

【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9月25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】	03-4223-3037
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン（ラップ向け）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	１兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

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

なお、便宜上1万口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】

販売会社が定める単位

申込単位は販売会社にご確認ください。

（７）【申込期間】

2023年 9月26日から2024年 9月24日まで

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

（８）【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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

（９）【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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

（１０）【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

（１１）【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

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

※同様の権利義務関係を規定する契約の名称は販売会社によって異なります。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

信託金の限度額は、5,000億円です。

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

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

商品分類表

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	
追加型	内外	その他資産 ()	ETF	特殊型 ()
		資産複合		

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回 年6回	グローバル (日本を除く)	ファミリー ファンド	あり (フルヘッジ)	日経225	ブル・ベア型
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ()	年12回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々 その他 ()	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	TOPIX	条件付運用型
不動産投信 その他資産 (投資信託証 券(株式 一 般))					その他 (MSCIコ クサイ・イン デックス(配 当込み、円 ヘッジ・円 ベース))	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型 その他 ()
資産複合 ()						

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

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

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

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	ＭＭＦ（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「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、円ヘッジ・円ベース)に連動する投資成果をめざします。

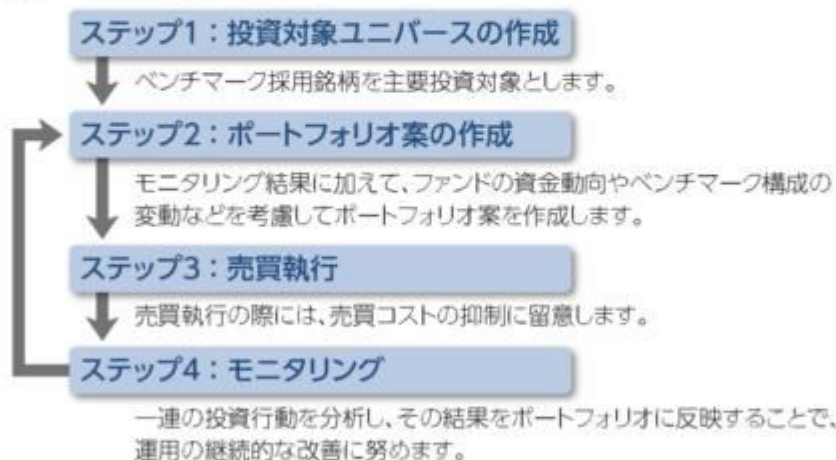
ファンドの特色

特色 1

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

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

＜運用プロセスのイメージ＞



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

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

特色2

主として日本を除く先進国の株式に投資を行います。

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

※実際の運用はヘッジ付外国株式インデックスマザーファンドを通じて行います。

特色3

原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をはかります。

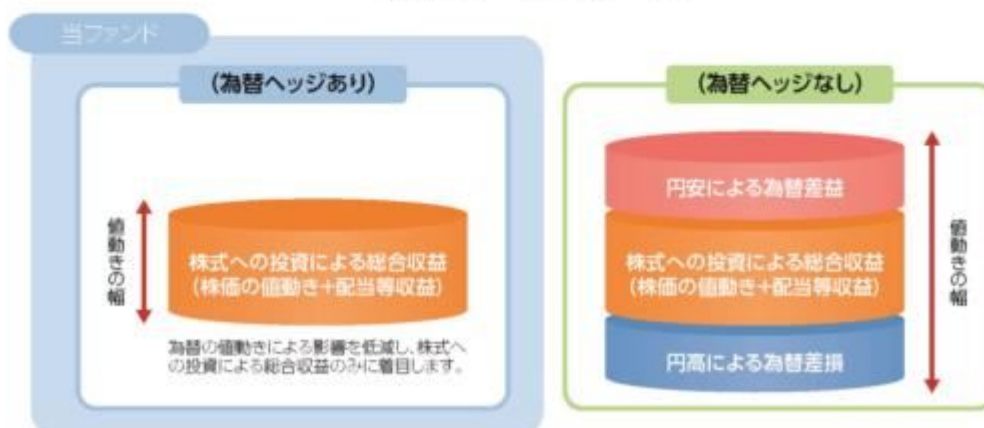
- 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をはかります。

為替ヘッジの活用

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

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

<投資リターンのイメージ>



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



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

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

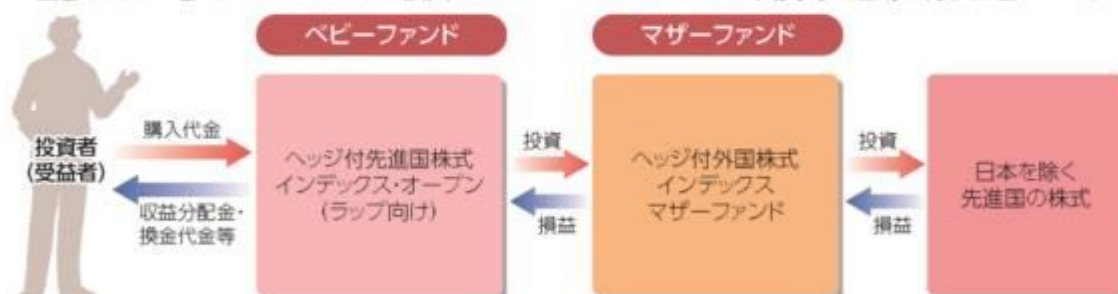
分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ファンドの仕組み

ファミリーファンド方式により運用を行います。

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



■主な投資制限

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

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

当ファンドは、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に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為にその使用を許諾されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に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いれる義務は一切ありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの募集等に関する事項の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定また計算について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

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

2022年1月27日

設定日、信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

①委託会社およびファンドの関係法人の役割

投資家（受益者）

お申込金↓↑収益分配金、解約代金等

販売会社

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

お申込金↓↑収益分配金、解約代金等

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

②委託会社と関係法人との契約の概要

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

③委託会社の概況（2023年6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】

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

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（２）【投資対象】

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。
 - ア．有価証券先物取引等
 - イ．スワップ取引
 - ハ．約束手形
 - ニ．金銭債権
- ２．次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形

②有価証券の指図範囲

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

- １．株券または新株引受権証書
- ２．国債証券
- ３．地方債証券
- ４．特別の法律により法人の発行する債券
- ５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- ６．資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
- ７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
- ８．協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）
- ９．資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
- 10．資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第13号で定めるものをいいます。）
- 11．コマーシャル・ペーパー
- 12．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 13．外国または外国の者の発行する証券または証書で、１．から12．の証券または証書の性質を有するもの
- 14．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
- 15．投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。16．において同じ。）で16．で定めるもの以外のもの
- 16．投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下16．において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

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

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

④その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

<ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンドの概要>

（基本方針）

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

（運用方法）

①投資対象

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

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。

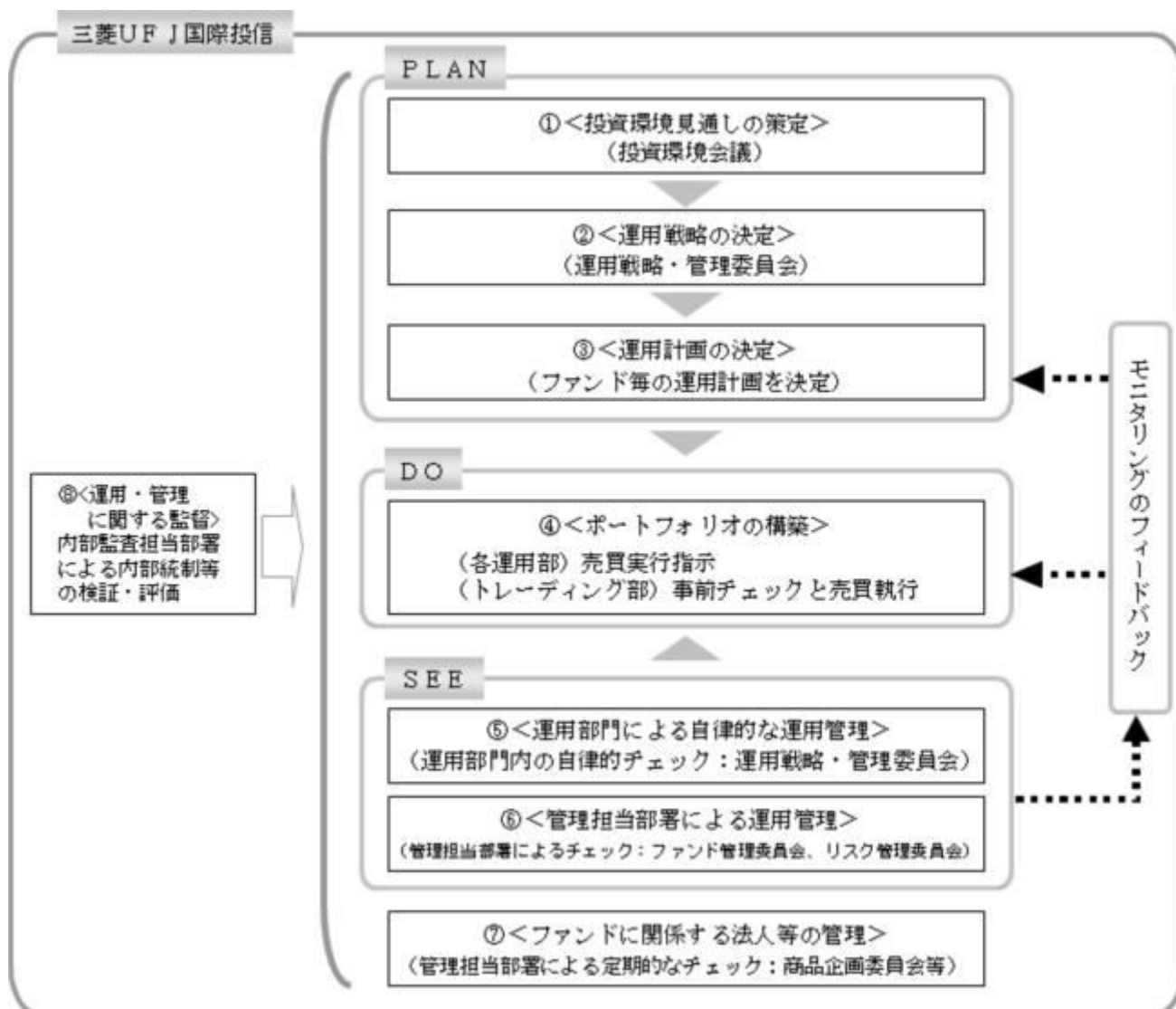
- ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。
- ・組入外貨建資産については、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、為替ヘッジ比率を引き下げる、あるいは為替ヘッジ比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

