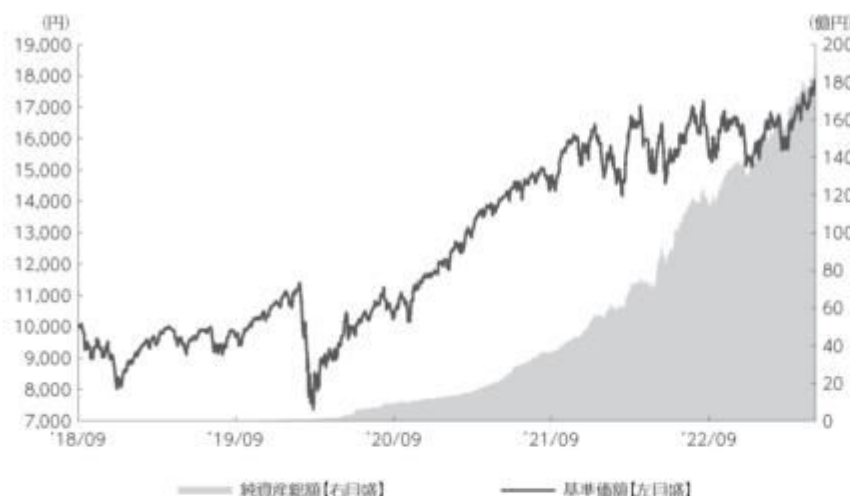
《参考情報》



運用実績

2023年5月31日現在

■基準価額・純資産の推移 2018年9月26日(設定日)～2023年5月31日



- ・基準価額は10,000を起点として表示
- ・基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	17,677円
純資産総額	188.2億円

・純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2023年 5月	0円
2022年 5月	0円
2021年 5月	0円
2020年 5月	0円
2019年 5月	0円
設定来累計	0円

・分配金は1万口当たり、税引前

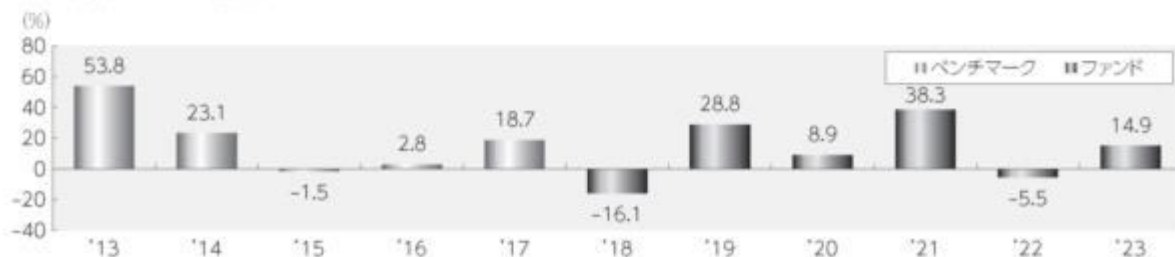
■主要な資産の状況

組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
1 アメリカドル	73.7%	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	5.4%
2 ユーロ	10.0%	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	4.5%
3 イギリスポンド	4.4%	3 AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	アメリカ	2.1%
4 カナダドル	3.4%	4 NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	アメリカ	1.9%
5 スイスフラン	3.1%	5 ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	アメリカ	1.4%
6 オーストラリアドル	2.2%	6 ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	アメリカ	1.3%
7 スウェーデンクローネ	1.0%	7 META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	アメリカ	1.1%
8 デンマーククローネ	0.9%	8 TESLA INC	自動車・自動車部品	アメリカ	1.0%
9 香港ドル	0.7%	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 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	アメリカ	0.8%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引（買建）	3.5%

- ・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



- ・収益率は基準価額で計算
- ・2018年は設定日から年末までの、2023年は年初から5月31日までの収益率を表示
- ・2017年以前はベンチマークの年間収益率を表示

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。
ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

1円以上1円単位

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申込価額の照会方法

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）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑥申込手数料

ありません。

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、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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

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

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

※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

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

④信託財産留保額

ありません。

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。

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（2018年9月26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５月２１日から翌年５月２０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１０億口を下回ることとなった場合
- ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃されたときまたはやむを得ない事情が発生したとき

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

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

②信託約款の変更等

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

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

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

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

④反対受益者の受益権買取請求の不適用

委託会社がファンドの任意償還、重大な約款変更等を行う場合、書面決議において反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。この規定は、受益者が自己に帰属する受益権についてその全部または一部の償還を請求したときに、委託会社が信託約款の規定に基づいて信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。

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

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。

収益分配金は、「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（2022年5月21日から2023年5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 DC年金インデックス（先進国株式）】

（１）【貸借対照表】

(単位：円)		
	第4期 [2022年 5月20日現在]	第5期 [2023年 5月22日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	17,471,309	41,046,345
親投資信託受益証券	7,036,610,993	18,157,921,487
未収入金	-	58,635,543
流動資産合計	7,054,082,302	18,257,603,375
資産合計	7,054,082,302	18,257,603,375
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,058,574	85,694,601
未払受託者報酬	659,156	1,682,009
未払委託者報酬	3,954,884	10,092,014
未払利息	7	54
その他未払費用	102,106	260,659
流動負債合計	16,774,727	97,729,337
負債合計	16,774,727	97,729,337
純資産の部		
元本等		
元本	4,730,446,117	10,363,824,168
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,306,861,458	7,796,049,870
（分配準備積立金）	345,473,435	2,212,748,684
元本等合計	7,037,307,575	18,159,874,038
純資産合計	7,037,307,575	18,159,874,038
負債純資産合計	7,054,082,302	18,257,603,375

（２）【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期 自 2021年 5月21日 至 2022年 5月20日	第5期 自 2022年 5月21日 至 2023年 5月22日
営業収益		
受取利息	31	74
有価証券売買等損益	47,737,631	2,148,530,517
その他収益	126,010	203,446
営業収益合計	47,863,672	2,148,734,037
営業費用		
支払利息	1,409	8,431
受託者報酬	1,021,611	2,886,165
委託者報酬	6,129,586	17,316,853
その他費用	158,229	447,236
営業費用合計	7,310,835	20,658,685
営業利益又は営業損失（△）	40,552,837	2,128,075,352
経常利益又は経常損失（△）	40,552,837	2,128,075,352
当期純利益又は当期純損失（△）	40,552,837	2,128,075,352
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（△）	53,544,114	130,469,600
期首剰余金又は期首欠損金（△）	537,605,311	2,306,861,458
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,086,433,326	4,253,987,444
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,086,433,326	4,253,987,444
剰余金減少額又は欠損金増加額	304,185,902	762,404,784
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	304,185,902	762,404,784
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,306,861,458	7,796,049,870

(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。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年5月20日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は2022年 5月21日から2023年 5月22日までとなっております。

(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4期 [2022年 5月20日現在]	第5期 [2023年 5月22日現在]
1. 期首元本額	1,467,761,340円	4,730,446,117円
期中追加設定元本額	3,951,303,124円	7,062,404,781円
期中一部解約元本額	688,618,347円	1,429,026,730円
2. 受益権の総数	4,730,446,117口	10,363,824,168口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2021年 5月21日 至 2022年 5月20日			第5期 自 2022年 5月21日 至 2023年 5月22日		
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	75,521,213円	費用控除後の配当等収益額	A	262,208,144円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	—円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,661,289,710円
収益調整金額	C	1,961,388,023円	収益調整金額	C	5,583,301,186円
分配準備積立金額	D	269,952,222円	分配準備積立金額	D	289,250,830円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,306,861,458円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,796,049,870円
当ファンドの期末残存口数	F	4,730,446,117口	当ファンドの期末残存口数	F	10,363,824,168口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	4,876円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	7,522円
1万口当たり分配金額	H	—円	1万口当たり分配金額	H	—円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円

第4期 自 2021年 5月21日 至 2022年 5月20日	第5期 自 2022年 5月21日 至 2023年 5月22日

（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4期 自 2021年 5月21日 至 2022年 5月20日	第5期 自 2022年 5月21日 至 2023年 5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。	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、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第4期 [2022年 5月20日現在]	第5期 [2023年 5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	（１）有価証券 同左 （２）デリバティブ取引

区分	第4期 [2022年 5月20日現在]	第5期 [2023年 5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	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。 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 (3) 上記以外の金融商品 同左 同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第4期 [2022年 5月20日現在]	第5期 [2023年 5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	△309,301,257	2,133,852,985
合計	△309,301,257	2,133,852,985

(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4期 [2022年 5月20日現在]	第5期 [2023年 5月22日現在]
1口当たり純資産額	1.4877円	1.7522円
(1万口当たり純資産額)	(14,877円)	(17,522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	3,570,107,054	18,157,921,487	
合計		3,570,107,054	18,157,921,487	

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）

[2023年 5月22日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	21,748,553,911
コール・ローン	5,465,309,059
株式	2,404,031,724,020
投資証券	50,420,269,451
派生商品評価勘定	826,432,828
未収入金	159,879,943
未収配当金	3,360,600,829
差入委託証拠金	43,600,435,365
流動資産合計	2,529,613,205,406
資産合計	2,529,613,205,406

[2023年 5月22日現在]

負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	77,280,958
未払金	280,288,773
未払解約金	1,200,337,572
未払利息	7,208
流動負債合計	1,557,914,511
負債合計	1,557,914,511
純資産の部	
元本等	
元本	497,050,890,427
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,031,004,400,468
元本等合計	2,528,055,290,895
純資産合計	2,528,055,290,895
負債純資産合計	2,529,613,205,406

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）

	[2023年 5月22日現在]
1. 期首	2022年 5月21日
期首元本額	338,195,078,519円
期中追加設定元本額	248,392,759,086円
期中一部解約元本額	89,536,947,178円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）	217,050,459円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）	994,684,204円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）	892,633,592円

	[2023年 5月22日現在]
MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信	2,980,421,462円
MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信	3,916,231,520円
三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	1,693,708,493円
三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	9,799,733,082円
三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	10,490,511,184円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	51,965,379円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）	137,989,563円
ファンド・マネジャー（海外株式）	780,537円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,653,764,688円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,124,045,407円
eMAXIS バランス（波乗り型）	171,563,192円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	1,799,039,260円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	223,769,167円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	267,921,710円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	247,869,962円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	89,365,658,774円
海外株式セレクション（ラップ向け）	2,361,507,125円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	4,846,598,160円
つみたて先進国株式	24,302,803,101円
つみたて8資産均等バランス	2,318,350,263円
つみたて4資産均等バランス	789,551,548円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,941,287円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,381,981円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	5,135,247円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	188,372,918円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	206,246,700円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	134,945,537円
三菱UFJ DC年金バランス（株式15）	59,132,243円
三菱UFJ DC年金バランス（株式40）	477,487,709円
三菱UFJ DC年金バランス（株式65）	1,150,126,882円
eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）	43,821,368,228円
eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）	491,962,036円
三菱UFJ DC年金インデックス（先進国株式）	3,570,107,054円
eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）	179,035,818,527円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	117,859,820円
三菱UFJ DC年金バランス（株式25）	44,372,196円
つみたて全世界株式	225,065,620円

	[2023年 5月22日現在]
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）	47,082,135円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	2,267,357,992円
三菱UFJ DC年金バランス（株式80）	18,187,402円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	3,445,851,249円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	31,450,155円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	29,545,897,762円
eMAXIS 全世界株式インデックス	4,679,618,402円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	382,761,360円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	648,174,766円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	116,208,794円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	388,811,337円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	238,927,425円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	328,140,957円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	90,079,995円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	113,009,973円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	466,189,996円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	369,736,682円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	695,981,796円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA（適格機関投資家限定）	1,558,388,167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）	14,338円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	6,158,361円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	3,949,521,091円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	47,029,558円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	779,767,001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）	10,518,916,421円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	382,649円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	617,618,385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）	5,225,533,447円
アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）	11,373,564円
アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）	74,110,205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）	1,092,041,236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）	345,380,331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）	354,999,460円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	54,830,109円

	[2023年 5月22日現在]
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）	1,469,551,667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）	86,635,739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）	2,458,573,019円
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）	361,569,301円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	5,904,448,455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）	29,422,276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）	126,717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）	2,574,792,997円
海外株式インデックスファンドS	2,791,186,550円
外国株式インデックスオープンV（適格機関投資家限定）	206,393円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,706,110,818円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	801,682円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	2,142,721円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	645,570円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	2,060,356円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	23,557,796円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	874,470円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	9,537,817円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	1,419,495円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	14,569,727円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	6,560,855,574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）	97,802,010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）	403,681,457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）	433,729,904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）	425,579,598円
合計	497,050,890,427円
2. 受益権の総数	497,050,890,427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 2022年 5月21日 至 2023年 5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。
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、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2023年 5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

種類	[2023年 5月22日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	31,249,499,606
投資証券	△1,243,597,258
合計	30,005,902,348

(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

[2023年 5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	75,249,777,407	—	76,012,941,407	763,164,000
合計		75,249,777,407	—	76,012,941,407	763,164,000

(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

[2023年 5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	5,125,105,415	—	5,111,481,147	△13,624,268
	カナダドル	257,777,015	—	257,071,254	△705,761
	オーストラリアドル	168,632,582	—	168,628,473	△4,109
	イギリスポンド	266,372,127	—	266,263,555	△108,572
	スイスフラン	242,127,185	—	242,430,616	303,431
	香港ドル	44,551,264	—	44,473,789	△77,475
	シンガポールドル	15,817,956	—	15,781,565	△36,391
	スウェーデンクローネ	66,006,650	—	66,012,270	5,620

	ノルウェークローネ	16,961,720	—	16,960,916	△804
	デンマーククロネ	170,240,282	—	170,706,046	465,764
	ユーロ	493,392,193	—	493,162,628	△229,565
合計		6,866,984,389	—	6,852,972,259	△14,012,130

(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)