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

（投資制限）

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

（3）【運用体制】



①投資環境見通しの策定

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

②運用戦略の決定

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

③運用計画の決定

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

④ポートフォリオの構築

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

⑤運用部門による自律的な運用管理

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

⑥管理担当部署による運用管理

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

⑦ファンドに関係する法人等の管理

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

⑧運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

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

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

（５）【投資制限】

<信託約款に定められた投資制限>

①新株引受権証券および新株予約権証券

- a. 委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザー

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

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

②投資信託証券

- a. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（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、原則として、当該取引契約の相手方が提示する価額または価格情報会社の提供する価額によるものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（③に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（5. に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

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。

⑪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。

⑫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。

⑬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、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図りますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨の金利より低いときには、これらの金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。
信用リスク	株式の発行企業の経営、財務状況が悪化したり、市場においてその懸念が高まった場合には、株式の価格が下落すること、配当金が減額あるいは支払いが停止されること、倒産等によりその価値がなくなること等があります。
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ある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、換金の申込みの受付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、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動することをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、株価指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因により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、2023年1月～2023年6月です。
ベンチマークの年間騰落率は、2018年7月～2022年12月です。
基準価額(分配金再投資)は、2022年1月末～2023年6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7月末～2023年6月末)

ファンドの年間騰落率はベンチマーク(2022年12月以前)の年間騰落率を含みます。



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

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

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

ありません。

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

（２）【換金（解約）手数料】

かかりません。

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

（３）【信託報酬等】

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

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

※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

- ・信託報酬は、毎計算期間の6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。

- ・信託報酬率ならびに各支払先への配分は、以下の通りです。

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

※上記各支払先への配分には、別途消費税等相当額がかかります。

各支払先が信託報酬の対価として提供する役務の内容は以下の通りです。

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

（４）【その他の手数料等】

- ①委託会社は、信託財産に係る以下の費用（当該費用に係る消費税等相当額を含みます。）について毎計算期間の6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することができるものとします。委託会社は以下の費用の支払いを信託財産のために行い、支払金額の支弁を信託財産から受けることができ、また、現に信託財産のために支払った金額の支弁を受ける際に、あらかじめ受領する金額に上限を付することができます。この場合において、委託会社は、信託財産の規模等を考慮して、係る上限額を信託期間中に見直すことができます。

前記に基づいて実際に支払った金額の支弁を受ける代わりに、委託会社は、係る費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、実際の費用額にかかわらず合理的な見積率により計算した金額に係る費用の金額とみなして、その支弁を信託財産から受けることもできます。この場

合において、委託会社は、係る見積率に上限を付することとし、その上限の範囲内で、係る見積率を信託期間中に見直すことができるものとします。

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

1. 法律顧問・税務顧問への報酬
2. 受益権の管理事務に関連する費用等
3. 有価証券届出書、有価証券報告書、半期報告書および臨時報告書（これらの訂正に係る書類を含みます。）の作成および届出または提出に係る費用
4. 目論見書（訂正事項分を含みます。）の作成、印刷および交付に係る費用
5. 受益者に対してする公告に係る費用、ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用
6. 運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用

・信託財産に係る監査費用（当該監査費用に係る消費税等相当額を含みます。）の金額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。

・上記1. ～6. の費用および信託財産に係る監査費用の金額については、日々の純資産総額に以下の率を乗じて得た額を上限とします。

上限率	純資産総額に対して年率0.11%（税抜0.10%）
-----	---------------------------

②信託財産に関する以下の費用・報酬およびそれに付随する消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払います。

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

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

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

（5）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

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6月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

【ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン（ラップ向け）】

（1）【投資状況】

2023年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	2,002,300,083	100.00

コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	94,089	0.00
純資産総額		2,002,394,172	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 6月30日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受 益証券	ヘッジ付外国株式インデックスマ ザーファンド	791,266,581	2.5002	1,978,369,957	2.5305	2,002,300,083	100.00

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2023年 6月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

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

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6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 (2022年 6月27日)	271,694,777	271,694,777	8,970	8,970

第2計算期間末日	(2023年 6月26日)	1,964,937,556	1,964,937,556	9,602	9,602
	2022年 6月末日	290,593,678	—	8,802	—
	7月末日	519,936,431	—	9,272	—
	8月末日	600,472,060	—	9,091	—
	9月末日	698,852,023	—	8,291	—
	10月末日	908,424,545	—	8,841	—
	11月末日	1,018,150,300	—	9,043	—
	12月末日	1,114,054,187	—	8,807	—
	2023年 1月末日	1,280,791,108	—	9,211	—
	2月末日	1,368,724,546	—	9,144	—
	3月末日	1,485,774,312	—	9,201	—
	4月末日	1,616,261,253	—	9,359	—
	5月末日	1,780,896,236	—	9,410	—
	6月末日	2,002,394,172	—	9,718	—

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

③【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	△10.30
第2計算期間	7.04

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	302,884,425	—	302,884,425
第2計算期間	1,794,637,602	51,100,985	2,046,421,042

（参考）

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

2023年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	アメリカ	22,290,457,385	69.64
	イギリス	1,312,678,130	4.10
	カナダ	1,050,725,329	3.28
	フランス	1,017,463,790	3.18
	スイス	914,819,760	2.86
	ドイツ	764,608,717	2.39
	オーストラリア	629,413,663	1.97
	オランダ	559,958,677	1.75
	スウェーデン	290,892,421	0.91
	デンマーク	271,017,002	0.85
	スペイン	227,225,051	0.71
	香港	211,981,019	0.66
	イタリア	162,988,686	0.51
	シンガポール	99,771,375	0.31
	フィンランド	78,892,882	0.25
	アイルランド	71,315,898	0.22
	ベルギー	68,213,673	0.21
	ノルウェー	56,895,626	0.18
	イスラエル	34,923,360	0.11
	ニュージーランド	18,356,190	0.06
	ルクセンブルグ	18,217,940	0.06
	ポルトガル	18,080,197	0.06
	オーストリア	14,799,696	0.05
	小計	30,183,696,467	94.30
投資証券	アメリカ	546,797,556	1.71
	オーストラリア	35,684,766	0.11
	フランス	12,609,883	0.04
	シンガポール	10,748,869	0.03
	イギリス	10,294,960	0.03
	香港	8,398,260	0.03
	ベルギー	1,592,088	0.00
	カナダ	1,501,894	0.00
	小計	627,628,276	1.96
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	1,197,922,456	3.74
純資産総額		32,009,247,199	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 6月30日現在
(単位：円)

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,929,418,177	6.03
	買建	カナダ	78,941,293	0.25
	買建	ドイツ	303,726,720	0.95
	買建	オーストラリア	85,642,322	0.27
	買建	イギリス	109,506,552	0.34
	買建	スイス	72,264,700	0.23

（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 6月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	63,880	25,192.01	1,609,265,759	27,488.65	1,755,975,224	5.49
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	28,521	44,962.84	1,282,385,414	48,578.89	1,385,518,793	4.33
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	37,303	16,264.97	606,732,482	18,544.22	691,755,076	2.16
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	9,925	41,435.24	411,244,779	59,187.81	587,439,092	1.84
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	11,552	24,989.85	288,682,827	37,334.92	431,293,054	1.35
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	23,942	16,901.48	404,655,337	17,268.30	413,437,854	1.29
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	21,788	16,949.33	369,292,024	17,400.24	379,116,645	1.18
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	8,897	34,187.19	304,163,448	40,819.03	363,166,952	1.13
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	3,798	70,865.31	269,146,456	69,079.03	262,362,177	0.82
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	5,186	46,779.57	242,598,869	48,848.58	253,328,741	0.79
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	16,317	15,338.49	250,278,175	15,470.43	252,431,055	0.79

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	10,491	23,341.94	244,880,294	23,792.85	249,610,884	0.78
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	11,812	19,725.88	233,002,207	20,795.91	245,641,356	0.77
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	6,523	33,494.13	218,482,275	33,974.05	221,612,773	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	3,287	63,150.39	207,575,347	67,346.40	221,367,634	0.69
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	1,691	91,005.87	153,890,932	125,064.02	211,483,265	0.66
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	9,502	22,385.00	212,702,328	21,658.60	205,800,076	0.64
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	11,101	18,565.86	206,099,659	17,234.43	191,319,461	0.60
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	3,394	55,587.71	188,664,709	56,208.27	190,770,880	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	4,061	41,712.17	169,393,135	44,630.82	181,245,767	0.57
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	1,642	93,504.07	153,533,699	105,339.83	172,968,017	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	10,193	17,043.57	173,725,155	16,462.16	167,798,844	0.52
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	7,250	22,650.33	164,214,949	22,653.23	164,235,973	0.51
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	耐久消費財・アパレル	1,135	139,885.76	158,770,338	134,748.00	152,938,980	0.48
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6,663	24,452.49	162,926,981	22,573.48	150,407,151	0.47
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	5,550	28,322.34	157,189,024	26,660.76	147,967,225	0.46
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	16,505	9,259.06	152,820,808	8,702.29	143,631,458	0.45
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	1,805	72,769.03	131,348,101	77,089.73	139,146,968	0.43
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	7,079	21,254.08	150,457,661	19,317.01	136,745,168	0.43
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	5,966	22,200.86	132,450,383	22,369.05	133,453,795	0.42

（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 6月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	エネルギー	4.64

	素材	3.94
	資本財	6.51
	商業・専門サービス	1.58
	運輸	1.78
	自動車・自動車部品	2.22
	耐久消費財・アパレル	1.67
	消費者サービス	2.09
	メディア・娯楽	5.54
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.26
	生活必需品流通・小売り	1.67
	食品・飲料・タバコ	3.84
	家庭用品・パーソナル用品	1.67
	ヘルスケア機器・サービス	4.49
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.08
	銀行	5.10
	金融サービス	6.27
	保険	2.93
	ソフトウェア・サービス	9.13
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.86
	電気通信サービス	1.19
	公益事業	2.78
	半導体・半導体製造装置	5.80
	不動産管理・開発	0.27
	小計	94.30
投資証券	—	1.96
合計		96.26

（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 6月30日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2309	買建	60	アメリカドル	13,189,172.3	1,912,298,091	13,307,250	1,929,418,177	6.03
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602309	買建	3	カナダドル	714,996.25	78,177,690	721,980	78,941,293	0.25

	ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO ST 2309	買建	44	ユーロ	1,920,247.92	302,631,072	1,927,200	303,726,720	0.95
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2309	買建	5	オーストラリアドル	888,763.75	85,116,904	894,250	85,642,322	0.27
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2309	買建	8	イギリスポンド	606,115	110,888,739	598,560	109,506,552	0.34
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX2309	買建	4	スイスフラン	452,627.4	72,959,010	448,320	72,264,700	0.23

（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。

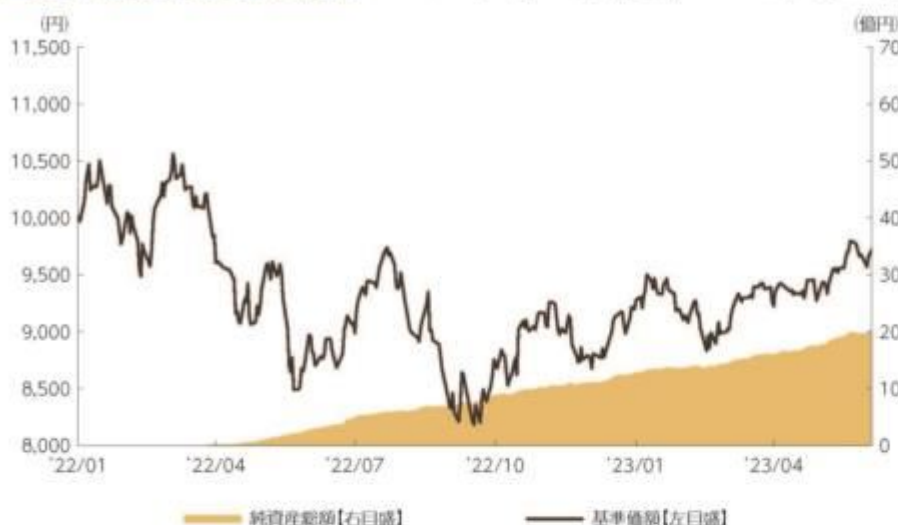
《参考情報》



運用実績

2023年6月30日現在

■基準価額・純資産の推移 2022年1月27日(設定日)～2023年6月30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	9,718円
純資産総額	20.0億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2023年6月	0円
2022年6月	0円
設定来累計	0円

●分配金は1万口当たり、税引前

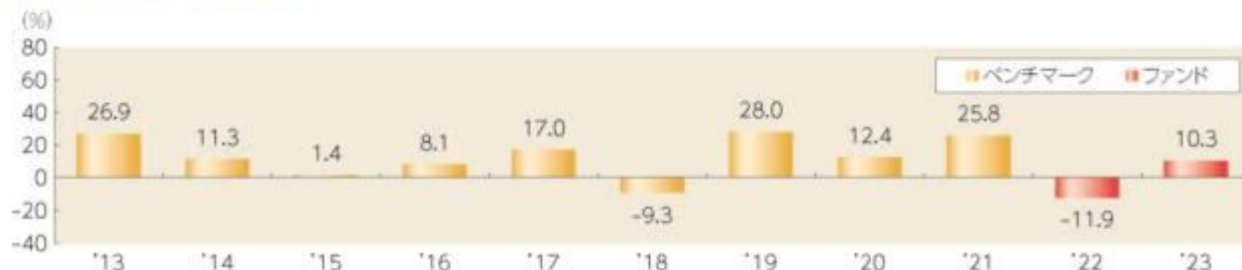
■主要な資産の状況

組入通貨	比率	組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
1 円	99.0%	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	5.5%
その他	1.0%	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	4.3%
		3 AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	アメリカ	2.2%
		4 NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	アメリカ	1.8%
		5 TESLA INC	自動車・自動車部品	アメリカ	1.3%
		6 ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	アメリカ	1.3%
		7 ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	アメリカ	1.2%
		8 META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	アメリカ	1.1%
		9 UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	アメリカ	0.8%
		10 BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	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）	8.1%

- 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
- 2022年は設定日から年末までの、2023年は年初から6月30日までの収益率を表示
- 2021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

販売会社が定める単位

③申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

④申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑤申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認ください。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑥申込手数料

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。

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

⑧申込受付時間

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

⑨取得申込みの受付の中止および取消し

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

販売会社が定める単位

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、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の受付を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

①基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

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

（資産の評価方法）

・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

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

・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

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

・公社債等

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

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

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

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

・外国為替予約取引

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

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

②基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

③基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限（2022年１月27日設定）

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

（４）【計算期間】

毎年６月26日から翌年６月25日まで

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

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

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、これを行行使することができます。なお、受益者が議決権を行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。

①分配金受取コース（一般コース）

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

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

②分配金再投資コース（累積投資コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、「累積投資契約」に基づいて、決算日の基準価額により自

動的に無手数料で全額再投資されます。

（２）償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

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

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

（３）換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

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

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（2022年 6月28日から2023年 6月26日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン（ラップ向け）】

（１）【貸借対照表】

(単位：円)		
	第1期 [2022年 6月27日現在]	第2期 [2023年 6月26日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	58,761	1,519,183
親投資信託受益証券	271,674,141	1,964,762,465
流動資産合計	271,732,902	1,966,281,648
資産合計	271,732,902	1,966,281,648
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	5,956	246,070
未払委託者報酬	12,423	516,694
未払利息	-	3
その他未払費用	19,746	581,325
流動負債合計	38,125	1,344,092
負債合計	38,125	1,344,092
純資産の部		
元本等		
元本	302,884,425	2,046,421,042
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△31,189,648	△81,483,486
（分配準備積立金）	469,282	105,280,300
元本等合計	271,694,777	1,964,937,556
純資産合計	271,694,777	1,964,937,556
負債純資産合計	271,732,902	1,966,281,648