	[2023年 5月22日現在]
1口当たり純資産額	5.0861円
(1万口当たり純資産額)	(50,861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	115,689	33.41	3,865,169.49	
	BAKER HUGHES CO	344,454	28.17	9,703,269.18	
	CHENIERE ENERGY INC	80,699	141.18	11,393,084.82	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	37,475	81.22	3,043,719.50	
	CHEVRON CORP	642,751	155.23	99,774,237.73	
	CONOCOPHILLIPS	436,643	102.60	44,799,571.80	

COTERRA ENERGY INC	274,210	25.63	7,028,002.30
DEVON ENERGY CORP	212,671	49.20	10,463,413.20
DIAMONDBACK ENERGY INC	56,570	130.22	7,366,545.40
EOG RESOURCES INC	206,376	114.59	23,648,625.84
EQT CORP	116,920	36.23	4,236,011.60
EXXON MOBIL CORP	1,441,112	106.26	153,132,561.12
HALLIBURTON CO	321,798	30.17	9,708,645.66
HESS CORP	99,236	133.55	13,252,967.80
HF SINCLAIR CORP	47,286	41.35	1,955,276.10
KINDER MORGAN INC	689,362	16.52	11,388,260.24
MARATHON OIL CORP	217,347	23.07	5,014,195.29
MARATHON PETROLEUM CORP	165,311	110.31	18,235,456.41
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	258,053	59.13	15,258,673.89
ONEOK INC	152,897	58.52	8,947,532.44
OVINTIV INC	82,940	34.52	2,863,088.80
PHILLIPS 66	166,852	94.94	15,840,928.88
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	79,525	208.94	16,615,953.50
SCHLUMBERGER LTD	496,616	45.27	22,481,806.32
TARGA RESOURCES CORP	76,008	70.22	5,337,281.76
TEXAS PACIFIC LAND CORP	2,158	1,346.02	2,904,711.16
VALERO ENERGY CORP	136,312	111.27	15,167,436.24
WILLIAMS COS INC	436,341	29.24	12,758,610.84
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	77,768	278.91	21,690,272.88
ALBEMARLE CORP	40,222	204.15	8,211,321.30
ALCOA CORP	65,943	36.10	2,380,542.30
AMCOR PLC	523,563	10.23	5,356,049.49
AVERY DENNISON CORP	27,835	170.80	4,754,218.00
BALL CORP	110,807	54.60	6,050,062.20
CELANESE CORP	35,523	107.38	3,814,459.74
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	69,306	66.22	4,589,443.32
CLEVELAND-CLIFFS INC	171,019	14.93	2,553,313.67
CORTEVA INC	253,670	56.97	14,451,579.90
CROWN HOLDINGS INC	43,629	81.55	3,557,944.95
DOW INC	251,154	51.95	13,047,450.30
DUPONT DE NEMOURS INC	179,201	66.75	11,961,666.75
EASTMAN CHEMICAL CO	40,284	82.45	3,321,415.80
ECOLAB INC	90,750	175.27	15,905,752.50
FMC CORP	43,553	108.91	4,743,357.23
FREEPORT-MCMORAN INC	503,689	35.73	17,996,807.97
INTERNATIONAL PAPER CO	111,608	31.96	3,566,991.68
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	91,686	83.68	7,672,284.48
LINDE PLC	172,898	371.49	64,229,878.02

LYONDELLBASELL INDU-CL A	89,921	90.89	8,172,919.69
MARTIN MARIETTA MATERIALS	21,677	408.40	8,852,886.80
MOSAIC CO/THE	113,000	35.76	4,040,880.00
NEWMONT CORP	284,516	43.66	12,421,968.56
NUCOR CORP	92,184	138.67	12,783,155.28
PACKAGING CORP OF AMERICA	30,858	129.45	3,994,568.10
PPG INDUSTRIES INC	80,081	142.40	11,403,534.40
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	19,300	244.03	4,709,779.00
RPM INTERNATIONAL INC	45,708	80.08	3,660,296.64
SEALED AIR CORP	49,467	42.35	2,094,927.45
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	86,347	232.77	20,098,991.19
STEEL DYNAMICS INC	60,708	97.06	5,892,318.48
VULCAN MATERIALS CO	46,218	197.22	9,115,113.96
WESTLAKE CORP	13,051	116.30	1,517,831.30
WESTROCK CO	81,719	27.78	2,270,153.82
3M CO	193,944	99.03	19,206,274.32
AECOM	43,500	79.28	3,448,680.00
AERCAP HOLDINGS NV	56,854	58.63	3,333,350.02
ALLEGION PLC	31,093	109.30	3,398,464.90
AMETEK INC	83,048	147.57	12,255,393.36
AXON ENTERPRISE INC	22,200	196.86	4,370,292.00
BOEING CO/THE	198,086	205.49	40,704,692.14
CARLISLE COS INC	16,689	212.31	3,543,241.59
CARRIER GLOBAL CORP	299,382	42.79	12,810,555.78
CATERPILLAR INC	182,028	214.78	39,095,973.84
CUMMINS INC	48,113	216.68	10,425,124.84
DEERE & CO	100,304	363.55	36,465,519.20
DOVER CORP	49,146	139.47	6,854,392.62
EATON CORP PLC	138,877	174.15	24,185,429.55
EMERSON ELECTRIC CO	208,522	82.49	17,200,979.78
FASTENAL CO	196,429	55.00	10,803,595.00
FERGUSON PLC	71,420	148.55	10,609,441.00
FORTIVE CORP	113,654	65.70	7,467,067.80
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	47,372	65.39	3,097,655.08
GENERAC HOLDINGS INC	21,013	113.79	2,391,069.27
GENERAL DYNAMICS CORP	82,169	210.65	17,308,899.85
GENERAL ELECTRIC CO	382,079	104.26	39,835,556.54
GRACO INC	56,100	78.05	4,378,605.00
HEICO CORP	15,479	176.98	2,739,473.42
HEICO CORP-CLASS A	28,006	139.88	3,917,479.28
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	234,848	197.35	46,347,252.80
HOWMET AEROSPACE INC	137,808	44.96	6,195,847.68

HUBBELL INC	20,146	280.01	5,641,081.46
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	13,307	200.64	2,669,916.48
IDEX CORP	27,872	204.99	5,713,481.28
ILLINOIS TOOL WORKS	107,194	228.04	24,444,519.76
INGERSOLL-RAND INC	149,426	59.76	8,929,697.76
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	52,400	49.94	2,616,856.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	243,745	63.22	15,409,558.90
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	68,465	184.40	12,624,946.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	11,485	288.05	3,308,254.25
LOCKHEED MARTIN CORP	82,365	454.49	37,434,068.85
MASCO CORP	73,970	52.55	3,887,123.50
NORDSON CORP	19,892	217.17	4,319,945.64
NORTHROP GRUMMAN CORP	51,113	443.31	22,658,904.03
OTIS WORLDWIDE CORP	149,610	84.56	12,651,021.60
OWENS CORNING	29,948	110.13	3,298,173.24
PACCAR INC	186,598	71.75	13,388,406.50
PARKER HANNIFIN CORP	45,567	332.84	15,166,520.28
PENTAIR PLC	53,508	59.16	3,165,533.28
PLUG POWER INC	170,755	7.73	1,319,936.15
QUANTA SERVICES INC	48,871	171.71	8,391,639.41
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	513,076	96.13	49,321,995.88
ROCKWELL AUTOMATION INC	39,232	281.31	11,036,353.92
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	47,364	41.46	1,963,711.44
SMITH (A.O.) CORP	41,076	68.42	2,810,419.92
SNAP-ON INC	18,428	260.86	4,807,128.08
STANLEY BLACK & DECKER INC	49,255	81.61	4,019,700.55
TEXTRON INC	68,142	64.47	4,393,114.74
TORO CO	34,600	105.24	3,641,304.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	81,860	173.28	14,184,700.80
TRANSDIGM GROUP INC	18,359	822.51	15,100,461.09
UNITED RENTALS INC	23,430	349.02	8,177,538.60
WABTEC CORP	63,893	97.41	6,223,817.13
WW GRAINGER INC	15,533	681.78	10,590,088.74
XYLEM INC	65,664	104.99	6,894,063.36
AUTOMATIC DATA PROCESSING	145,185	216.18	31,386,093.30
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	46,380	92.66	4,297,570.80
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	43,508	153.27	6,668,471.16
CERIDIAN HCM HOLDING INC	46,280	61.55	2,848,534.00
CINTAS CORP	32,315	470.48	15,203,561.20
CLARIVATE PLC	115,796	7.31	846,468.76
COPART INC	152,925	88.24	13,494,102.00
COSTAR GROUP INC	139,906	78.50	10,982,621.00

EQUIFAX INC	41,823	210.12	8,787,848.76
JACOBS SOLUTIONS INC	46,966	116.93	5,491,734.38
LEIDOS HOLDINGS INC	42,946	78.40	3,366,966.40
PAYCHEX INC	116,279	108.11	12,570,922.69
PAYCOM SOFTWARE INC	16,897	285.36	4,821,727.92
PAYLOCITY HOLDING CORP	13,942	173.77	2,422,701.34
REPUBLIC SERVICES INC	75,957	145.09	11,020,601.13
ROBERT HALF INTL INC	38,389	68.36	2,624,272.04
ROLLINS INC	79,141	41.05	3,248,738.05
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	80,381	56.20	4,517,412.20
TRANSUNION	63,235	70.65	4,467,552.75
VERISK ANALYTICS INC	53,789	222.12	11,947,612.68
WASTE CONNECTIONS INC	87,590	140.30	12,288,877.00
WASTE MANAGEMENT INC	143,778	165.36	23,775,130.08
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	40,475	100.43	4,064,904.25
CSX CORP	737,605	32.31	23,832,017.55
DELTA AIR LINES INC	53,589	35.59	1,907,232.51
EXPEDITORS INTL WASH INC	58,036	114.57	6,649,184.52
FEDEX CORP	86,793	229.08	19,882,540.44
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	367,326	2.75	1,011,983.13
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	28,551	168.37	4,807,131.87
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	49,106	54.59	2,680,696.54
NORFOLK SOUTHERN CORP	81,806	217.74	17,812,438.44
OLD DOMINION FREIGHT LINE	32,010	301.41	9,648,134.10
SOUTHWEST AIRLINES CO	50,383	29.48	1,485,290.84
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	27,432	56.04	1,537,289.28
UBER TECHNOLOGIES INC	524,409	39.18	20,546,344.62
UNION PACIFIC CORP	215,281	198.97	42,834,460.57
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	255,467	170.93	43,666,974.31
APTIV PLC	93,079	94.37	8,783,865.23
BORGWARNER INC	78,768	46.15	3,635,143.20
FORD MOTOR CO	1,394,215	11.65	16,242,604.75
GENERAL MOTORS CO	501,080	32.66	16,365,272.80
LEAR CORP	20,206	125.06	2,526,962.36
LUCID GROUP INC	173,075	7.18	1,242,678.50
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	108,400	13.47	1,460,148.00
TESLA INC	939,557	180.14	169,251,797.98
DR HORTON INC	116,867	110.19	12,877,574.73
GARMIN LTD	53,987	104.00	5,614,648.00
HASBRO INC	42,578	60.32	2,568,304.96
LENNAR CORP-A	90,104	113.59	10,234,913.36
LULULEMON ATHLETICA INC	41,156	368.53	15,167,220.68

MOHAWK INDUSTRIES INC	16,546	96.57	1,597,847.22
NEWELL BRANDS INC	130,633	8.69	1,135,200.77
NIKE INC -CL B	441,023	114.76	50,611,799.48
NVR INC	1,054	5,846.52	6,162,232.08
PULTEGROUP INC	76,342	69.18	5,281,339.56
VF CORP	121,637	19.07	2,319,617.59
WHIRLPOOL CORP	20,470	131.43	2,690,372.10
AIRBNB INC-CLASS A	134,092	107.38	14,398,798.96
ARAMARK	92,322	39.54	3,650,411.88
BOOKING HOLDINGS INC	13,589	2,765.26	37,577,118.14
CAESARS ENTERTAINMENT INC	83,424	43.79	3,653,136.96
CARNIVAL CORP	322,950	10.94	3,533,073.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	9,719	2,106.22	20,470,352.18
DARDEN RESTAURANTS INC	41,711	161.41	6,732,572.51
DOMINO'S PIZZA INC	12,458	312.46	3,892,626.68
DOORDASH INC - A	87,546	66.98	5,863,831.08
EXPEDIA GROUP INC	53,423	96.63	5,162,264.49
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	92,759	144.18	13,373,992.62
LAS VEGAS SANDS CORP	118,255	60.49	7,153,244.95
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	94,710	178.43	16,899,105.30
MCDONALD'S CORP	256,068	295.55	75,680,897.40
MGM RESORTS INTERNATIONAL	104,054	42.48	4,420,213.92
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	79,355	79.60	6,316,658.00
STARBUCKS CORP	401,700	105.51	42,383,367.00
VAIL RESORTS INC	15,589	242.84	3,785,632.76
WYNN RESORTS LTD	38,455	110.28	4,240,817.40
YUM! BRANDS INC	99,990	138.28	13,826,617.20
ACTIVISION BLIZZARD INC	273,828	78.59	21,520,142.52
ALPHABET INC-CL A	2,089,954	122.76	256,562,753.04
ALPHABET INC-CL C	1,917,465	123.25	236,327,561.25
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	38,977	340.40	13,267,770.80
COMCAST CORP-CLASS A	1,510,260	41.18	62,192,506.80
DISH NETWORK CORP-A	84,434	6.70	565,707.80
ELECTRONIC ARTS INC	99,031	125.66	12,444,235.46
FOX CORP - CLASS A	116,915	31.34	3,664,116.10
FOX CORP - CLASS B	50,847	28.92	1,470,495.24
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	128,763	38.58	4,967,676.54
LIBERTY BROADBAND-C	43,606	77.54	3,381,209.24
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	22,942	28.16	646,046.72
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	50,965	28.07	1,430,587.55
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	65,129	73.31	4,774,606.99
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	57,466	84.73	4,869,094.18

MATCH GROUP INC	111,183	31.84	3,540,066.72
META PLATFORMS INC-CLASS A	787,011	245.64	193,321,382.04
NETFLIX INC	155,788	365.36	56,918,703.68
NEWS CORP - CLASS A	130,626	18.58	2,427,031.08
OMNICOM GROUP	69,272	93.30	6,463,077.60
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	217,553	15.17	3,300,279.01
PINTEREST INC- CLASS A	199,346	22.70	4,525,154.20
ROBLOX CORP -CLASS A	134,525	40.01	5,382,345.25
ROKU INC	38,981	52.61	2,050,790.41
SEA LTD-ADR	124,778	69.44	8,664,584.32
SIRIUS XM HOLDINGS INC	234,669	3.53	828,381.57
SNAP INC - A	350,310	9.72	3,405,013.20
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	60,511	137.43	8,316,026.73
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	151,975	66.82	10,154,969.50
WALT DISNEY CO/THE	638,316	91.35	58,310,166.60
WARNER BROS DISCOVERY INC	840,963	12.20	10,259,748.60
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	90,161	23.99	2,162,962.39
ADVANCE AUTO PARTS INC	19,129	117.41	2,245,935.89
AMAZON.COM INC	3,213,639	116.25	373,585,533.75
AUTOZONE INC	6,674	2,653.18	17,707,323.32
BATH & BODY WORKS INC	84,151	37.03	3,116,111.53
BEST BUY CO INC	70,326	70.53	4,960,092.78
BURLINGTON STORES INC	21,172	167.88	3,554,355.36
CARMAX INC	59,634	71.75	4,278,739.50
CHEWY INC - CLASS A	31,027	31.64	981,694.28
EBAY INC	183,310	43.48	7,970,318.80
ETSY INC	41,138	89.10	3,665,395.80
GENUINE PARTS CO	48,177	164.77	7,938,124.29
HOME DEPOT INC	356,946	290.88	103,828,452.48
LKQ CORP	89,808	55.76	5,007,694.08
LOWE'S COS INC	212,037	206.27	43,736,871.99
MERCADOLIBRE INC	15,867	1,310.88	20,799,732.96
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	21,975	954.30	20,970,742.50
POOL CORP	12,964	345.05	4,473,228.20
ROSS STORES INC	125,208	104.76	13,116,790.08
TJX COMPANIES INC	407,056	79.35	32,299,893.60
TRACTOR SUPPLY COMPANY	39,195	224.23	8,788,694.85
ULTA BEAUTY INC	17,726	491.05	8,704,352.30
COSTCO WHOLESALE CORP	154,964	496.52	76,942,725.28
DOLLAR GENERAL CORP	79,406	215.08	17,078,642.48
DOLLAR TREE INC	75,692	160.08	12,116,775.36
KROGER CO	245,864	49.64	12,204,688.96

SYSCO CORP	180,836	73.13	13,224,536.68
TARGET CORP	161,438	152.28	24,583,778.64
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	255,139	31.28	7,980,747.92
WALMART INC	522,418	149.91	78,315,682.38
ALTRIA GROUP INC	625,920	45.30	28,354,176.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	195,276	73.23	14,300,061.48
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	105,095	63.70	6,694,551.50
BUNGE LTD	57,018	90.45	5,157,278.10
CAMPBELL SOUP CO	80,441	52.68	4,237,631.88
COCA-COLA CO/THE	1,434,040	62.83	90,100,733.20
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	66,711	65.76	4,386,915.36
CONAGRA BRANDS INC	178,189	35.84	6,386,293.76
CONSTELLATION BRANDS INC-A	59,373	235.29	13,969,873.17
DARLING INGREDIENTS INC	52,560	64.82	3,406,939.20
GENERAL MILLS INC	208,647	87.63	18,283,736.61
HERSHEY CO/THE	52,460	266.04	13,956,458.40
HORMEL FOODS CORP	104,570	39.34	4,113,783.80
JM SMUCKER CO/THE	37,304	151.89	5,666,104.56
KELLOGG CO	94,905	69.33	6,579,763.65
KEURIG DR PEPPER INC	268,712	31.83	8,553,102.96
KRAFT HEINZ CO/THE	252,403	39.07	9,861,385.21
LAMB WESTON HOLDINGS INC	52,797	114.48	6,044,200.56
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	85,069	88.92	7,564,335.48
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	62,806	62.61	3,932,283.66
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	475,732	77.06	36,659,907.92
MONSTER BEVERAGE CORP	276,462	59.68	16,499,252.16
PEPSICO INC	480,764	191.84	92,229,765.76
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	541,564	93.19	50,468,349.16
TYSON FOODS INC-CL A	99,095	49.96	4,950,786.20
CHURCH & DWIGHT CO INC	82,599	95.03	7,849,382.97
CLOROX COMPANY	44,784	166.36	7,450,266.24
COLGATE-PALMOLIVE CO	277,208	79.93	22,157,235.44
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	81,772	199.88	16,344,587.36
KIMBERLY-CLARK CORP	119,148	145.03	17,280,034.44
PROCTER & GAMBLE CO/THE	828,983	153.17	126,975,326.11
ABBOTT LABORATORIES	609,322	108.93	66,373,445.46
ALIGN TECHNOLOGY INC	25,443	290.99	7,403,658.57
AMERISOURCEBERGEN CORP	53,705	173.39	9,311,909.95
BAXTER INTERNATIONAL INC	174,039	42.99	7,481,936.61
BECTON DICKINSON AND CO	98,762	251.88	24,876,172.56
BOSTON SCIENTIFIC CORP	498,693	53.64	26,749,892.52
CARDINAL HEALTH INC	89,557	85.93	7,695,633.01

CENTENE CORP	202,732	65.40	13,258,672.80
COOPER COS INC/THE	16,931	386.10	6,537,059.10
CVS HEALTH CORP	459,419	69.38	31,874,490.22
DAVITA INC	16,659	100.33	1,671,397.47
DENTSPLY SIRONA INC	77,655	40.19	3,120,954.45
DEXCOM INC	136,271	117.13	15,961,422.23
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	216,400	87.93	19,028,052.00
ELEVANCE HEALTH INC	83,407	457.83	38,186,226.81
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	123,457	79.34	9,795,078.38
HCA HEALTHCARE INC	74,252	282.47	20,973,962.44
HENRY SCHEIN INC	47,391	76.92	3,645,315.72
HOLOGIC INC	84,542	81.43	6,884,255.06
HUMANA INC	44,170	513.52	22,682,178.40
IDEXX LABORATORIES INC	29,446	488.10	14,372,592.60
INSULET CORP	23,701	301.03	7,134,712.03
INTUITIVE SURGICAL INC	123,495	313.61	38,729,266.95
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	32,185	216.82	6,978,351.70
MASIMO CORP	16,542	163.46	2,703,955.32
MCKESSON CORP	49,699	397.67	19,763,801.33
MEDTRONIC PLC	464,552	89.33	41,498,430.16
MOLINA HEALTHCARE INC	21,626	285.17	6,167,086.42
NOVOCURE LTD	30,832	79.45	2,449,602.40
QUEST DIAGNOSTICS INC	42,458	131.49	5,582,802.42
RESMED INC	52,417	224.51	11,768,140.67
STERIS PLC	34,015	205.70	6,996,885.50
STRYKER CORP	118,796	285.37	33,900,814.52
TELEFLEX INC	17,954	243.78	4,376,826.12
THE CIGNA GROUP	106,813	255.13	27,251,200.69
UNITEDHEALTH GROUP INC	326,731	478.82	156,445,337.42
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	20,248	134.63	2,725,988.24
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	47,565	165.35	7,864,872.75
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	72,643	135.00	9,806,805.00
ABBVIE INC	618,865	145.11	89,803,500.15
AGILENT TECHNOLOGIES INC	105,244	128.87	13,562,794.28
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	42,810	190.74	8,165,579.40
AMGEN INC	186,723	223.42	41,717,652.66
AVANTOR INC	251,640	20.95	5,271,858.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	8,004	382.14	3,058,648.56
BIO-TECHNE CORP	54,867	83.88	4,602,243.96
BIOGEN INC	51,000	308.48	15,732,480.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	63,356	91.90	5,822,416.40
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	742,724	65.84	48,900,948.16

CATALENT INC	56,121	37.17	2,086,017.57
CHARLES RIVER LABORATORIES	18,126	198.33	3,594,929.58
DANAHER CORP	241,814	228.33	55,213,390.62
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	148,648	8.51	1,264,994.48
ELI LILLY & CO	282,526	442.38	124,983,851.88
EXACT SCIENCES CORP	65,656	83.18	5,461,266.08
GILEAD SCIENCES INC	438,901	78.84	34,605,149.34
HORIZON THERAPEUTICS PLC	73,767	100.75	7,432,025.25
ILLUMINA INC	56,880	204.86	11,652,436.80
INCYTE CORP	66,688	63.57	4,239,356.16
IQVIA HOLDINGS INC	66,737	199.44	13,310,027.28
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	20,987	134.27	2,817,924.49
JOHNSON & JOHNSON	913,928	158.91	145,232,298.48
MERCK & CO. INC.	886,431	115.49	102,373,916.19
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	8,071	1,386.47	11,190,199.37
MODERNA INC	115,841	126.24	14,623,767.84
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	31,737	94.06	2,985,182.22
PFIZER INC	1,963,567	36.77	72,200,358.59
REGENERON PHARMACEUTICALS	37,505	759.05	28,468,170.25
REPLIGEN CORP	17,444	159.25	2,777,957.00
REVVITY INC	47,205	119.09	5,621,643.45
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	125,527	33.71	4,231,515.17
SEAGEN INC	48,071	193.30	9,292,124.30
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	360,337	7.91	2,850,265.67
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	137,125	527.38	72,316,982.50
UNITED THERAPEUTICS CORP	15,000	219.56	3,293,400.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	89,904	341.70	30,720,196.80
VIATRIS INC	431,866	9.33	4,029,309.78
WATERS CORP	21,957	267.48	5,873,058.36
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	25,323	351.39	8,898,248.97
ZOETIS INC	162,837	179.55	29,237,383.35
BANK OF AMERICA CORP	2,525,039	28.11	70,978,846.29
CITIGROUP INC	676,607	45.71	30,927,705.97
CITIZENS FINANCIAL GROUP	171,073	26.18	4,478,691.14
FIFTH THIRD BANCORP	236,722	25.10	5,941,722.20
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	3,794	1,306.03	4,955,077.82
FIRST HORIZON CORP	173,558	10.88	1,888,311.04
HUNTINGTON BANCSHARES INC	505,449	10.17	5,140,416.33
JPMORGAN CHASE & CO	1,025,918	139.18	142,787,267.24
KEYCORP	306,076	9.82	3,005,666.32
M & T BANK CORP	60,159	121.61	7,315,935.99
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	142,924	118.48	16,933,635.52

REGIONS FINANCIAL CORP	348,054	16.86	5,868,190.44
TRUIST FINANCIAL CORP	475,419	29.70	14,119,944.30
US BANCORP	501,521	30.11	15,100,797.31
WEBSTER FINANCIAL CORP	57,805	35.94	2,077,511.70
WELLS FARGO & CO	1,332,219	40.03	53,328,726.57
ALLY FINANCIAL INC	120,850	26.43	3,194,065.50
AMERICAN EXPRESS CO	222,121	152.95	33,973,406.95
AMERIPRISE FINANCIAL INC	36,365	303.87	11,050,232.55
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	185,468	19.16	3,553,566.88
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	138,965	63.85	8,872,915.25
ARES MANAGEMENT CORP - A	51,159	83.64	4,278,938.76
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	277,655	40.89	11,353,312.95
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	455,391	330.39	150,456,632.49
BLACKROCK INC	52,550	666.70	35,035,085.00
BLACKSTONE INC	246,070	83.08	20,443,495.60
BLOCK INC	182,870	58.65	10,725,325.50
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	129,860	97.93	12,717,189.80
CARLYLE GROUP INC/THE	60,998	27.30	1,665,245.40
CBOE GLOBAL MARKETS INC	35,152	138.97	4,885,073.44
CME GROUP INC	125,711	181.82	22,856,774.02
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	41,300	56.78	2,345,014.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	93,741	100.74	9,443,468.34
EQUITABLE HOLDINGS INC	136,406	24.50	3,341,947.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	14,108	396.19	5,589,448.52
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	214,014	56.84	12,164,555.76
FISERV INC	210,703	119.54	25,187,436.62
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	26,196	233.65	6,120,695.40
FRANKLIN RESOURCES INC	95,796	24.49	2,346,044.04
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	20,000	38.09	761,800.00
GLOBAL PAYMENTS INC	91,798	101.96	9,359,724.08
GOLDMAN SACHS GROUP INC	118,383	326.15	38,610,615.45
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	195,422	108.03	21,111,438.66
INVESCO LTD	115,882	15.24	1,766,041.68
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	24,225	148.80	3,604,680.00
KKR & CO INC	191,878	50.03	9,599,656.34
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	29,742	197.98	5,888,321.16
MARKETAXESS HOLDINGS INC	12,374	284.59	3,521,516.66
MASTERCARD INC - A	300,266	385.57	115,773,561.62
MOODY'S CORP	58,034	315.03	18,282,451.02
MORGAN STANLEY	443,056	82.24	36,436,925.44
MSCI INC	28,527	469.84	13,403,125.68
NASDAQ INC	117,506	55.32	6,500,431.92