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2022年 1月27日 至 2022年 6月27日	第2期 自 2022年 6月28日 至 2023年 6月26日
営業収益		
有価証券売買等損益	△6,116,201	115,480,612
営業収益合計	△6,116,201	115,480,612
営業費用		
支払利息	-	281
受託者報酬	5,956	366,000
委託者報酬	12,423	768,471
その他費用	19,746	640,958
営業費用合計	38,125	1,775,710
営業利益又は営業損失（△）	△6,154,326	113,704,902
経常利益又は経常損失（△）	△6,154,326	113,704,902
当期純利益又は当期純損失（△）	△6,154,326	113,704,902
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（△）	-	2,461,638
期首剰余金又は期首欠損金（△）	-	△31,189,648
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	5,148,184
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	5,148,184
剰余金減少額又は欠損金増加額	25,035,322	166,685,286
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	25,035,322	166,685,286
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△31,189,648	△81,483,486

(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6月25日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間および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6月28日から2023年 6月26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1期 [2022年 6月27日現在]	第2期 [2023年 6月26日現在]
1. 期首元本額	1,000,000円	302,884,425円
期中追加設定元本額	301,884,425円	1,794,637,602円
期中一部解約元本額	一円	51,100,985円
2. 元本の欠損		
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	31,189,648円	81,483,486円
3. 受益権の総数	302,884,425口	2,046,421,042口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2022年 1月27日 至 2022年 6月27日			第2期 自 2022年 6月28日 至 2023年 6月26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	469,282円	費用控除後の配当等収益額	A	23,549,384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	一円	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	81,276,223円
収益調整金額	C	281,217円	収益調整金額	C	6,581,868円
分配準備積立金額	D	一円	分配準備積立金額	D	454,693円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	750,499円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	111,862,168円
当ファンドの期末残存口数	F	302,884,425口	当ファンドの期末残存口数	F	2,046,421,042口

第1期 自 2022年 1月27日 至 2022年 6月27日			第2期 自 2022年 6月28日 至 2023年 6月26日		
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	24円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	546円
1万口当たり分配金額	H	－円	1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	－円	収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	－円

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第1期 自 2022年 1月27日 至 2022年 6月27日	第2期 自 2022年 6月28日 至 2023年 6月26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1期 [2022年 6月27日現在]	第2期 [2023年 6月26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	(1) 有価証券

区分	第1期 [2022年 6月27日現在]	第2期 [2023年 6月26日現在]
	売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同左 （２）デリバティブ取引 同左 （３）上記以外の金融商品 同左
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 [2022年 6月27日現在]	第2期 [2023年 6月26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	△6,105,853	114,723,447
合計	△6,105,853	114,723,447

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	第1期 [2022年 6月27日現在]	第2期 [2023年 6月26日現在]
1口当たり純資産額	0.8970円	0.9602円
(1万口当たり純資産額)	(8,970円)	(9,602円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	785,810,689	1,964,762,465	
合計		785,810,689	1,964,762,465	

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドの主要投資対象の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2023年 6月26日現在]	
資産の部	
流動資産	
預金	896,363,190
コール・ローン	656,633,510
株式	29,587,477,842

[2023年 6月26日現在]

投資証券	597,821,276
派生商品評価勘定	403,924
未収入金	281,816
未収配当金	33,892,906
差入委託証拠金	509,163,490
流動資産合計	32,282,037,954
資産合計	32,282,037,954
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,076,812,015
未払解約金	24,462,952
未払利息	1,650
流動負債合計	1,101,276,617
負債合計	1,101,276,617
純資産の部	
元本等	
元本	12,470,959,896
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	18,709,801,441
元本等合計	31,180,761,337
純資産合計	31,180,761,337
負債純資産合計	32,282,037,954

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 6月26日現在]
1. 期首	2022年 6月28日
期首元本額	7,242,821,151円
期中追加設定元本額	7,555,557,872円

	[2023年 6月26日現在]
期中一部解約元本額	2,327,419,127円
元本の内訳※	
つみたて先進国株式（為替ヘッジあり）	623,634,169円
ラップ向けインデックスf 先進国株式（為替ヘッジあり）	3,730,863,237円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	13,590,414円
ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン（ラップ向け）	785,810,689円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	31,301,918円
ヘッジ付先進国株式インデックスオープン	483,501,240円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	957,674,882円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	1,154,852円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	995,022,167円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	1,335,578,560円
MUKAM ヘッジ付外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	1,725,105,421円
MUKAM ヘッジ付外国株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	1,369,660,630円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07（適格機関投資家限定）	22,000,341円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09（適格機関投資家限定）	21,619,842円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11（適格機関投資家限定）	21,436,099円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01（適格機関投資家限定）	21,465,912円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03（適格機関投資家限定）	22,579,810円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05（適格機関投資家限定）	22,660,076円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07（適格機関投資家限定）	22,121,197円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09（適格機関投資家限定）	21,314,355円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11（適格機関投資家限定）	22,543,390円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01（適格機関投資家限定）	23,276,679円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03（適格機関投資家限定）	23,459,282円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05（適格機関投資家限定）	24,769,405円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07（適格機関投資家限定）	25,809,044円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09（適格機関投資家限定）	25,466,024円

	[2023年 6月26日現在]
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11（適格機関投資家限定）	24,009,488円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01（適格機関投資家限定）	25,019,907円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03（適格機関投資家限定）	24,011,522円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05（適格機関投資家限定）	24,499,344円
合計	12,470,959,896円
2. 受益権の総数	12,470,959,896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 6月28日 至 2023年 6月26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、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 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 6月26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った場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[2023年 6月26日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	942,880,128
投資証券	△25,600,412
合計	917,279,716

(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 6月26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	2,093,810,874	—	2,085,422,556	△8,388,318
合計		2,093,810,874	—	2,085,422,556	△8,388,318

（注）時価の算定方法

- 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。
- 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 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 6月26日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカドル	21,569,071,597	—	22,235,504,000	△666,432,403
	カナダドル	1,048,899,126	—	1,116,614,400	△67,715,274
	オーストラリアドル	690,256,160	—	728,062,680	△37,806,520
	イギリスポンド	1,373,221,745	—	1,449,353,118	△76,131,373
	スイスフラン	957,493,511	—	994,612,840	△37,119,329
	香港ドル	231,966,996	—	239,028,088	△7,061,092
	シンガポールドル	121,157,988	—	124,726,560	△3,568,572
	ニュージーランドドル	23,092,080	—	24,247,657	△1,155,577
	スウェーデンクローネ	306,021,785	—	319,486,982	△13,465,197
	ノルウェークローネ	61,586,602	—	65,600,281	△4,013,679
	デンマーククローネ	295,735,957	—	309,056,760	△13,320,803
	イスラエルシェケル	37,704,798	—	39,808,925	△2,104,127
	ユーロ	3,037,916,883	—	3,176,042,710	△138,125,827
合計		29,754,125,228	—	30,822,145,001	△1,068,019,773

（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 6月26日現在]
1口当たり純資産額	2.5003円
(1万口当たり純資産額)	(25,003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	1,381	32.58	44,992.98	
	BAKER HUGHES CO	3,957	29.77	117,799.89	
	CHENIERE ENERGY INC	955	148.56	141,874.80	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	540	80.59	43,518.60	
	CHEVRON CORP	7,250	151.35	1,097,287.50	
	CONOCOPHILLIPS	4,918	100.46	494,062.28	
	COTERRA ENERGY INC	3,107	23.72	73,698.04	
	DEVON ENERGY CORP	2,585	47.15	121,882.75	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	672	125.40	84,268.80	
	EOG RESOURCES INC	2,437	106.82	260,320.34	
	EQT CORP	1,520	39.18	59,553.60	
	EXXON MOBIL CORP	16,317	102.40	1,670,860.80	
	HALLIBURTON CO	3,571	30.89	110,308.19	
	HESS CORP	1,077	131.61	141,743.97	
	HF SINCLAIR CORP	446	42.50	18,955.00	
	KINDER MORGAN INC	8,137	16.32	132,795.84	
	MARATHON OIL CORP	2,173	21.95	47,697.35	
	MARATHON PETROLEUM CORP	1,774	111.64	198,049.36	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	2,863	56.07	160,528.41	
	ONEOK INC	1,779	57.69	102,630.51	
	OVINTIV INC	938	34.97	32,801.86	
	PHILLIPS 66	1,885	90.86	171,271.10	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	957	198.66	190,117.62	
	SCHLUMBERGER LTD	5,874	46.59	273,669.66	
	TARGA RESOURCES CORP	851	69.92	59,501.92	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	26	1,282.66	33,349.16	
	VALERO ENERGY CORP	1,521	111.30	169,287.30	
	WILLIAMS COS INC	4,899	30.59	149,860.41	

AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	914	286.26	261,641.64
ALBEMARLE CORP	449	220.18	98,860.82
ALCOA CORP	862	32.84	28,308.08
AMCOR PLC	6,258	9.87	61,766.46
AVERY DENNISON CORP	332	167.85	55,726.20
BALL CORP	1,280	55.81	71,436.80
CELANESE CORP	473	109.46	51,774.58
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	930	70.56	65,620.80
CLEVELAND-CLIFFS INC	2,523	15.83	39,939.09
CORTEVA INC	2,759	57.23	157,897.57
CROWN HOLDINGS INC	588	85.74	50,415.12
DOW INC	2,779	51.36	142,729.44
DUPONT DE NEMOURS INC	1,800	67.78	122,004.00
EASTMAN CHEMICAL CO	423	78.55	33,226.65
ECOLAB INC	1,074	178.15	191,333.10
FMC CORP	521	105.73	55,085.33
FREEPORT-MCMORAN INC	5,706	38.37	218,939.22
INTERNATIONAL PAPER CO	1,396	30.60	42,717.60
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,033	75.28	77,764.24
LINDE PLC	1,924	370.59	713,015.16
LYONDELLBASELL INDU-CL A	1,137	88.33	100,431.21
MARTIN MARIETTA MATERIALS	251	442.38	111,037.38
MOSAIC CO/THE	1,405	34.21	48,065.05
NEWMONT CORP	3,171	41.58	131,850.18
NUCOR CORP	995	153.79	153,021.05
PACKAGING CORP OF AMERICA	405	128.82	52,172.10
PPG INDUSTRIES INC	898	138.89	124,723.22
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	259	258.26	66,889.34
RPM INTERNATIONAL INC	565	82.17	46,426.05
SEALED AIR CORP	377	38.06	14,348.62
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,031	247.04	254,698.24
STEEL DYNAMICS INC	662	102.68	67,974.16
VULCAN MATERIALS CO	532	214.43	114,076.76
WESTLAKE CORP	104	112.80	11,731.20
WESTROCK CO	987	27.23	26,876.01
3M CO	2,211	100.72	222,691.92
AECOM	606	84.99	51,503.94
AERCAP HOLDINGS NV	668	60.60	40,480.80
ALLEGION PLC	388	115.50	44,814.00
AMETEK INC	863	156.06	134,679.78
AXON ENTERPRISE INC	301	188.71	56,801.71
BOEING CO/THE	2,329	205.41	478,399.89

BUILDERS FIRSTSOURCE INC	600	127.52	76,512.00
CARLISLE COS INC	214	241.66	51,715.24
CARRIER GLOBAL CORP	3,352	48.05	161,063.60
CATERPILLAR INC	2,124	234.44	497,950.56
CUMMINS INC	537	232.02	124,594.74
DEERE & CO	1,172	404.45	474,015.40
DOVER CORP	525	141.13	74,093.25
EATON CORP PLC	1,619	194.46	314,830.74
EMERSON ELECTRIC CO	2,280	86.68	197,630.40
FASTENAL CO	2,245	56.89	127,718.05
FERGUSON PLC	865	150.62	130,286.30
FORTIVE CORP	1,470	71.03	104,414.10
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	502	67.57	33,920.14
GENERAC HOLDINGS INC	182	129.07	23,490.74
GENERAL DYNAMICS CORP	958	212.39	203,469.62
GENERAL ELECTRIC CO	4,400	103.78	456,632.00
GRACO INC	745	83.55	62,244.75
HEICO CORP	118	173.74	20,501.32
HEICO CORP-CLASS A	356	139.26	49,576.56
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	2,629	200.09	526,036.61
HOWMET AEROSPACE INC	1,320	46.35	61,182.00
HUBBELL INC	228	317.07	72,291.96
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	188	216.96	40,788.48
IDEX CORP	318	203.04	64,566.72
ILLINOIS TOOL WORKS	1,241	242.25	300,632.25
INGERSOLL-RAND INC	1,601	63.37	101,455.37
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	600	50.45	30,270.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	2,868	64.99	186,391.32
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	734	191.90	140,854.60
LENNOX INTERNATIONAL INC	83	311.71	25,871.93
LOCKHEED MARTIN CORP	960	459.36	440,985.60
MASCO CORP	957	55.26	52,883.82
NORDSON CORP	140	235.74	33,003.60
NORTHROP GRUMMAN CORP	606	454.05	275,154.30
OTIS WORLDWIDE CORP	1,649	86.37	142,424.13
OWENS CORNING	259	124.06	32,131.54
PACCAR INC	2,089	78.44	163,861.16
PARKER HANNIFIN CORP	537	370.12	198,754.44
PENTAIR PLC	593	60.12	35,651.16
QUANTA SERVICES INC	548	186.61	102,262.28
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	5,818	96.91	563,822.38
ROCKWELL AUTOMATION INC	435	313.27	136,272.45

SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	606	43.12	26,130.72	
SMITH (A.O.) CORP	579	69.49	40,234.71	
SNAP-ON INC	224	273.62	61,290.88	
STANLEY BLACK & DECKER INC	593	87.81	52,071.33	
TEXTRON INC	845	64.91	54,848.95	
TORO CO	482	97.41	46,951.62	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	859	186.16	159,911.44	
TRANSDIGM GROUP INC	221	850.26	187,907.46	
UNITED RENTALS INC	266	404.38	107,565.08	
WABTEC CORP	701	102.32	71,726.32	
WATSCO INC	100	365.27	36,527.00	
WW GRAINGER INC	176	737.90	129,870.40	
XYLEM INC	1,020	111.03	113,250.60	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,701	213.83	363,724.83	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	567	107.44	60,918.48	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	496	158.01	78,372.96	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	614	63.46	38,964.44	
CINTAS CORP	387	482.59	186,762.33	
CLARIVATE PLC	891	8.80	7,840.80	
COPART INC	1,730	89.19	154,298.70	
COSTAR GROUP INC	1,574	86.75	136,544.50	
EQUIFAX INC	483	224.03	108,206.49	
JACOBS SOLUTIONS INC	518	114.50	59,311.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	545	84.72	46,172.40	
PAYCHEX INC	1,281	108.38	138,834.78	
PAYCOM SOFTWARE INC	186	306.20	56,953.20	
PAYLOCITY HOLDING CORP	214	176.75	37,824.50	
REPUBLIC SERVICES INC	840	146.53	123,085.20	
ROBERT HALF INTL INC	540	70.53	38,086.20	
ROLLINS INC	1,097	41.39	45,404.83	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	968	58.49	56,618.32	
TRANSUNION	757	74.22	56,184.54	
VERISK ANALYTICS INC	611	224.35	137,077.85	
WASTE CONNECTIONS INC	985	136.10	134,058.50	
WASTE MANAGEMENT INC	1,587	165.59	262,791.33	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	394	90.45	35,637.30	
CSX CORP	8,171	32.74	267,518.54	
DELTA AIR LINES INC	476	42.86	20,401.36	
EXPEDITORS INTL WASH INC	650	114.45	74,392.50	
FEDEX CORP	930	232.34	216,076.20	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	8,000	3.20	25,600.00	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	334	175.18	58,510.12	

KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	739	54.00	39,906.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	864	218.00	188,352.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	359	326.63	117,260.17
SOUTHWEST AIRLINES CO	710	33.93	24,090.30
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	407	46.74	19,023.18
UBER TECHNOLOGIES INC	7,297	43.34	316,251.98
UNION PACIFIC CORP	2,421	199.89	483,933.69
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	2,872	169.29	486,200.88
APTIV PLC	1,049	97.40	102,172.60
BORGWARNER INC	1,045	45.23	47,265.35
FORD MOTOR CO	15,802	14.02	221,544.04
GENERAL MOTORS CO	5,582	36.18	201,956.76
LEAR CORP	246	136.39	33,551.94
LUCID GROUP INC	2,600	5.47	14,222.00
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	2,600	13.53	35,178.00
TESLA INC	11,552	256.60	2,964,243.20
DECKERS OUTDOOR CORP	100	506.12	50,612.00
DR HORTON INC	1,237	120.40	148,934.80
GARMIN LTD	586	101.56	59,514.16
HASBRO INC	479	60.00	28,740.00
LENNAR CORP-A	1,040	122.30	127,192.00
LULULEMON ATHLETICA INC	444	374.25	166,167.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	145	97.82	14,183.90
NIKE INC -CL B	4,977	109.52	545,081.04
NVR INC	13	6,160.21	80,082.73
PULTEGROUP INC	1,028	76.27	78,405.56
VF CORP	1,608	18.23	29,313.84
WHIRLPOOL CORP	242	140.59	34,022.78
AIRBNB INC-CLASS A	1,603	124.73	199,942.19
ARAMARK	898	39.29	35,282.42
BOOKING HOLDINGS INC	159	2,623.93	417,204.87
CAESARS ENTERTAINMENT INC	965	45.21	43,627.65
CARNIVAL CORP	3,757	15.80	59,360.60
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	118	2,043.68	241,154.24
DARDEN RESTAURANTS INC	506	161.30	81,617.80
DOMINO'S PIZZA INC	131	316.82	41,503.42
DOORDASH INC - A	1,061	72.64	77,071.04
EXPEDIA GROUP INC	624	104.79	65,388.96
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	1,044	137.11	143,142.84
HYATT HOTELS CORP - CL A	200	107.54	21,508.00
LAS VEGAS SANDS CORP	1,363	57.28	78,072.64
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	1,038	171.45	177,965.10