NORTHERN TRUST CORP	68,340	72.20	4,934,148.00
PAYPAL HOLDINGS INC	379,160	60.92	23,098,427.20
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	66,129	90.23	5,966,819.67
S&P GLOBAL INC	116,361	365.42	42,520,636.62
SCHWAB (CHARLES) CORP	508,742	51.67	26,286,699.14
SEI INVESTMENTS COMPANY	39,270	57.92	2,274,518.40
STATE STREET CORP	126,012	68.00	8,568,816.00
SYNCHRONY FINANCIAL	154,684	30.02	4,643,613.68
T ROWE PRICE GROUP INC	77,974	106.61	8,312,808.14
TOAST INC-CLASS A	105,437	20.81	2,194,143.97
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	37,148	69.89	2,596,273.72
VISA INC-CLASS A SHARES	569,527	233.31	132,876,344.37
AFLAC INC	211,048	66.88	14,114,890.24
ALLSTATE CORP	95,804	117.78	11,283,795.12
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	23,305	117.17	2,730,646.85
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	265,156	53.85	14,278,650.60
AON PLC-CLASS A	72,362	327.12	23,671,057.44
ARCH CAPITAL GROUP LTD	128,199	76.02	9,745,687.98
ARTHUR J GALLAGHER & CO	74,409	216.07	16,077,552.63
ASSURANT INC	18,269	128.98	2,356,335.62
BROWN & BROWN INC	83,573	66.36	5,545,904.28
CHUBB LTD	145,402	201.18	29,251,974.36
CINCINNATI FINANCIAL CORP	51,694	104.96	5,425,802.24
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	9,638	228.37	2,201,030.06
EVEREST RE GROUP LTD	14,562	376.47	5,482,156.14
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	86,645	34.75	3,010,913.75
GLOBE LIFE INC	30,200	108.28	3,270,056.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	110,821	71.23	7,893,779.83
LOEWS CORP	65,826	58.80	3,870,568.80
MARKEL CORP	4,594	1,359.37	6,244,945.78
MARSH & MCLENNAN COS	173,392	180.54	31,304,191.68
METLIFE INC	239,400	51.58	12,348,252.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	82,864	69.42	5,752,418.88
PROGRESSIVE CORP	204,758	135.06	27,654,615.48
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	133,696	82.04	10,968,419.84
TRAVELERS COS INC/THE	83,045	183.72	15,257,027.40
WILLIS TOWERS WATSON PLC	37,225	229.67	8,549,465.75
WR BERKLEY CORP	70,051	57.65	4,038,440.15
ACCENTURE PLC-CL A	220,208	289.91	63,840,501.28
ADOBE INC	162,535	371.25	60,341,118.75
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	54,596	87.27	4,764,592.92
ANSYS INC	29,425	305.56	8,991,103.00

ASPEN TECHNOLOGY INC	10,737	169.11	1,815,734.07
ATLASSIAN CORP-CL A	51,839	146.99	7,619,814.61
AUTODESK INC	76,613	200.89	15,390,785.57
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	61,932	46.06	2,852,587.92
BILL HOLDINGS INC	36,094	94.66	3,416,658.04
BLACK KNIGHT INC	51,474	55.62	2,862,983.88
CADENCE DESIGN SYS INC	96,123	216.71	20,830,815.33
CHECK POINT SOFTWARE TECH	33,201	121.42	4,031,265.42
CLOUDFLARE INC - CLASS A	84,516	57.99	4,901,082.84
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	176,097	63.01	11,095,871.97
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	74,368	144.72	10,762,536.96
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	14,727	152.96	2,252,641.92
DATADOG INC - CLASS A	86,065	92.09	7,925,725.85
DOCUSIGN INC	70,528	53.12	3,746,447.36
DROPBOX INC-CLASS A	105,421	22.69	2,392,002.49
DYNATRACE INC	71,672	49.03	3,514,078.16
EPAM SYSTEMS INC	20,043	247.50	4,960,642.50
FAIR ISAAC CORP	9,075	755.79	6,858,794.25
FORTINET INC	235,042	69.63	16,365,974.46
GARTNER INC	26,705	330.77	8,833,212.85
GEN DIGITAL INC	212,134	16.20	3,436,570.80
GODADDY INC - CLASS A	50,548	71.54	3,616,203.92
HUBSPOT INC	16,061	480.51	7,717,471.11
INTL BUSINESS MACHINES CORP	315,945	127.26	40,207,160.70
INTUIT INC	93,179	446.03	41,560,629.37
MICROSOFT CORP	2,478,257	318.34	788,928,333.38
MONGODB INC	25,298	275.18	6,961,503.64
OKTA INC	53,584	82.15	4,401,925.60
ORACLE CORP	565,527	102.84	58,158,796.68
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	586,176	11.71	6,864,120.96
PALO ALTO NETWORKS INC	105,781	188.66	19,956,643.46
PTC INC	41,853	134.21	5,617,091.13
ROPER TECHNOLOGIES INC	37,356	457.72	17,098,588.32
SALESFORCE INC	349,658	210.36	73,554,056.88
SERVICENOW INC	70,694	510.30	36,075,148.20
SNOWFLAKE INC-CLASS A	80,881	176.82	14,301,378.42
SPLUNK INC	53,603	96.23	5,158,216.69
SYNOPSYS INC	53,546	408.50	21,873,541.00
TWILIO INC - A	58,401	51.21	2,990,715.21
TYLER TECHNOLOGIES INC	15,174	394.04	5,979,162.96
UNITY SOFTWARE INC	81,932	29.10	2,384,221.20
VERISIGN INC	32,791	227.41	7,457,001.31

VMWARE INC-CLASS A	73,008	125.74	9,180,025.92
WIX.COM LTD	21,919	78.09	1,711,654.71
WORKDAY INC-CLASS A	72,049	195.71	14,100,709.79
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	76,191	69.37	5,285,369.67
ZSCALER INC	28,648	125.27	3,588,734.96
AMPHENOL CORP-CL A	209,585	75.80	15,886,543.00
APPLE INC	5,567,367	175.16	975,180,003.72
ARISTA NETWORKS INC	87,671	143.91	12,616,733.61
ARROW ELECTRONICS INC	22,422	123.22	2,762,838.84
CDW CORP/DE	47,028	172.59	8,116,562.52
CISCO SYSTEMS INC	1,432,259	49.13	70,366,884.67
COGNEX CORP	56,700	53.00	3,005,100.00
CORNING INC	293,702	31.32	9,198,746.64
DELL TECHNOLOGIES -C	97,496	47.75	4,655,434.00
F5 INC	20,124	142.53	2,868,273.72
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	470,924	14.33	6,748,340.92
HP INC	342,009	30.54	10,444,954.86
JUNIPER NETWORKS INC	105,432	29.54	3,114,461.28
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	65,111	157.19	10,234,798.09
MOTOROLA SOLUTIONS INC	58,930	297.45	17,528,728.50
NETAPP INC	71,581	65.82	4,711,461.42
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	70,258	62.26	4,374,263.08
TE CONNECTIVITY LTD	113,158	124.08	14,040,644.64
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	16,214	416.26	6,749,239.64
TRIMBLE INC	81,451	47.86	3,898,244.86
WESTERN DIGITAL CORP	104,789	38.32	4,015,514.48
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	18,052	280.80	5,069,001.60
AT&T INC	2,493,992	16.31	40,677,009.52
LIBERTY GLOBAL PLC- C	82,999	17.81	1,478,212.19
LIBERTY GLOBAL PLC-A	55,653	17.00	946,101.00
T-MOBILE US INC	217,331	139.03	30,215,528.93
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,469,223	36.05	52,965,489.15
AES CORP	236,364	20.81	4,918,734.84
ALLIANT ENERGY CORP	87,688	52.61	4,613,265.68
AMEREN CORPORATION	92,575	84.12	7,787,409.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	181,349	86.56	15,697,569.44
AMERICAN WATER WORKS CO INC	70,014	141.45	9,903,480.30
ATMOS ENERGY CORP	49,123	116.56	5,725,776.88
CENTERPOINT ENERGY INC	214,951	28.59	6,145,449.09
CMS ENERGY CORP	100,621	58.63	5,899,409.23
CONSOLIDATED EDISON INC	127,009	95.19	12,089,986.71
CONSTELLATION ENERGY	113,055	82.30	9,304,426.50

DOMINION ENERGY INC	294,826	52.12	15,366,331.12
DTE ENERGY COMPANY	69,910	108.56	7,589,429.60
DUKE ENERGY CORP	268,882	92.51	24,874,273.82
EDISON INTERNATIONAL	131,955	68.24	9,004,609.20
ENTERGY CORP	73,191	100.55	7,359,355.05
ESSENTIAL UTILITIES INC	83,324	40.25	3,353,791.00
EVERGY INC	80,215	59.28	4,755,145.20
EVERSOURCE ENERGY	120,162	73.17	8,792,253.54
EXELON CORP	352,321	39.87	14,047,038.27
FIRSTENERGY CORP	195,855	37.76	7,395,484.80
NEXTERA ENERGY INC	694,972	74.48	51,761,514.56
NISOURCE INC	135,740	27.36	3,713,846.40
NRG ENERGY INC	77,774	33.49	2,604,651.26
P G & E CORP	506,057	16.61	8,405,606.77
PPL CORP	265,319	27.06	7,179,532.14
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	170,815	61.58	10,518,787.70
SEMPRA ENERGY	110,773	145.82	16,152,918.86
SOUTHERN CO/THE	380,294	71.41	27,156,794.54
UGI CORP	77,644	28.03	2,176,361.32
VISTRA CORP	119,689	24.51	2,933,577.39
WEC ENERGY GROUP INC	108,126	89.92	9,722,689.92
XCEL ENERGY INC	195,612	65.93	12,896,699.16
ADVANCED MICRO DEVICES	564,196	105.82	59,703,220.72
ANALOG DEVICES INC	177,665	190.53	33,850,512.45
APPLIED MATERIALS INC	300,074	126.95	38,094,394.30
BROADCOM INC	145,823	682.25	99,487,741.75
ENPHASE ENERGY INC	45,983	162.37	7,466,259.71
ENTEGRIS INC	53,642	96.78	5,191,472.76
FIRST SOLAR INC	32,904	203.53	6,696,951.12
INTEL CORP	1,443,910	29.93	43,216,226.30
KLA CORP	49,686	423.64	21,048,977.04
LAM RESEARCH CORP	47,597	588.86	28,027,969.42
MARVELL TECHNOLOGY INC	306,994	45.46	13,955,947.24
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	195,214	77.87	15,201,314.18
MICRON TECHNOLOGY INC	380,504	68.17	25,938,957.68
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	15,407	432.02	6,656,132.14
NVIDIA CORP	860,930	312.64	269,161,155.20
NXP SEMICONDUCTORS NV	91,824	174.96	16,065,527.04
ON SEMICONDUCTOR	147,518	84.36	12,444,618.48
QORVO INC	33,116	95.04	3,147,344.64
QUALCOMM INC	392,045	105.86	41,501,883.70
SKYWORKS SOLUTIONS INC	55,375	101.66	5,629,422.50

	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	19,580	295.92	5,794,113.60	
	TERADYNE INC	52,994	97.10	5,145,717.40	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	316,910	170.11	53,909,560.10	
	WOLFSPEED INC	40,925	44.03	1,801,927.75	
	CBRE GROUP INC - A	107,372	77.28	8,297,708.16	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	356,100	4.34	1,545,474.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	51,785	45.39	2,350,521.15	
	アメリカドル 小計	118,350,138		12,669,394,635.55 (1,744,829,029,207)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	248,300	17.80	4,419,740.00	
	CAMECO CORP	142,600	36.37	5,186,362.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	389,100	77.06	29,984,046.00	
	CENOVUS ENERGY INC	497,400	22.29	11,087,046.00	
	ENBRIDGE INC	708,500	50.07	35,474,595.00	
	IMPERIAL OIL LTD	75,500	63.27	4,776,885.00	
	KEYERA CORP	76,700	31.18	2,391,506.00	
	PARKLAND CORP	42,600	34.30	1,461,180.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	193,232	42.04	8,123,473.28	
	SUNCOR ENERGY INC	481,600	38.83	18,700,528.00	
	TC ENERGY CORP	359,300	54.36	19,531,548.00	
	TOURMALINE OIL CORP	121,700	60.68	7,384,756.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	177,140	73.07	12,943,619.80	
	BARRICK GOLD CORP	605,600	24.13	14,613,128.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	50,500	70.68	3,569,340.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	221,900	31.67	7,027,573.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	66,400	206.80	13,731,520.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	193,100	11.24	2,170,444.00	
	KINROSS GOLD CORP	392,200	6.97	2,733,634.00	
	LUNDIN MINING CORP	222,100	10.63	2,360,923.00	
	NUTRIEN LTD	187,759	83.73	15,721,061.07	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	125,900	21.23	2,672,857.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	155,300	57.32	8,901,796.00	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	18,200	101.88	1,854,216.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	153,000	64.94	9,935,820.00	
	CAE INC	97,800	30.10	2,943,780.00	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	28,300	112.70	3,189,410.00	
	WSP GLOBAL INC	44,300	174.90	7,748,070.00	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	62,000	50.37	3,122,940.00	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	57,700	75.61	4,362,697.00	
	THOMSON REUTERS CORP	60,632	170.13	10,315,322.16	
	AIR CANADA	62,200	21.81	1,356,582.00	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	201,100	161.39	32,455,529.00	

CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	325,400	111.58	36,308,132.00
TFI INTERNATIONAL INC	25,900	147.22	3,812,998.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	102,300	71.25	7,288,875.00
BRP INC/CA- SUB VOTING	15,700	100.52	1,578,164.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	57,100	39.55	2,258,305.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	100,710	98.97	9,967,268.70
QUEBECOR INC -CL B	55,600	34.67	1,927,652.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	19,100	169.53	3,238,023.00
DOLLARAMA INC	95,100	84.51	8,036,901.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	287,800	66.01	18,997,678.00
EMPIRE CO LTD 'A'	55,300	35.48	1,962,044.00
LOBLAW COMPANIES LTD	56,300	122.98	6,923,774.00
METRO INC/CN	84,000	75.20	6,316,800.00
WESTON (GEORGE) LTD	25,711	168.80	4,340,016.80
SAPUTO INC	95,600	36.21	3,461,676.00
BANK OF MONTREAL	237,200	117.98	27,984,856.00
BANK OF NOVA SCOTIA	417,700	66.53	27,789,581.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	325,000	56.14	18,245,500.00
NATIONAL BANK OF CANADA	119,900	102.72	12,316,128.00
ROYAL BANK OF CANADA	481,300	127.19	61,216,547.00
TORONTO-DOMINION BANK	630,900	82.27	51,904,143.00
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	135,688	42.14	5,717,892.32
BROOKFIELD CORP	503,450	41.63	20,958,623.50
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	162,400	20.30	3,296,720.00
IGM FINANCIAL INC	20,700	39.05	808,335.00
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	17,800	43.46	773,588.00
ONEX CORPORATION	24,300	59.36	1,442,448.00
TMX GROUP LTD	19,600	146.71	2,875,516.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	8,400	969.46	8,143,464.00
GREAT-WEST LIFECO INC	86,000	39.05	3,358,300.00
IA FINANCIAL CORP INC	34,100	86.87	2,962,267.00
INTACT FINANCIAL CORP	59,500	203.60	12,114,200.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	674,600	26.14	17,634,044.00
POWER CORP OF CANADA	188,300	35.68	6,718,544.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	201,900	67.18	13,563,642.00
CGI INC	76,000	141.61	10,762,360.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	7,200	2,729.36	19,651,392.00
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	29,200	105.43	3,078,556.00
OPEN TEXT CORP	91,800	56.18	5,157,324.00
SHOPIFY INC - CLASS A	416,800	81.31	33,890,008.00
BCE INC	22,600	63.43	1,433,518.00
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	123,300	65.92	8,127,936.00