MCDONALD'S CORP	2,958	289.91	857,553.78
MGM RESORTS INTERNATIONAL	1,145	41.38	47,380.10
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	950	97.92	93,024.00
STARBUCKS CORP	4,588	98.34	451,183.92
VAIL RESORTS INC	200	243.63	48,726.00
WYNN RESORTS LTD	454	104.20	47,306.80
YUM! BRANDS INC	1,150	135.60	155,940.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	3,029	81.90	248,075.10
ALPHABET INC-CL A	23,942	122.34	2,929,064.28
ALPHABET INC-CL C	21,788	123.02	2,680,359.76
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	414	326.28	135,079.92
COMCAST CORP-CLASS A	16,979	40.09	680,688.11
ELECTRONIC ARTS INC	1,144	125.25	143,286.00
FOX CORP - CLASS A	1,178	32.67	38,485.26
FOX CORP - CLASS B	528	30.63	16,172.64
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	1,541	38.48	59,297.68
LIBERTY BROADBAND-C	429	70.76	30,356.04
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	740	29.72	21,992.80
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	796	75.56	60,145.76
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	727	87.76	63,801.52
MATCH GROUP INC	984	41.24	40,580.16
META PLATFORMS INC-CLASS A	8,897	288.73	2,568,830.81
NETFLIX INC	1,829	424.02	775,532.58
NEWS CORP - CLASS A	1,462	18.76	27,427.12
OMNICOM GROUP	895	93.18	83,396.10
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	2,488	15.36	38,215.68
PINTEREST INC- CLASS A	2,411	26.24	63,264.64
ROBLOX CORP -CLASS A	1,752	37.85	66,313.20
ROKU INC	664	62.57	41,546.48
SEA LTD-ADR	1,458	58.91	85,890.78
SIRIUS XM HOLDINGS INC	2,407	3.83	9,218.81
SNAP INC - A	4,643	10.82	50,237.26
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	662	141.85	93,904.70
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1,735	76.24	132,276.40
WALT DISNEY CO/THE	7,406	88.10	652,468.60
WARNER BROS DISCOVERY INC	9,395	11.79	110,767.05
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	1,200	23.99	28,788.00
ADVANCE AUTO PARTS INC	307	65.67	20,160.69
AMAZON.COM INC	37,303	129.33	4,824,396.99
AUTOZONE INC	79	2,423.73	191,474.67
BATH & BODY WORKS INC	841	37.21	31,293.61
BEST BUY CO INC	749	79.13	59,268.37

BURLINGTON STORES INC	262	157.98	41,390.76
CARMAX INC	691	86.21	59,571.11
CHEWY INC - CLASS A	222	39.25	8,713.50
DICK'S SPORTING GOODS INC	200	134.57	26,914.00
EBAY INC	2,146	43.37	93,072.02
ETSY INC	453	88.93	40,285.29
GENUINE PARTS CO	561	159.67	89,574.87
HOME DEPOT INC	4,061	300.81	1,221,589.41
LKQ CORP	1,045	54.42	56,868.90
LOWE'S COS INC	2,388	215.22	513,945.36
MERCADOLIBRE INC	191	1,226.49	234,259.59
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	262	924.76	242,287.12
POOL CORP	132	352.34	46,508.88
ROSS STORES INC	1,333	108.66	144,843.78
TJX COMPANIES INC	4,678	82.06	383,876.68
TRACTOR SUPPLY COMPANY	484	218.70	105,850.80
ULTA BEAUTY INC	199	453.45	90,236.55
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	1,100	21.46	23,606.00
COSTCO WHOLESALE CORP	1,805	524.44	946,614.20
DOLLAR GENERAL CORP	852	171.15	145,819.80
DOLLAR TREE INC	841	143.67	120,826.47
KROGER CO	2,771	46.14	127,853.94
SYSCO CORP	2,154	72.45	156,057.30
TARGET CORP	1,826	131.83	240,721.58
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	2,841	31.40	89,207.40
WALMART INC	5,966	155.46	927,474.36
ALTRIA GROUP INC	7,319	43.42	317,790.98
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	2,215	72.90	161,473.50
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	1,355	65.04	88,129.20
BUNGE LTD	544	94.04	51,157.76
CAMPBELL SOUP CO	772	45.59	35,195.48
COCA-COLA CO/THE	16,505	61.20	1,010,106.00
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	866	65.04	56,324.64
CONAGRA BRANDS INC	2,016	34.09	68,725.44
CONSTELLATION BRANDS INC-A	628	242.38	152,214.64
DARLING INGREDIENTS INC	749	58.84	44,071.16
GENERAL MILLS INC	2,352	81.32	191,264.64
HERSHEY CO/THE	600	259.09	155,454.00
HORMEL FOODS CORP	1,237	40.47	50,061.39
JM SMUCKER CO/THE	437	150.32	65,689.84
KELLOGG CO	1,166	65.16	75,976.56
KEURIG DR PEPPER INC	3,571	31.18	111,343.78

KRAFT HEINZ CO/THE	3,133	35.91	112,506.03
LAMB WESTON HOLDINGS INC	589	114.69	67,552.41
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	960	93.79	90,038.40
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	847	66.18	56,054.46
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	5,504	73.10	402,342.40
MONSTER BEVERAGE CORP	3,146	59.11	185,960.06
PEPSICO INC	5,550	186.07	1,032,688.50
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	6,287	96.30	605,438.10
TYSON FOODS INC-CL A	1,137	49.50	56,281.50
CHURCH & DWIGHT CO INC	983	97.12	95,468.96
CLOROX COMPANY	493	156.14	76,977.02
COLGATE-PALMOLIVE CO	3,122	77.11	240,737.42
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	961	191.94	184,454.34
KIMBERLY-CLARK CORP	1,323	136.97	181,211.31
PROCTER & GAMBLE CO/THE	9,502	148.46	1,410,666.92
ABBOTT LABORATORIES	7,003	108.05	756,674.15
ALIGN TECHNOLOGY INC	338	328.83	111,144.54
AMERISOURCEBERGEN CORP	693	187.67	130,055.31
BAXTER INTERNATIONAL INC	2,046	45.04	92,151.84
BECTON DICKINSON AND CO	1,174	256.55	301,189.70
BOSTON SCIENTIFIC CORP	5,889	53.97	317,829.33
CARDINAL HEALTH INC	1,058	91.72	97,039.76
CENTENE CORP	2,249	66.33	149,176.17
COOPER COS INC/THE	208	372.78	77,538.24
CVS HEALTH CORP	5,160	69.60	359,136.00
DAVITA INC	252	97.73	24,627.96
DENTSPLY SIRONA INC	1,089	38.44	41,861.16
DEXCOM INC	1,645	126.75	208,503.75
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,388	90.34	215,731.92
ELEVANCE HEALTH INC	973	450.40	438,239.20
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	1,652	79.82	131,862.64
HCA HEALTHCARE INC	788	295.40	232,775.20
HENRY SCHEIN INC	637	78.90	50,259.30
HOLOGIC INC	955	81.46	77,794.30
HUMANA INC	522	445.95	232,785.90
IDEXX LABORATORIES INC	316	487.78	154,138.48
INSULET CORP	310	287.85	89,233.50
INTUITIVE SURGICAL INC	1,375	327.26	449,982.50
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	345	234.83	81,016.35
MASIMO CORP	234	162.00	37,908.00
MCKESSON CORP	584	415.76	242,803.84
MEDTRONIC PLC	5,381	87.48	470,729.88

MOLINA HEALTHCARE INC	210	287.94	60,467.40
NOVOCURE LTD	437	41.77	18,253.49
QUEST DIAGNOSTICS INC	501	141.49	70,886.49
RESMED INC	557	215.27	119,905.39
STERIS PLC	402	210.81	84,745.62
STRYKER CORP	1,409	297.88	419,712.92
TELEFLEX INC	171	237.30	40,578.30
THE CIGNA GROUP	1,151	274.85	316,352.35
UNITEDHEALTH GROUP INC	3,798	477.00	1,811,646.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	186	151.43	28,165.98
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	545	200.76	109,414.20
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	811	143.99	116,775.89
ABBVIE INC	7,079	135.92	962,177.68
AGILENT TECHNOLOGIES INC	1,222	119.42	145,931.24
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	488	192.69	94,032.72
AMGEN INC	2,159	227.11	490,330.49
AVANTOR INC	3,146	19.67	61,881.82
BIO-RAD LABORATORIES-A	112	365.80	40,969.60
BIO-TECHNE CORP	659	76.62	50,492.58
BIOGEN INC	556	284.52	158,193.12
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	798	93.50	74,613.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	8,430	65.04	548,287.20
CATALENT INC	705	44.06	31,062.30
CHARLES RIVER LABORATORIES	215	207.81	44,679.15
DANAHER CORP	2,826	238.18	673,096.68
ELI LILLY & CO	3,287	458.84	1,508,207.08
EXACT SCIENCES CORP	736	92.62	68,168.32
GILEAD SCIENCES INC	4,976	77.47	385,490.72
HORIZON THERAPEUTICS PLC	845	102.56	86,663.20
ILLUMINA INC	614	201.67	123,825.38
INCYTE CORP	798	62.45	49,835.10
IQVIA HOLDINGS INC	708	214.06	151,554.48
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	301	124.86	37,582.86
JOHNSON & JOHNSON	10,491	165.48	1,736,050.68
MERCK & CO. INC.	10,193	114.60	1,168,117.80
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	86	1,288.25	110,789.50
MODERNA INC	1,386	118.50	164,241.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	430	96.39	41,447.70
PFIZER INC	22,758	38.30	871,631.40
REGENERON PHARMACEUTICALS	436	779.73	339,962.28
REPLIGEN CORP	257	149.57	38,439.49
REVVITY INC	525	115.97	60,884.25