	TELUS CORP	145,100	27.38	3,972,838.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	241,500	11.44	2,762,760.00	
	ALTAGAS LTD	94,600	23.42	2,215,532.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	39,350	47.19	1,856,926.50	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	38,000	38.02	1,444,760.00	
	EMERA INC	89,100	57.00	5,078,700.00	
	FORTIS INC	164,000	58.65	9,618,600.00	
	HYDRO ONE LTD	110,100	39.12	4,307,112.00	
	NORTHLAND POWER INC	79,600	29.80	2,372,080.00	
	FIRSTSERVICE CORP	13,900	199.43	2,772,077.00	
	カナダドル 小計	14,052,172		846,997,053.13 (86,461,459,183)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	82,331	30.96	2,548,967.76	
	SANTOS LTD	1,045,835	7.24	7,571,845.40	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	64,847	33.72	2,186,640.84	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	671,153	34.24	22,980,278.72	
	BHP GROUP LTD	1,774,595	44.16	78,366,115.20	
	BLUESCOPE STEEL LTD	157,082	19.33	3,036,395.06	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	574,706	20.52	11,792,967.12	
	IGO LTD	231,962	15.01	3,481,749.62	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	147,510	37.81	5,577,353.10	
	MINERAL RESOURCES LTD	62,759	76.02	4,770,939.18	
	NEWCREST MINING LTD	330,667	27.00	8,928,009.00	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	444,480	13.31	5,916,028.80	
	ORICA LTD	158,310	15.65	2,477,551.50	
	PILBARA MINERALS LTD	924,776	4.99	4,614,632.24	
	RIO TINTO LTD	125,567	109.42	13,739,541.14	
	SOUTH32 LTD	1,507,938	4.06	6,122,228.28	
	REECE LTD	81,800	18.38	1,503,484.00	
	BRAMBLES LTD	460,976	14.48	6,674,932.48	
	COMPUTERSHARE LTD	216,679	22.07	4,782,105.53	
	AURIZON HOLDINGS LTD	607,049	3.53	2,142,882.97	
	QANTAS AIRWAYS LTD	318,258	6.52	2,075,042.16	
	TRANSURBAN GROUP	1,064,099	14.62	15,557,127.38	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	196,842	38.50	7,578,417.00	
	IDP EDUCATION LTD	66,233	27.00	1,788,291.00	
	LOTTERY CORP LTD/THE	820,014	4.97	4,075,469.58	
	REA GROUP LTD	16,523	139.94	2,312,228.62	
	SEEK LTD	111,070	24.37	2,706,775.90	
	WESFARMERS LTD	405,622	51.17	20,755,677.74	
	COLES GROUP LTD	465,135	18.19	8,460,805.65	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	449,953	6.34	2,852,702.02	

	WOOLWORTHS GROUP LTD	415,153	38.25	15,879,602.25	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	245,838	13.25	3,257,353.50	
	COCHLEAR LTD	23,404	247.99	5,803,957.96	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	66,537	60.36	4,016,173.32	
	SONIC HEALTHCARE LTD	163,646	35.93	5,879,800.78	
	CSL LTD	168,730	304.45	51,369,848.50	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	1,051,257	23.97	25,198,630.29	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	592,435	99.80	59,125,013.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,102,587	26.80	29,549,331.60	
	WESTPAC BANKING CORP	1,229,946	21.23	26,111,753.58	
	ASX LTD	70,918	67.89	4,814,623.02	
	MACQUARIE GROUP LTD	129,694	176.51	22,892,287.94	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	976,867	5.19	5,069,939.73	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	936,375	3.52	3,296,040.00	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	488,602	14.59	7,128,703.18	
	SUNCORP GROUP LTD	489,744	12.62	6,180,569.28	
	WISETECH GLOBAL LTD	55,637	71.20	3,961,354.40	
	XERO LTD	54,063	108.00	5,838,804.00	
	TELSTRA GROUP LTD	1,329,461	4.37	5,809,744.57	
	APA GROUP	397,094	10.20	4,050,358.80	
	ORIGIN ENERGY LTD	664,805	8.32	5,531,177.60	
	LENDLEASE GROUP	244,789	7.93	1,941,176.77	
	オーストラリアドル 小計	24,482,353		570,083,429.06 (52,310,855,450)	
イギリスポンド	BP PLC	6,126,750	4.81	29,494,174.50	
	SHELL PLC	2,385,189	24.09	57,459,203.01	
	ANGLO AMERICAN PLC	431,835	23.50	10,148,122.50	
	ANTOFAGASTA PLC	124,065	14.16	1,757,380.72	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	45,330	63.18	2,863,949.40	
	GLENCORE PLC	3,486,306	4.34	15,161,944.79	
	JOHNSON MATTHEY PLC	58,854	18.88	1,111,457.79	
	MONDI PLC	161,979	12.85	2,082,240.04	
	RIO TINTO PLC	381,068	49.48	18,857,149.98	
	ASHTED GROUP PLC	151,489	49.78	7,541,122.42	
	BAE SYSTEMS PLC	1,047,026	9.85	10,319,488.25	
	BUNZL PLC	111,508	31.37	3,498,005.96	
	DCC PLC	30,399	49.76	1,512,654.24	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,934,768	1.56	4,578,238.08	
	SMITHS GROUP PLC	113,243	17.11	1,937,587.73	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	24,603	112.35	2,764,147.05	
	EXPERIAN PLC	311,703	28.13	8,768,205.39	
	INTERTEK GROUP PLC	55,231	41.31	2,281,592.61	

RELX PLC	646,773	25.01	16,175,792.73
RENTOKIL INITIAL PLC	885,676	6.38	5,650,612.88
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	378,223	4.99	1,888,089.21
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	32,323	42.34	1,368,555.82
BURBERRY GROUP PLC	126,278	22.90	2,891,766.20
PERSIMMON PLC	103,740	13.07	1,355,881.80
TAYLOR WIMPEY PLC	1,180,533	1.23	1,463,270.65
COMPASS GROUP PLC	596,590	22.35	13,333,786.50
ENTAIN PLC	198,717	14.75	2,931,075.75
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	57,197	53.62	3,066,903.14
PEARSON PLC	194,698	8.30	1,616,382.79
WHITBREAD PLC	65,187	33.06	2,155,082.22
AUTO TRADER GROUP PLC	333,922	6.39	2,133,761.58
INFORMA PLC	468,909	7.27	3,412,719.70
WPP PLC	357,177	8.94	3,194,591.08
JD SPORTS FASHION PLC	969,434	1.59	1,543,823.64
KINGFISHER PLC	726,268	2.40	1,746,674.54
NEXT PLC	41,419	65.94	2,731,168.86
OCADO GROUP PLC	164,438	3.94	647,885.72
SAINSBURY (J) PLC	620,861	2.81	1,744,619.41
TESCO PLC	2,502,282	2.66	6,673,586.09
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	119,280	18.95	2,260,356.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	720,727	26.66	19,218,185.45
COCA-COLA HBC AG-DI	61,536	25.38	1,561,783.68
DIAGEO PLC	769,954	35.48	27,317,967.92
IMPERIAL BRANDS PLC	294,866	17.87	5,270,729.75
HALEON PLC	1,723,187	3.40	5,859,697.39
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	242,516	65.02	15,768,390.32
UNILEVER PLC	857,936	42.71	36,642,446.56
SMITH & NEPHEW PLC	282,738	12.82	3,624,701.16
ASTRAZENECA PLC	524,161	120.10	62,951,736.10
GSK PLC	1,376,865	14.23	19,603,803.87
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	54,192	18.26	989,545.92
BARCLAYS PLC	5,403,921	1.59	8,614,930.85
HSBC HOLDINGS PLC	6,756,737	6.10	41,270,149.59
LLOYDS BANKING GROUP PLC	22,846,414	0.46	10,673,844.62
NATWEST GROUP PLC	1,818,709	2.68	4,881,414.95
STANDARD CHARTERED PLC	805,585	6.34	5,107,408.90
3I GROUP PLC	319,724	19.29	6,169,074.58
ABRDN PLC	590,816	2.11	1,251,939.10
HARGREAVES LANSDOWN PLC	123,322	8.11	1,001,127.99
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	140,310	84.36	11,836,551.60

	M&G PLC	725,660	2.01	1,458,576.60	
	SCHRODERS PLC	321,906	4.68	1,507,807.70	
	ST JAMES'S PLACE PLC	199,717	11.45	2,286,759.65	
	ADMIRAL GROUP PLC	63,019	22.49	1,417,297.31	
	AVIVA PLC	934,484	4.13	3,864,091.34	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,050,970	2.35	4,823,881.44	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	293,906	5.75	1,692,310.74	
	PRUDENTIAL PLC	931,229	11.78	10,969,877.62	
	SAGE GROUP PLC/THE	358,305	8.65	3,099,338.25	
	HALMA PLC	121,077	24.98	3,024,503.46	
	BT GROUP PLC	2,429,600	1.44	3,521,705.20	
	VODAFONE GROUP PLC	8,932,193	0.83	7,421,759.16	
	NATIONAL GRID PLC	1,241,019	11.03	13,688,439.57	
	SEVERN TRENT PLC	83,766	28.13	2,356,337.58	
	SSE PLC	377,095	18.68	7,044,134.60	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	232,410	10.41	2,419,388.10	
	イギリスポンド 小計	93,761,843		622,334,689.39 (106,854,866,168)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	60,430	13.87	838,164.10	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2,396	719.00	1,722,724.00	
	GIVAUDAN-REG	3,166	3,052.00	9,662,632.00	
	HOLCIM LTD	198,834	59.18	11,766,996.12	
	SIG GROUP AG	103,650	25.88	2,682,462.00	
	SIKA AG-REG	51,919	257.20	13,353,566.80	
	ABB LTD-REG	549,864	33.89	18,634,890.96	
	GEBERIT AG-REG	13,085	506.80	6,631,478.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	7,216	190.00	1,371,040.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	14,965	199.35	2,983,272.75	
	VAT GROUP AG	8,759	335.70	2,940,396.30	
	ADECCO GROUP AG-REG	55,553	28.82	1,601,037.46	
	SGS SA-REG	56,050	80.88	4,533,324.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	19,929	259.40	5,169,582.60	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	183,125	152.95	28,008,968.75	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	9,553	290.00	2,770,370.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	17,907	53.30	954,443.10	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	1,298	1,945.00	2,524,610.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	350	11,020.00	3,857,000.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	37	110,200.00	4,077,400.00	
	NESTLE SA-REG	961,859	113.82	109,478,791.38	
	ALCON INC	179,222	73.42	13,158,479.24	
	SONOVA HOLDING AG-REG	17,404	255.80	4,451,943.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	41,274	140.70	5,807,251.80	

	BACHEM HOLDING AG	12,632	94.75	1,196,882.00	
	LONZA GROUP AG-REG	26,290	578.00	15,195,620.00	
	NOVARTIS AG-REG	756,373	90.51	68,459,320.23	
	ROCHE HOLDING AG-BR	9,828	316.80	3,113,510.40	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	245,433	288.25	70,746,062.25	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	9,251	88.95	822,876.45	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,198,227	0.79	950,433.65	
	JULIUS BAER GROUP LTD	74,047	62.82	4,651,632.54	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	7,700	855.00	6,583,500.00	
	UBS GROUP AG-REG	1,173,944	17.99	21,119,252.56	
	BALOISE HOLDING AG - REG	15,786	142.10	2,243,190.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	10,419	535.40	5,578,332.60	
	SWISS RE AG	103,477	91.72	9,490,910.44	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	52,834	428.10	22,618,235.40	
	TEMENOS AG - REG	22,921	76.74	1,758,957.54	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	66,191	59.08	3,910,564.28	
	SWISSCOM AG-REG	8,956	584.60	5,235,677.60	
	BKW AG	6,450	164.70	1,062,315.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	28,756	80.10	2,303,355.60	
	スイスフラン 小計	6,387,360		506,021,453.70 (77,598,389,924)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	988,868	51.10	50,531,154.80	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	519,000	78.75	40,871,250.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	656,000	12.36	8,108,160.00	
	MTR CORP	552,000	38.55	21,279,600.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	352,000	13.04	4,590,080.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	767,000	52.00	39,884,000.00	
	SANDS CHINA LTD	775,600	26.50	20,553,400.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	562,000	20.80	11,689,600.00	
	WH GROUP LTD	2,846,000	4.20	11,953,200.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,321,000	24.30	32,100,300.00	
	HANG SENG BANK LTD	249,300	112.00	27,921,600.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	426,600	304.00	129,686,400.00	
	AIA GROUP LTD	4,133,600	78.90	326,141,040.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	1,165,000	10.16	11,836,400.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	253,000	46.10	11,663,300.00	
	CLP HOLDINGS LTD	546,000	58.95	32,186,700.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	4,338,348	7.44	32,277,309.12	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	514,500	46.20	23,769,900.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	652,868	45.20	29,509,633.60	
	ESR GROUP LTD	632,800	11.62	7,353,136.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	724,000	12.38	8,963,120.00	

	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	559,641	27.10	15,166,271.10	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	552,250	19.32	10,669,470.00	
	SINO LAND CO	1,247,400	10.34	12,898,116.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	530,000	103.50	54,855,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	145,000	56.55	8,199,750.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	500,800	19.92	9,975,936.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	534,000	40.05	21,386,700.00	
	香港ドル 小計	27,044,575		1,016,020,526.62 (17,892,121,473)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	30,200	35.32	1,066,664.00	
	KEPPEL CORP LTD	477,500	6.48	3,094,200.00	
	SEATRUM LTD	15,794,803	0.12	2,005,939.98	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	529,600	3.77	1,996,592.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	461,640	6.26	2,889,866.40	
	GENTING SINGAPORE LTD	1,914,500	1.03	1,971,935.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	670,600	3.99	2,675,694.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	644,400	30.83	19,866,852.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,228,800	12.25	15,052,800.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	407,400	27.89	11,362,386.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	303,500	9.30	2,822,550.00	
	VENTURE CORP LTD	76,900	15.36	1,181,184.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,888,260	2.56	7,393,945.60	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	802,000	3.46	2,774,920.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	118,100	6.89	813,709.00	
	UOL GROUP LTD	194,000	6.75	1,309,500.00	
	シンガポールドル 小計	26,542,203		78,278,737.98 (8,022,787,855)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	418,085	8.89	3,716,775.65	
	EBOS GROUP LTD	54,700	43.00	2,352,100.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	205,994	26.80	5,520,639.20	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	630,447	5.24	3,306,694.51	
	MERCURY NZ LTD	216,705	6.50	1,408,582.50	
	MERIDIAN ENERGY LTD	445,023	5.45	2,425,375.35	
	ニュージーランドドル 小計	1,970,954		18,730,167.21 (1,621,470,575)	
スウェーデンクローネ	BOLIDEN AB	89,974	348.80	31,382,931.20	
	BOLIDEN AB RED SHS	89,974	11.44	1,029,302.56	
	HOLMEN AB-B SHARES	33,017	415.30	13,711,960.10	
	SVENSKA CELLULOSE AB SCA-B	240,415	146.20	35,148,673.00	
	ALFA LAVAL AB	92,471	398.20	36,821,952.20	
	ASSA ABLOY AB-B	348,981	251.80	87,873,415.80	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	951,688	157.20	149,605,353.60	

ATLAS COPCO AB-B SHS	536,895	137.30	73,715,683.50
EPIROC AB-A	235,563	211.60	49,845,130.80
EPIROC AB-B	132,310	179.80	23,789,338.00
HUSQVARNA AB-B SHS	159,232	89.48	14,248,079.36
INDUTRADE AB	112,600	262.70	29,580,020.00
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	58,459	225.70	13,194,196.30
LIFCO AB-B SHS	71,700	241.00	17,279,700.00
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	558,696	114.95	64,222,105.20
SANDVIK AB	370,537	206.70	76,589,997.90
SKANSKA AB-B SHS	104,733	149.65	15,673,293.45
SKF AB-B SHARES	139,662	188.60	26,340,253.20
VOLVO AB-A SHS	62,474	216.00	13,494,384.00
VOLVO AB-B SHS	550,592	208.30	114,688,313.60
SECURITAS AB-B SHS	156,813	84.18	13,200,518.34
VOLVO CAR AB-B	207,500	38.77	8,044,775.00
ELECTROLUX AB-B	84,165	163.65	13,773,602.25
EVOLUTION AB	63,418	1,432.40	90,839,943.20
EMBRACER GROUP AB	230,400	41.45	9,551,232.00
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	260,961	144.14	37,614,918.54
ESSITY AKTIEBOLAG-B	211,829	310.70	65,815,270.30
GETINGE AB-B SHS	85,916	258.30	22,192,102.80
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	60,727	238.60	14,489,462.20
NORDEA BANK ABP	1,127,309	109.44	123,372,696.96
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	591,053	115.10	68,030,200.30
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	515,326	87.26	44,967,346.76
SWEDBANK AB - A SHARES	294,827	168.20	49,589,901.40
EQT AB	117,771	212.10	24,979,229.10
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	44,871	296.50	13,304,251.50
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	53,600	296.30	15,881,680.00
INVESTOR AB-A SHS	178,300	220.90	39,386,470.00
INVESTOR AB-B SHS	617,963	219.20	135,457,489.60
KINNEVIK AB - B	80,928	164.50	13,312,656.00
LUNDBERGS AB-B SHS	24,225	485.10	11,751,547.50
ERICSSON LM-B SHS	1,083,625	55.59	60,238,713.75
HEXAGON AB-B SHS	673,784	120.55	81,224,661.20
TELE2 AB-B SHS	198,238	101.20	20,061,685.60
TELIA CO AB	910,648	26.44	24,077,533.12
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	147,348	38.96	5,740,678.08
SAGAX AB-B	64,700	215.40	13,936,380.00
スウェーデンクロネ 小計	13,026,218		1,909,069,029.27 (25,027,894,973)
AKER BP ASA	103,871	248.60	25,822,330.60

ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	327,567	301.80	98,859,720.60	
	NORSK HYDRO ASA	434,804	69.32	30,140,613.28	
	YARA INTERNATIONAL ASA	61,095	422.80	25,830,966.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	32,500	479.20	15,574,000.00	
	ADEVINTA ASA	106,857	82.00	8,762,274.00	
	MOWI ASA	135,763	187.35	25,435,198.05	
	ORKLA ASA	250,892	82.88	20,793,928.96	
	SALMAR ASA	25,891	470.00	12,168,770.00	
	DNB BANK ASA	315,870	187.15	59,115,070.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	69,251	184.40	12,769,884.40	
	TELENOR ASA	268,841	118.40	31,830,774.40	
ノルウェークローネ 小計		2,133,202		367,103,530.79 (4,647,530,699)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	33,357	537.40	17,926,051.80	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	71,863	357.40	25,683,836.20	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	3,501	1,736.50	6,079,486.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	365,477	207.65	75,891,299.05	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1,039	11,700.00	12,156,300.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,814	11,860.00	21,514,040.00	
	DSV A/S	67,663	1,316.50	89,078,339.50	
	PANDORA A/S	30,806	597.20	18,397,343.20	
	CARLSBERG AS-B	34,731	1,123.50	39,020,278.50	
	COLOPLAST-B	39,767	912.80	36,299,317.60	
	DEMANT A/S	34,228	280.40	9,597,531.20	
	GENMAB A/S	24,006	2,822.00	67,744,932.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	578,163	1,150.00	664,887,450.00	
	DANSKE BANK A/S	256,563	140.85	36,136,898.55	
	TRYG A/S	114,270	160.20	18,306,054.00	
	ORSTED A/S	68,474	637.60	43,659,022.40	
デンマーククローネ 小計		1,725,722		1,182,378,180.50 (23,659,387,391)	
イスラエルシェケル	ICL GROUP LTD	211,785	23.79	5,038,365.15	
	ELBIT SYSTEMS LTD	10,169	751.50	7,642,003.50	
	BANK HAPOLIM BM	445,216	32.37	14,411,641.92	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	520,979	29.00	15,108,391.00	
	FIRST INTL BANK ISRAEL	24,000	146.50	3,516,000.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	403,741	19.29	7,788,163.89	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	48,267	130.60	6,303,670.20	
	NICE LTD	22,115	690.30	15,265,984.50	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	572,400	5.06	2,896,344.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	35,700	154.10	5,501,370.00	
	AZRIELI GROUP LTD	14,806	207.50	3,072,245.00	

イスラエルシェケル 小計		2,309,178		86,544,179.16 (3,272,633,517)	
ユーロ	ENI SPA	894,299	13.45	12,028,321.55	
	GALP ENERGIA SGPS SA	151,355	10.48	1,586,200.40	
	NESTE OYJ	144,923	37.95	5,499,827.85	
	OMV AG	55,701	42.64	2,375,090.64	
	REPSOL SA	480,018	13.37	6,417,840.66	
	TENARIS SA	169,211	12.33	2,087,217.68	
	TOTALENERGIES SE	870,033	56.12	48,826,251.96	
	AIR LIQUIDE SA	183,179	162.92	29,843,522.68	
	AKZO NOBEL N.V.	67,454	76.80	5,180,467.20	
	ARCELORMITTAL	198,634	24.83	4,932,082.22	
	ARKEMA	19,014	87.40	1,661,823.60	
	BASF SE	324,779	47.60	15,461,104.29	
	COVESTRO AG	64,321	39.72	2,554,830.12	
	CRH PLC	265,682	46.15	12,261,224.30	
	DSM-FIRMENICH AG	59,131	116.86	6,910,048.66	
	EVONIK INDUSTRIES AG	76,974	19.50	1,501,377.87	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	56,551	70.14	3,966,487.14	
	OCI NV	34,955	23.09	807,110.95	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	81,855	34.61	2,833,001.55	
	SOLVAY SA	24,153	104.20	2,516,742.60	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	184,408	11.73	2,164,027.88	
	SYMRISE AG	47,263	105.95	5,007,514.85	
	UMICORE	77,865	28.87	2,247,962.55	
	UPM-KYMMENE OYJ	196,377	29.37	5,767,592.49	
	VOESTALPINE AG	39,061	30.86	1,205,422.46	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	80,655	31.28	2,522,888.40	
	AIRBUS SE	206,641	129.24	26,706,282.84	
	ALSTOM	114,969	27.32	3,140,953.08	
	BOUYGUES SA	69,916	30.98	2,165,997.68	
	BRENTAG SE	58,066	76.16	4,422,306.56	
	CNH INDUSTRIAL NV	357,627	12.96	4,636,634.05	
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	168,378	55.40	9,328,141.20	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	170,311	29.27	4,985,002.97	
	DASSAULT AVIATION SA	9,266	171.70	1,590,972.20	
	EIFFAGE	27,982	102.90	2,879,347.80	
	FERROVIAL SA	180,338	29.48	5,316,364.24	
	GEA GROUP AG	52,112	40.40	2,105,324.80	
	IMCD NV	22,765	139.15	3,167,749.75	
	KINGSPAN GROUP PLC	51,132	65.10	3,328,693.20	
	KNORR-BREMSE AG	25,881	68.28	1,767,154.68	

KONE OYJ-B	115,873	50.54	5,856,221.42
LEGRAND SA	92,909	87.92	8,168,559.28
METSO CORP	226,750	10.88	2,468,173.75
MTU AERO ENGINES AG	17,773	229.50	4,078,903.50
PRYSMIAN SPA	81,681	35.40	2,891,507.40
RATIONAL AG	2,060	634.50	1,307,070.00
RHEINMETALL AG	14,260	261.60	3,730,416.00
SAFRAN SA	120,274	143.14	17,216,020.36
SCHNEIDER ELECTRIC SE	189,651	164.60	31,216,554.60
SIEMENS AG-REG	267,506	159.78	42,742,108.68
SIEMENS ENERGY AG	176,654	24.24	4,282,092.96
THALES SA	36,648	139.15	5,099,569.20
VINCI SA	188,356	110.90	20,888,680.40
WARTSILA OYJ ABP	161,062	11.05	1,779,735.10
BUREAU VERITAS SA	94,880	24.80	2,353,024.00
RANDSTAD NV	40,342	48.06	1,938,836.52
TELEPERFORMANCE	19,579	158.50	3,103,271.50
WOLTERS KLUWER	92,851	108.75	10,097,546.25
ADP	10,260	143.10	1,468,206.00
AENA SME SA	28,538	150.80	4,303,530.40
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	227,150	9.59	2,178,822.80
DEUTSCHE POST AG-REG	351,445	42.23	14,841,522.35
GETLINK SE	162,686	17.05	2,773,796.30
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	113,502	103.38	11,733,836.76
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	24,407	97.90	2,389,445.30
CONTINENTAL AG	34,400	68.42	2,353,648.00
DR ING HC F PORSCHE AG	38,470	118.40	4,554,848.00
FERRARI NV	44,042	275.90	12,151,187.80
MERCEDES-BENZ GROUP AG	281,534	71.18	20,039,590.12
MICHELIN (CGDE)	231,927	27.99	6,491,636.73
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	54,611	53.72	2,933,702.92
RENAULT SA	69,801	33.56	2,342,870.56
STELLANTIS NV	806,485	15.43	12,445,676.52
VALEO	72,083	19.00	1,369,577.00
VOLKSWAGEN AG	8,950	149.10	1,334,445.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	63,649	120.20	7,650,609.80
ADIDAS AG	56,468	159.02	8,979,541.36
HERMES INTERNATIONAL	11,094	2,002.50	22,215,735.00
KERING	26,497	535.10	14,178,544.70
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	96,884	874.30	84,705,681.20
MONCLER SPA	70,646	64.36	4,546,776.56
PUMA SE	32,556	46.71	1,520,690.76