ROYALTY PHARMA PLC- CL A	1,483	30.95	45,898.85
SEAGEN INC	599	198.22	118,733.78
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	4,974	7.62	37,901.88
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,597	524.21	837,163.37
UNITED THERAPEUTICS CORP	210	222.36	46,695.60
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,047	347.00	363,309.00
VIATRIS INC	5,020	9.76	48,995.20
WATERS CORP	194	259.84	50,408.96
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	296	367.00	108,632.00
ZOETIS INC	1,828	168.37	307,780.36
BANK OF AMERICA CORP	28,976	27.75	804,084.00
CITIGROUP INC	7,824	46.02	360,060.48
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,967	25.47	50,099.49
FIFTH THIRD BANCORP	2,707	25.54	69,136.78
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	33	1,208.38	39,876.54
FIRST HORIZON CORP	2,432	11.00	26,752.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	5,742	10.21	58,625.82
JPMORGAN CHASE & CO	11,812	138.85	1,640,096.20
KEYCORP	4,358	9.35	40,747.30
M & T BANK CORP	676	115.87	78,328.12
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,662	123.03	204,475.86
REGIONS FINANCIAL CORP	3,676	16.95	62,308.20
TRUIST FINANCIAL CORP	5,512	30.00	165,360.00
US BANCORP	5,836	31.88	186,051.68
WEBSTER FINANCIAL CORP	791	36.51	28,879.41
WELLS FARGO & CO	15,092	40.61	612,886.12
ALLY FINANCIAL INC	1,073	26.37	28,295.01
AMERICAN EXPRESS CO	2,513	168.07	422,359.91
AMERIPRISE FINANCIAL INC	451	317.02	142,976.02
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	2,136	20.12	42,976.32
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	1,734	73.00	126,582.00
ARES MANAGEMENT CORP - A	728	90.41	65,818.48
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	3,273	42.84	140,215.32
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	5,186	335.25	1,738,606.50
BLACKROCK INC	616	680.45	419,157.20
BLACKSTONE INC	2,926	87.84	257,019.84
BLOCK INC	2,184	62.86	137,286.24
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,584	106.60	168,854.40
CARLYLE GROUP INC/THE	967	30.00	29,010.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	446	135.33	60,357.18
CME GROUP INC	1,485	181.67	269,779.95
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	600	61.47	36,882.00

DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1,060	115.42	122,345.20
EQUITABLE HOLDINGS INC	1,599	25.43	40,662.57
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	127	394.05	50,044.35
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	2,394	52.75	126,283.50
FISERV INC	2,505	120.49	301,827.45
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	330	238.56	78,724.80
FRANKLIN RESOURCES INC	1,489	25.53	38,014.17
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	110	38.99	4,288.90
GLOBAL PAYMENTS INC	1,035	98.84	102,299.40
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,371	314.71	431,467.41
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	2,320	111.09	257,728.80
INVESCO LTD	864	16.01	13,832.64
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	304	162.80	49,491.20
KKR & CO INC	2,526	53.59	135,368.34
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	312	208.24	64,970.88
MARKETAXESS HOLDINGS INC	155	263.00	40,765.00
MASTERCARD INC - A	3,394	379.81	1,289,075.14
MOODY'S CORP	695	337.28	234,409.60
MORGAN STANLEY	5,039	83.58	421,159.62
MSCI INC	303	465.15	140,940.45
NASDAQ INC	1,306	49.64	64,829.84
NORTHERN TRUST CORP	913	71.28	65,078.64
PAYPAL HOLDINGS INC	4,328	66.94	289,716.32
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	829	97.19	80,570.51
S&P GLOBAL INC	1,271	390.36	496,147.56
SCHWAB (CHARLES) CORP	6,051	53.17	321,731.67
SEI INVESTMENTS COMPANY	291	56.98	16,581.18
STATE STREET CORP	1,405	71.07	99,853.35
SYNCHRONY FINANCIAL	1,598	32.70	52,254.60
T ROWE PRICE GROUP INC	912	106.33	96,972.96
TOAST INC-CLASS A	1,262	21.54	27,183.48
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	560	69.38	38,852.80
VISA INC-CLASS A SHARES	6,523	229.55	1,497,354.65
AFLAC INC	2,417	67.14	162,277.38
ALLSTATE CORP	1,003	107.53	107,852.59
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	329	116.03	38,173.87
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	3,052	55.22	168,531.44
AON PLC-CLASS A	835	331.43	276,744.05
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,424	72.41	103,111.84
ARTHUR J GALLAGHER & CO	874	212.46	185,690.04
ASSURANT INC	149	123.81	18,447.69
BROWN & BROWN INC	821	66.43	54,539.03

CHUBB LTD	1,662	193.24	321,164.88
CINCINNATI FINANCIAL CORP	596	95.71	57,043.16
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	72	211.10	15,199.20
EVEREST RE GROUP LTD	159	345.66	54,959.94
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	1,057	33.72	35,642.04
GLOBE LIFE INC	364	106.28	38,685.92
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	1,252	70.47	88,228.44
LOEWS CORP	842	57.90	48,751.80
MARKEL GROUP INC	62	1,324.05	82,091.10
MARSH & MCLENNAN COS	1,995	183.73	366,541.35
METLIFE INC	2,616	53.33	139,511.28
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	934	72.40	67,621.60
PROGRESSIVE CORP	2,361	132.77	313,469.97
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,379	83.89	115,684.31
TRAVELERS COS INC/THE	964	173.72	167,466.08
WILLIS TOWERS WATSON PLC	410	232.52	95,333.20
WR BERKLEY CORP	827	58.21	48,139.67
ACCENTURE PLC-CL A	2,588	298.43	772,336.84
ADOBE INC	1,818	484.72	881,220.96
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	689	88.63	61,066.07
ANSYS INC	340	319.54	108,643.60
ASPEN TECHNOLOGY INC	80	162.60	13,008.00
ATLASSIAN CORP-CL A	577	162.41	93,710.57
AUTODESK INC	833	202.00	168,266.00
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	800	51.72	41,376.00
BILL HOLDINGS INC	400	108.19	43,276.00
BLACK KNIGHT INC	749	57.00	42,693.00
CADENCE DESIGN SYS INC	1,155	225.32	260,244.60
CHECK POINT SOFTWARE TECH	457	126.06	57,609.42
CLOUDFLARE INC - CLASS A	1,056	63.41	66,960.96
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	2,069	62.04	128,360.76
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	904	143.65	129,859.60
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	113	153.17	17,308.21
DATADOG INC - CLASS A	994	93.67	93,107.98
DOCUSIGN INC	836	50.08	41,866.88
DROPBOX INC-CLASS A	810	26.33	21,327.30
DYNATRACE INC	918	50.58	46,432.44
EPAM SYSTEMS INC	257	214.00	54,998.00
FAIR ISAAC CORP	88	776.05	68,292.40
FORTINET INC	2,833	71.59	202,814.47
GARTNER INC	301	338.19	101,795.19
GEN DIGITAL INC	2,794	17.71	49,481.74

GODADDY INC - CLASS A	516	72.35	37,332.60
HUBSPOT INC	168	512.21	86,051.28
INTL BUSINESS MACHINES CORP	3,686	129.43	477,078.98
INTUIT INC	1,114	452.69	504,296.66
MICROSOFT CORP	28,521	335.02	9,555,105.42
MONDAY.COM LTD	100	169.52	16,952.00
MONGODB INC	242	389.99	94,377.58
OKTA INC	664	69.25	45,982.00
ORACLE CORP	6,492	118.64	770,210.88
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	7,085	14.03	99,402.55
PALO ALTO NETWORKS INC	1,174	243.94	286,385.56
PTC INC	440	140.86	61,978.40
ROPER TECHNOLOGIES INC	447	460.81	205,982.07
SALESFORCE INC	4,030	210.09	846,662.70
SERVICENOW INC	856	542.99	464,799.44
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,069	178.25	190,549.25
SPLUNK INC	666	100.98	67,252.68
SYNOPSYS INC	644	419.56	270,196.64
TWILIO INC - A	791	64.03	50,647.73
TYLER TECHNOLOGIES INC	175	396.93	69,462.75
UIPATH INC - CLASS A	1,500	15.73	23,595.00
UNITY SOFTWARE INC	946	37.47	35,446.62
VERISIGN INC	345	221.33	76,358.85
VMWARE INC-CLASS A	911	137.83	125,563.13
WIX.COM LTD	145	77.59	11,250.55
WORKDAY INC-CLASS A	871	222.25	193,579.75
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	819	66.62	54,561.78
ZSCALER INC	363	142.70	51,800.10
AMPHENOL CORP-CL A	2,485	80.19	199,272.15
APPLE INC	63,880	186.68	11,925,118.40
ARISTA NETWORKS INC	1,030	148.82	153,284.60
ARROW ELECTRONICS INC	176	135.08	23,774.08
CDW CORP/DE	522	177.40	92,602.80
CISCO SYSTEMS INC	16,498	50.33	830,344.34
COGNEX CORP	858	53.35	45,774.30
CORNING INC	3,488	33.86	118,103.68
DELL TECHNOLOGIES -C	1,032	50.87	52,497.84
F5 INC	216	144.45	31,201.20
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	5,165	16.52	85,325.80
HP INC	3,548	29.61	105,056.28
JUNIPER NETWORKS INC	1,570	29.91	46,958.70
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	701	157.98	110,743.98