SEB SA	9,694	101.70	985,879.80
ACCOR SA	57,043	32.50	1,853,897.50
AMADEUS IT GROUP SA	154,871	67.70	10,484,766.70
DELIVERY HERO SE	54,469	39.56	2,154,793.64
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	57,568	189.55	10,912,014.40
JUST EAT TAKEAWAY	57,881	17.00	984,440.04
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	37,870	37.50	1,420,125.00
SODEXO SA	32,194	102.55	3,301,494.70
BOLLORE SE	379,739	6.00	2,280,332.69
PUBLICIS GROUPE	84,594	71.60	6,056,930.40
SCOUT24 SE	27,257	59.24	1,614,704.68
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	248,437	19.02	4,726,513.92
VIVENDI SE	236,529	9.49	2,245,133.26
D'IETEREN GROUP	8,226	169.00	1,390,194.00
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	372,239	31.39	11,684,582.21
PROSUS NV	281,137	67.69	19,030,163.53
ZALANDO SE	72,249	30.87	2,230,326.63
CARREFOUR SA	197,337	17.79	3,510,625.23
HELLOFRESH SE	45,738	22.49	1,028,647.62
JERONIMO MARTINS	95,613	22.72	2,172,327.36
KESKO OYJ-B SHS	93,457	18.01	1,683,627.85
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	375,985	30.74	11,557,778.90
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	305,382	54.85	16,750,202.70
DANONE	228,893	58.75	13,447,463.75
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	209,447	12.26	2,567,820.22
HEINEKEN HOLDING NV	38,117	84.90	3,236,133.30
HEINEKEN NV	88,926	101.20	8,999,311.20
JDE PEET'S NV	35,400	27.30	966,420.00
KERRY GROUP PLC-A	59,517	94.86	5,645,782.62
PERNOD RICARD SA	72,925	212.00	15,460,100.00
REMY COINTREAU	6,746	150.75	1,016,959.50
BEIERSDORF AG	33,411	127.40	4,256,561.40
HENKEL AG & CO KGAA	34,620	69.62	2,410,244.40
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	64,021	78.40	5,019,246.40
L'OREAL	84,499	421.60	35,624,778.40
AMPLIFON SPA	42,891	34.22	1,467,730.02
BIOMERIEUX	13,869	101.25	1,404,236.25
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	15,246	110.35	1,682,396.10
DIASORIN SPA	9,103	102.40	932,147.20
ESSILORLUXOTTICA	101,709	183.42	18,655,464.78
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	67,833	43.23	2,932,420.59
FRESENIUS SE & CO KGAA	148,916	27.49	4,093,700.84

KONINKLIJKE PHILIPS NV	329,605	18.90	6,230,852.92
SIEMENS HEALTHINEERS AG	104,654	53.82	5,632,478.28
ARGENX SE	18,640	386.20	7,198,768.00
BAYER AG-REG	343,904	54.59	18,773,719.36
EUROFINS SCIENTIFIC	44,948	60.48	2,718,455.04
GRIFOLS SA	82,564	11.51	950,724.46
IPSEN	13,860	114.00	1,580,040.00
MERCK KGAA	44,683	166.45	7,437,485.35
ORION OYJ-CLASS B	34,824	41.10	1,431,266.40
QIAGEN N.V.	88,951	41.85	3,722,599.35
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	32,103	45.00	1,444,635.00
SANOFI	398,683	101.62	40,514,166.46
SARTORIUS AG-VORZUG	8,436	340.00	2,868,240.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	10,076	245.50	2,473,658.00
UCB SA	42,461	88.28	3,748,457.08
ABN AMRO BANK NV-CVA	133,234	14.66	1,953,876.61
AIB GROUP PLC	464,870	3.93	1,830,658.06
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,147,930	6.49	13,944,361.56
BANCO SANTANDER SA	5,903,264	3.20	18,890,444.80
BANK OF IRELAND GROUP PLC	351,816	8.99	3,162,825.84
BNP PARIBAS	388,036	59.85	23,223,954.60
CAIXABANK SA	1,651,188	3.40	5,618,992.76
COMMERZBANK AG	350,612	9.78	3,431,790.25
CREDIT AGRICOLE SA	418,393	11.87	4,966,324.91
ERSTE GROUP BANK AG	130,441	30.81	4,018,887.21
FINECOBANK SPA	218,566	12.56	2,746,281.79
ING GROEP NV	1,324,282	12.02	15,917,869.64
INTESA SANPAOLO	5,725,255	2.41	13,835,078.70
KBC GROUP NV	86,970	59.52	5,176,454.40
MEDIOBANCA SPA	181,481	10.03	1,821,161.83
SOCIETE GENERALE SA	281,872	23.18	6,535,202.32
UNICREDIT SPA	653,147	19.01	12,416,324.47
ADYEN NV	7,819	1,454.80	11,375,081.20
AMUNDI SA	21,837	61.70	1,347,342.90
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	724,419	9.78	7,084,817.82
DEUTSCHE BOERSE AG	64,617	168.95	10,917,042.15
EDENRED	92,657	60.02	5,561,273.14
EURAZEO SE	11,669	63.85	745,065.65
EURONEXT NV	28,504	66.60	1,898,366.40
EXOR NV	35,414	80.26	2,842,327.64
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	40,261	76.88	3,095,265.68
NEXI SPA	224,714	7.70	1,732,095.51

SOFINA	5,291	202.00	1,068,782.00
WENDEL	9,312	102.40	953,548.80
WORLDLINE SA	92,735	40.38	3,744,639.30
AEGON NV	589,592	4.32	2,548,806.21
AGEAS	51,936	41.25	2,142,360.00
ALLIANZ SE-REG	141,296	212.25	29,990,076.00
ASSICURAZIONI GENERALI	381,027	19.00	7,241,418.13
AXA SA	660,331	27.76	18,334,090.21
HANNOVER RUECK SE	20,084	196.55	3,947,510.20
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	49,353	339.50	16,755,343.50
NN GROUP NV	91,002	35.31	3,213,280.62
POSTE ITALIANE SPA	188,025	9.78	1,839,636.60
SAMPO OYJ-A SHS	164,393	42.93	7,057,391.49
BECHTLE AG	26,787	39.01	1,044,960.87
CAPGEMINI SE	56,142	164.10	9,212,902.20
DASSAULT SYSTEMES SE	230,071	37.93	8,727,743.38
NEMETSCHEK SE	20,683	71.72	1,483,384.76
SAP SE	364,693	124.48	45,396,984.64
NOKIA OYJ	1,876,698	3.81	7,155,849.47
CELLNEX TELECOM SA	202,660	38.20	7,741,612.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,132,185	21.85	24,743,903.17
ELISA OYJ	51,319	55.42	2,844,098.98
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	114,083	12.05	1,375,270.56
KONINKLIJKE KPN NV	1,259,750	3.25	4,094,187.50
ORANGE	715,321	11.32	8,097,433.72
TELECOM ITALIA SPA	3,630,827	0.26	978,144.79
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	297,838	2.75	821,139.36
TELEFONICA SA	1,787,950	3.92	7,017,703.75
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	30,096	14.45	434,887.20
ACCIONA SA	8,326	165.85	1,380,867.10
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	19,200	31.12	597,504.00
E.ON SE	813,815	11.25	9,159,487.82
EDP RENOVAVEIS SA	96,779	19.75	1,911,869.14
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	985,811	4.77	4,705,275.90
ELIA GROUP SA/NV	10,658	117.60	1,253,380.80
ENAGAS SA	82,825	17.84	1,477,598.00
ENDESA SA	108,855	19.94	2,171,112.97
ENEL SPA	2,846,419	6.00	17,104,131.77
ENGIE	626,822	14.49	9,086,411.71
FORTUM OYJ	183,288	13.14	2,409,320.76
IBERDROLA SA	2,145,807	11.63	24,955,735.41
NATURGY ENERGY GROUP SA	45,200	26.70	1,206,840.00

RED ELECTRICA CORPORACION SA	131,018	16.07	2,105,459.26	
RWE AG	233,120	41.16	9,595,219.20	
SNAM SPA	693,764	5.08	3,528,483.70	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	469,067	7.91	3,712,196.23	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	241,804	28.26	6,833,381.04	
VERBUND AG	22,697	74.75	1,696,600.75	
ASM INTERNATIONAL NV	17,245	360.30	6,213,373.50	
ASML HOLDING NV	140,979	643.40	90,705,888.60	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	461,063	35.95	16,577,520.16	
STMICROELECTRONICS NV	247,331	41.53	10,272,893.08	
AROUNDTOWN SA	379,138	1.00	381,981.53	
LEG IMMOBILIEN SE	21,715	51.40	1,116,151.00	
VONOVIA SE	271,709	17.50	4,754,907.50	
ユーロ 小計	64,669,622		1,690,042,934.07 (251,833,297,605)	
合 計	396,455,540		2,404,031,724,020 (2,404,031,724,020)	

(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	53,749	6,224,134.20	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	107,934	3,642,772.50	
		AMERICAN TOWER CORP	162,924	31,074,494.52	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	47,616	8,391,843.84	
		BOSTON PROPERTIES INC	61,058	2,996,726.64	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	39,024	4,156,056.00	
		CROWN CASTLE INC	152,246	17,215,977.68	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	99,468	9,026,721.00	
		EQUINIX INC	32,378	23,428,073.24	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	67,328	4,383,052.80	
		EQUITY RESIDENTIAL	123,902	7,613,777.90	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	21,585	4,528,101.30	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	45,690	6,766,689.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	85,391	4,151,710.42	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	140,933	2,670,680.35	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	205,056	4,080,614.40	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	236,020	4,028,861.40	
		INVITATION HOMES INC	222,743	7,468,572.79	

		IRON MOUNTAIN INC	106,039	5,870,319.04		
		KIMCO REALTY CORP	206,423	3,781,669.36		
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	177,787	1,365,404.16		
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	39,926	5,916,234.68		
		PROLOGIS INC	322,925	39,739,150.50		
		PUBLIC STORAGE	55,625	15,847,562.50		
		REALTY INCOME CORP	224,141	13,441,735.77		
		REGENCY CENTERS CORP	55,581	3,203,133.03		
		SBA COMMUNICATIONS CORP	37,260	8,695,738.80		
		SIMON PROPERTY GROUP INC	117,672	12,397,921.92		
		SUN COMMUNITIES INC	43,591	5,628,905.83		
		UDR INC	113,375	4,573,547.50		
		VENTAS INC	137,514	6,156,501.78		
		VICI PROPERTIES INC	330,478	10,443,104.80		
		WELLTOWER INC	170,095	13,019,071.30		
		WEYERHAEUSER CO	265,250	7,848,747.50		
		WP CAREY INC	68,940	4,738,246.20		
		アメリカドル合計		4,377,667	314,515,854.65 (43,315,123,502)	
		カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	23,300	1,133,079.00
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	58,600			1,181,962.00		
カナダドル合計		81,900	2,315,041.00 (236,319,385)			
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS/AU	413,611	3,354,385.21		
		GOODMAN GROUP	587,247	11,903,496.69		
		GPT GROUP	656,296	2,848,324.64		
		MIRVAC GROUP	1,521,680	3,560,731.20		
		SCENTRE GROUP	1,734,337	4,821,456.86		
		STOCKLAND	815,965	3,622,884.60		
		VICINITY CENTRES	1,315,193	2,656,689.86		
オーストラリアドル合計		7,044,329	32,767,969.06 (3,006,788,840)			
イギリスポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	317,051	1,129,335.66		
		LAND SECURITIES GROUP PLC	250,833	1,575,732.90		
		SEGRO PLC	403,906	3,263,560.48		
イギリスポンド合計		971,790	5,968,629.04 (1,024,813,606)			
香港ドル	投資証券	LINK REIT	865,200	43,000,440.00		
香港ドル合計		865,200	43,000,440.00 (757,237,748)			
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	1,879,771	3,740,744.29		

		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,029,700	1,709,302.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	1,203,700	2,034,253.00	
シンガポールドル合計			5,247,371	10,660,059.29 (1,092,549,476)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	13,302	628,386.48	
		GECINA SA	16,340	1,586,614.00	
		KLEPIERRE	71,486	1,498,346.56	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	35,721	1,569,937.95	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	50,808	1,343,363.52	
ユーロ合計			187,657	6,626,648.51 (987,436,894)	
合計				50,420,269,451 (50,420,269,451)	

(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 601銘柄	97.58%	—	71.09%
	投資証券 35銘柄	—	2.42%	1.76%
カナダドル	株式 85銘柄	99.73%	—	3.52%
	投資証券 2銘柄	—	0.27%	0.01%
オーストラリアドル	株式 52銘柄	94.56%	—	2.13%
	投資証券 7銘柄	—	5.44%	0.12%
イギリスポンド	株式 76銘柄	99.05%	—	4.35%
	投資証券 3銘柄	—	0.95%	0.04%
スイスフラン	株式 43銘柄	100.00%	—	3.16%
香港ドル	株式 28銘柄	95.94%	—	0.73%
	投資証券 1銘柄	—	4.06%	0.03%
シンガポールドル	株式 16銘柄	88.01%	—	0.33%
	投資証券 4銘柄	—	11.99%	0.04%
ニュージーランドドル	株式 6銘柄	100.00%	—	0.07%
スウェーデンクローネ	株式 46銘柄	100.00%	—	1.02%
ノルウェークローネ	株式 12銘柄	100.00%	—	0.19%
デンマーククローネ	株式 16銘柄	100.00%	—	0.96%
イスラエルシェケル	株式 11銘柄	100.00%	—	0.13%
ユーロ	株式 221銘柄	99.61%	—	10.26%
	投資証券 5銘柄	—	0.39%	0.04%

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 ＤＣ年金インデックス（先進国株式）】

【純資産額計算書】

2023年 5月31日現在

（単位：円）

I 資産総額	18,851,860,959
II 負債総額	24,416,120
III 純資産総額（I－II）	18,827,444,839
IV 発行済口数	10,650,997,585口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	1.7677
（10,000口当たり）	（17,677）

（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

2023年 5月31日現在

（単位：円）

I 資産総額	2,559,555,998,261
II 負債総額	872,568,704
III 純資産総額（I－II）	2,558,683,429,557
IV 発行済口数	498,663,740,958口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	5.1311
（10,000口当たり）	（51,311）

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。

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額等

2023年5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 5月31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	25,052,888
追加型公社債投資信託	16	1,522,598
単位型株式投資信託	91	412,103
単位型公社債投資信託	49	114,477
合 計	1,031	27,102,067

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）財務諸表の作成方法について

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

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

（2）監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第38期事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

(単位：千円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金	※2 51,593,362	※2 51,733,041

有価証券		293,326		1,579,691
前払費用		645,109		770,747
未収入金		61,092		81,854
未収委託者報酬		15,750,264		16,753,855
未収収益	※2	783,790	※2	688,142
金銭の信託		8,401,300		10,400,000
その他		295,584		745,576
流動資産合計		77,823,830		82,752,908
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	391,042	※1	181,551
器具備品	※1	1,079,023	※1	730,357
土地		628,433		628,433
建設仮勘定		-		1,111,177
有形固定資産合計		2,098,499		2,651,520
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		4,381,293		4,183,644
ソフトウェア仮勘定		1,581,652		1,907,739
無形固定資産合計		5,978,768		6,107,206
投資その他の資産				
投資有価証券		16,803,642		12,022,365
関係会社株式		159,536		159,536
投資不動産	※1	810,684	※1	807,066
長期差入保証金		524,244		689,492
前払年金費用		189,708		118,832
繰延税金資産		982,406		1,675,132
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		19,491,852		15,494,056
固定資産合計		27,569,120		24,252,782
資産合計		105,392,950		107,005,691

(単位：千円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	565,222	507,559
未払金		
未払収益分配金	197,334	114,094
未払償還金	7,418	7,418
未払手数料	※2 6,423,139	※2 6,139,595
その他未払金	※2 4,565,457	※2 955,697
未払費用	※2 4,328,968	※2 5,778,896
未払消費税等	1,112,923	439,657
未払法人税等	769,692	2,375,281
賞与引当金	942,287	849,840
役員賞与引当金	149,028	154,872
その他	5,517	5,517

流動負債合計	19,066,990	17,328,431
固定負債		
長期未払金	10,800	-
退職給付引当金	1,246,300	1,333,882
役員退職慰労引当金	117,938	75,667
時効後支払損引当金	250,214	254,296
固定負債合計	1,625,252	1,663,846
負債合計	20,692,243	18,992,277
(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	29,000,498	33,267,700
利益剰余金合計	36,341,088	40,608,289
株主資本合計	83,073,932	87,341,133

(単位：千円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023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	1,626,775	672,279
評価・換算差額等合計	1,626,775	672,279
純資産合計	84,700,707	88,013,413
負債純資産合計	105,392,950	107,005,691

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	79,977,953	84,121,445
投資顧問料	2,711,169	2,750,601
その他営業収益	13,459	10,412
営業収益合計	82,702,582	86,882,459
営業費用		
支払手数料	※2 31,644,834	※2 31,461,274

広告宣伝費	720,785	798,894
公告費	500	375
調査費		
調査費	2,430,158	2,849,042
委託調査費	14,557,009	19,236,505
事務委託費	1,450,062	1,751,807
営業雑経費		
通信費	138,868	113,480
印刷費	379,428	367,379
協会費	49,590	58,128
諸会費	17,729	18,447
事務機器関連費	2,172,978	2,238,382
その他営業雑経費	649	-
営業費用合計	53,562,596	58,893,717
一般管理費		
給料		
役員報酬	414,260	416,461
給料・手当	6,496,233	6,565,766
賞与引当金繰入	942,287	849,840
役員賞与引当金繰入	149,028	154,872
福利厚生費	1,282,310	1,279,885
交際費	4,874	8,942
旅費交通費	21,698	75,274
租税公課	430,233	403,955
不動産賃借料	724,961	719,707
退職給付費用	494,615	388,176
固定資産減価償却費	2,249,287	2,418,341
諸経費	379,054	444,313
一般管理費合計	13,588,846	13,725,534
営業利益	15,551,139	14,263,207

(単位：千円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	243,133	47,353
受取利息	※2 7,408	※2 10,279
投資有価証券償還益	1,089,101	609,102
収益分配金等時効完成分	137,485	94,351
受取賃貸料	※2 65,808	※2 65,808
その他	36,211	36,894
営業外収益合計	1,579,148	863,788
営業外費用		
投資有価証券償還損	3,074	32,995
時効後支払損引当金繰入	16,548	31,951
事務過誤費	76,076	2,680
賃貸関連費用	15,780	14,262

その他		7,585		32,394
営業外費用合計		119,066		114,284
経常利益		17,011,221		15,012,711
特別利益				
投資有価証券売却益		605,706		387,113
特別利益合計		605,706		387,113
特別損失				
投資有価証券売却損		28,188		15,828
投資有価証券評価損		36,558		104,554
固定資産除却損	※1	13,094	※1	32,791
減損損失		-	※3	315,350
特別損失合計		77,840		468,524
税引前当期純利益		17,539,087		14,931,300
法人税、住民税及び事業税	※2	5,366,608	※2	4,860,444
法人税等調整額		22,446		△271,471
法人税等合計		5,389,054		4,588,973
当期純利益		12,150,032		10,342,327

(3) 【株主資本等変動計算書】

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
会計方針の変更による累積的影響額				
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
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）				
当期変動額合計	—	—	—	—
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712

	利益剰余金				株主資本合計
	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
別途 積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	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	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	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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）				
当期変動額合計	—	—	—	—
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712

	利益剰余金				株主資本合計
	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	342,589	6,998,000	29,000,498	36,341,088	83,073,932

当期変動額					
剰余金の配当			△6,075,125	△6,075,125	△6,075,125
当期純利益			10,342,327	10,342,327	10,342,327
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)					
当期変動額合計	—	—	4,267,201	4,267,201	4,267,201
当期末残高	342,589	6,998,000	33,267,700	40,608,289	87,341,133

	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
当期変動額			
剰余金の配当			△6,075,125
当期純利益			10,342,327
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	△954,495	△954,495	△954,495
当期変動額合計	△954,495	△954,495	3,312,705
当期末残高	672,279	672,279	88,013,413

[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、1998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2016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	5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

グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、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、財務諸表への影響はありません。

(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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
建物	805,250千円	1,006,606千円
器具備品	2,054,366千円	1,985,072千円
投資不動産	157,995千円	163,978千円

※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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
預金	43,782,913千円	40,165,058千円
未収収益	13,741千円	15,046千円
未払手数料	836,105千円	790,279千円
その他未払金	3,887,520千円	77,007千円
未払費用	337,847千円	277,358千円

(損益計算書関係)

※1.固定資産除却損の内訳

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
建物	2,599千円	1,047千円
器具備品	10,495千円	29,762千円
ソフトウェア	-	1,981千円
計	13,094千円	32,791千円

※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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
支払手数料	5,153,589千円	4,893,312千円
受取利息	7,377千円	10,236千円
受取賃貸料	65,808千円	68,168千円
法人税、住民税及び事業税	4,062,765千円	3,947,200千円

※3.減損損失

当社は、以下のとおり減損損失を計上しました。

場所	用途	種類	金額
東京都千代田区（本社）	ホームページ	ソフトウェア	315,350千円

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグルーピングとしております。

翌期において、ホームページのリニューアルを予定しており、現行のホームページについて将来の利用終了が見込まれるため帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、回収可能価額として使用価値を用いておりますが、割引率については使用見込期間が短いめ考慮していません。

(株主資本等変動計算書関係)

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

	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

2021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	2021年3月31日
④	効力発生日	2021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

2022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	2022年3月31日
⑤	効力発生日	2022年6月29日

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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

2022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	1株当たり配当額	28,713円
③	基準日	2022年3月31日
④	効力発生日	2022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

2023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	5,171,039千円
②	配当の原資	利益剰余金
③	1株当たり配当額	24,440円
④	基準日	2023年3月31日
⑤	効力発生日	2023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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
1年内	709,808千円	962,809千円
1年超	414,054千円	1,532,728千円
合計	1,123,863千円	2,495,537千円

(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37期(2022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（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（前事業年度の貸借対照表計上額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(2022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	—

第38期(2023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	1,579,691	1,579,691	—
(2) 金銭の信託	10,400,000	10,400,000	—
(3) 投資有価証券	12,022,365	12,022,365	—
資産計	24,002,056	24,002,056	—

(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

関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額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38期(2023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	51,733,041	—	—	—
金銭の信託	10,400,000	—	—	—
未収委託者報酬	16,753,855	—	—	—
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	1,579,691	4,859,714	1,433,213	—
合計	80,466,587	4,859,714	1,433,213	—

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。

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

第37期(2022年3月31日現在)

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

※財務諸表等規則附則（2021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、表には含めておりません。

(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。

第38期(2023年3月31日現在)

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券	—	1,579,691	—	1,579,691
金銭の信託	—	10,400,000	—	10,400,000
投資有価証券	1,794,704	10,227,661	—	12,022,365
資産計	1,794,704	22,207,352	—	24,002,056

(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）

1. 子会社株式及び関連会社株式

第37期（2022年3月31日現在）及び第38期（2023年3月31日現在）

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

2. その他有価証券

第37期(2022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。

第38期(2023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	8,983,713	7,558,314	1,425,399
	小計	8,983,713	7,558,314	1,425,399
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	15,018,343	15,474,760	△456,417
	小計	15,018,343	15,474,760	△456,417
合計		24,002,056	23,033,074	968,982

(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10,400,000千円、取得原価は10,400,000千円）を含めております。

3. 売却したその他有価証券

第37期（自 2021年4月1日 至 2022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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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	17,240	—	14,120

債券	—	—	—
その他	1,551,405	387,113	1,708
合計	1,568,645	387,113	15,828

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。

当事業年度において、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、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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,729,235 千円	3,723,521 千円
勤務費用	198,457	196,190
利息費用	21,549	25,925
数理計算上の差異の発生額	△46,069	△186,130
退職給付の支払額	△179,650	△176,727
過去勤務費用の発生額	—	—
退職給付債務の期末残高	3,723,521	3,582,778

（2）年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
年金資産の期首残高	2,649,846 千円	2,583,927 千円
期待運用収益	47,588	46,453
数理計算上の差異の発生額	1,824	△103,934
事業主からの拠出額	—	—
退職給付の支払額	△115,331	△100,694
年金資産の期末残高	2,583,927	2,425,752

（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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	2,675,015 千円	2,468,195 千円
年金資産	△2,583,927	△2,425,752
	91,087	42,442
非積立型制度の退職給付債務	1,048,506	1,114,583

未積立退職給付債務	1,139,593	1,157,025
未認識数理計算上の差異	205,679	281,343
未認識過去勤務費用	△288,681	△223,319
貸借対照表に計上された 負債と資産の純額	1,056,591	1,215,049
退職給付引当金	1,246,300	1,333,882
前払年金費用	△189,708	△118,832
貸借対照表に計上された 負債と資産の純額	1,056,591	1,215,049

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	198,457 千円	196,190 千円
利息費用	21,549	25,925
期待運用収益	△47,588	△46,453
数理計算上の差異の 費用処理額	△3,547	△6,532
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	109,013	1,600
確定給付制度に係る 退職給付費用	343,245	236,091

(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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
債券	62.0 %	63.6 %
株式	36.3	34.2
その他	1.7	2.2
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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
割引率	0.078～0.72%	0.066～1.13%
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151,370千円、当事業年度152,084千円であります。

(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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
繰延税金資産		

減損損失	410,082千円	499,742千円
投資有価証券評価損	65,490	47,876
未払事業税	165,702	169,997
賞与引当金	288,528	260,221
役員賞与引当金	25,799	29,828
役員退職慰労引当金	36,112	23,169
退職給付引当金	381,617	408,434
減価償却超過額	145,316	227,100
差入保証金	-	52,869
長期差入保証金	52,869	-
時効後支払損引当金	76,615	77,865
連結納税適用による時価評価	35,311	35,311
その他	76,257	177,003
繰延税金資産 小計	1,759,702	2,009,420
評価性引当額	—	—
繰延税金資産 合計	1,759,702	2,009,420
繰延税金負債		
前払年金費用	△58,088	△36,386
連結納税適用による時価評価	△1,149	△1,098
その他有価証券評価差額金	△717,957	△296,702
その他	△101	△101
繰延税金負債 合計	△777,296	△334,288
繰延税金資産の純額	982,406	1,675,132

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37期（2022年3月31日現在）及び第38期（2023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。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（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37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）及び第38期（自 2022年4月1日 至 2023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37期（自2021年4月1日 至 2022年3月31日）及び第38期（自 2022年4月1日 至 2023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37期（自 2021年4月1日 至 2022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5)	科目	期末残高 (注5)
親会社	(株)三菱UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税	連結納税に 伴う支払 (注1)	4,062,765 千円	その他未払金	3,887,520 千円
親会社	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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5)	科目	期末残高 (注5)
親会社	(株)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%	連結納税等	連結納税等に 伴う支払 (注4)	3,947,200 千円	その他未払金	77,007 千円

親会社	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	4,893,312 千円	未払手数料	790,279 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	463,416 千円	未払費用	253,093 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. 連結納税制度及びグループ通算制度に基づく法人税の支払予定額であります。
5. 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37期（自 2021年4月1日 至 2022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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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)	4,052,979 千円	未払手数料	868,785 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)	6,661,991 千円	未払手数料	1,218,051 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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1 株当たり純資産額	400,322.84円	415,979.76円
1 株当たり当期純利益金額	57,424.97円	48,881.17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. 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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益金額 (千円)	12,150,032	10,342,327
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)	12,150,032	10,342,327
普通株式の期中平均株式数 (株)	211,581	211,581

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（2023年3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 (2023年3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。
株式会社紀陽銀行	80,096 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。

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5月末現在）

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

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

第3【その他】

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

- (2) 投資信託説明書（交付目論見書）に、以下の趣旨の文言の全部または一部および有価証券届出書の主要内容を記載することがあります。
- ・ファンドに関する投資信託説明書（請求目論見書）を含む詳細な情報は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
 - ・本書には、約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されています。
 - ・ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
 - ・ファンドの商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認します。
 - ・ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
 - ・請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。（請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようお願いいたします。）
 - ・有価証券届出書の効力の発生の有無については、委託会社のホームページにて確認いただけます。効力が発生するまでに、本書の記載内容が訂正される場合があります。
- (3) 投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。
- (4) 目論見書は電磁的方法により提供されるほか、インターネット、電子媒体等に掲載されることがあります。
- (5) 投信評価機関、投信評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
- (6) 目論見書は「投資信託説明書」を別称として使用します。
- (7) 目論見書に委託会社のホームページアドレス等を掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨のご案内を記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2023年6月9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2022年4月1日から2023年3月31日までの第38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2023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

2023年7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 DC年金インデックス（先進国株式）の2022年5月21日から2023年5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 DC年金インデックス（先進国株式）の2023年5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、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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