MOTOROLA SOLUTIONS INC	698	278.61	194,469.78
NETAPP INC	881	73.21	64,498.01
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	796	60.32	48,014.72
TE CONNECTIVITY LTD	1,200	133.11	159,732.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	190	399.09	75,827.10
TRIMBLE INC	983	49.55	48,707.65
WESTERN DIGITAL CORP	1,340	37.86	50,732.40
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	249	264.33	65,818.17
AT&T INC	28,759	15.45	444,326.55
LIBERTY GLOBAL PLC- C	894	17.39	15,546.66
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,317	16.59	21,849.03
T-MOBILE US INC	2,430	132.80	322,704.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	16,871	35.51	599,089.21
AES CORP	2,649	20.43	54,119.07
ALLIANT ENERGY CORP	1,087	51.83	56,339.21
AMEREN CORPORATION	1,020	80.83	82,446.60
AMERICAN ELECTRIC POWER	2,129	83.49	177,750.21
AMERICAN WATER WORKS CO INC	805	145.76	117,336.80
ATMOS ENERGY CORP	580	114.42	66,363.60
CENTERPOINT ENERGY INC	2,304	28.47	65,594.88
CMS ENERGY CORP	1,208	58.59	70,776.72
CONSOLIDATED EDISON INC	1,456	90.74	132,117.44
CONSTELLATION ENERGY	1,260	90.36	113,853.60
DOMINION ENERGY INC	3,348	51.82	173,493.36
DTE ENERGY COMPANY	866	110.00	95,260.00
DUKE ENERGY CORP	3,091	89.72	277,324.52
EDISON INTERNATIONAL	1,651	67.76	111,871.76
ENTERGY CORP	800	97.13	77,704.00
ESSENTIAL UTILITIES INC	1,016	40.01	40,650.16
EVERGY INC	922	57.31	52,839.82
EVERSOURCE ENERGY	1,357	69.73	94,623.61
EXELON CORP	4,195	39.87	167,254.65
FIRSTENERGY CORP	2,094	38.49	80,598.06
NEXTERA ENERGY INC	8,113	74.17	601,741.21
NISOURCE INC	1,809	26.72	48,336.48
NRG ENERGY INC	885	34.69	30,700.65
P G & E CORP	7,262	16.89	122,655.18
PPL CORP	3,194	26.38	84,257.72
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	2,008	61.50	123,492.00
SEMPRA ENERGY	1,298	143.75	186,587.50
SOUTHERN CO/THE	4,321	70.45	304,414.45
UGI CORP	1,078	26.45	28,513.10

	VISTRA CORP	1,346	25.10	33,784.60	
	WEC ENERGY GROUP INC	1,209	87.90	106,271.10	
	XCEL ENERGY INC	2,155	62.10	133,825.50	
	ADVANCED MICRO DEVICES	6,449	110.01	709,454.49	
	ANALOG DEVICES INC	2,076	185.94	386,011.44	
	APPLIED MATERIALS INC	3,394	136.07	461,821.58	
	BROADCOM INC	1,691	822.15	1,390,255.65	
	ENPHASE ENERGY INC	580	158.69	92,040.20	
	ENTEGRIS INC	550	103.54	56,947.00	
	FIRST SOLAR INC	384	184.52	70,855.68	
	INTEL CORP	16,810	33.00	554,730.00	
	KLA CORP	578	456.95	264,117.10	
	LAM RESEARCH CORP	556	608.76	338,470.56	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	600	85.35	51,210.00	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	3,497	57.82	202,196.54	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	2,223	81.97	182,219.31	
	MICRON TECHNOLOGY INC	4,499	65.28	293,694.72	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	158	506.00	79,948.00	
	NVIDIA CORP	9,925	422.09	4,189,243.25	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	1,085	188.69	204,728.65	
	ON SEMICONDUCTOR	1,748	87.52	152,984.96	
	QORVO INC	409	97.32	39,803.88	
	QUALCOMM INC	4,470	113.43	507,032.10	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	651	102.02	66,415.02	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	244	243.65	59,450.60	
	TERADYNE INC	642	105.16	67,512.72	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	3,665	167.68	614,547.20	
	WOLFSPEED INC	583	49.45	28,829.35	
	CBRE GROUP INC - A	1,231	75.23	92,608.13	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	2,700	3.90	10,530.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	474	48.07	22,785.18	
	アメリカドル 小計	1,372,485		152,080,549.45 (21,822,038,040)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	1,700	18.01	30,617.00	
	CAMECO CORP	1,700	39.45	67,065.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	4,500	70.35	316,575.00	
	CENOVUS ENERGY INC	5,600	21.15	118,440.00	
	ENBRIDGE INC	8,400	47.74	401,016.00	
	IMPERIAL OIL LTD	1,000	63.38	63,380.00	
	KEYERA CORP	1,000	29.37	29,370.00	
	PARKLAND CORP	400	32.35	12,940.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	2,257	39.76	89,738.32	

SUNCOR ENERGY INC	5,700	37.51	213,807.00	
TC ENERGY CORP	4,100	51.81	212,421.00	
TOURMALINE OIL CORP	1,300	60.05	78,065.00	
AGNICO EAGLE MINES LTD	1,955	64.79	126,664.45	
BARRICK GOLD CORP	7,100	21.69	153,999.00	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	800	61.89	49,512.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	2,500	31.55	78,875.00	
FRANCO-NEVADA CORP	800	183.59	146,872.00	
IVANHOE MINES LTD-CL A	1,800	12.35	22,230.00	
KINROSS GOLD CORP	3,100	6.09	18,879.00	
LUNDIN MINING CORP	1,600	10.32	16,512.00	
NUTRIEN LTD	1,988	77.56	154,189.28	
PAN AMERICAN SILVER CORP	1,400	19.05	26,670.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	1,800	52.14	93,852.00	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	300	107.00	32,100.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,800	56.21	101,178.00	
CAE INC	1,700	28.00	47,600.00	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	400	104.30	41,720.00	
WSP GLOBAL INC	500	168.61	84,305.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	1,100	48.53	53,383.00	
RB GLOBAL INC	700	73.06	51,142.00	
THOMSON REUTERS CORP	723	176.17	127,370.91	
AIR CANADA	300	22.88	6,864.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	2,300	155.32	357,236.00	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	3,800	105.57	401,166.00	
TFI INTERNATIONAL INC	400	139.54	55,816.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	1,200	68.63	82,356.00	
BRP INC/CA- SUB VOTING	100	103.52	10,352.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	700	39.98	27,986.00	
RESTAURANT BRANDS INTERN	1,180	99.38	117,268.40	
QUEBECOR INC -CL B	400	31.52	12,608.00	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	200	170.53	34,106.00	
DOLLARAMA INC	1,200	86.36	103,632.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	3,200	63.48	203,136.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	1,000	35.51	35,510.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	600	116.39	69,834.00	
METRO INC/CN	1,000	71.91	71,910.00	
WESTON (GEORGE) LTD	216	152.35	32,907.60	
SAPUTO INC	700	29.63	20,741.00	
BANK OF MONTREAL	2,800	115.70	323,960.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	4,800	63.28	303,744.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	3,600	55.25	198,900.00	

	NATIONAL BANK OF CANADA	1,300	94.62	123,006.00	
	ROYAL BANK OF CANADA	5,600	122.32	684,992.00	
	TORONTO-DOMINION BANK	7,300	78.00	569,400.00	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	1,550	41.77	64,743.50	
	BROOKFIELD CORP	6,100	41.32	252,052.00	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	1,200	20.21	24,252.00	
	IGM FINANCIAL INC	200	39.26	7,852.00	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	200	35.81	7,162.00	
	ONEX CORPORATION	200	70.09	14,018.00	
	TMX GROUP LTD	1,500	28.47	42,705.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	60	965.07	57,904.20	
	GREAT-WEST LIFECO INC	800	37.19	29,752.00	
	IA FINANCIAL CORP INC	500	86.87	43,435.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	700	195.74	137,018.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	7,300	24.02	175,346.00	
	POWER CORP OF CANADA	2,200	34.36	75,592.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	2,700	66.40	179,280.00	
	CGI INC	800	134.11	107,288.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	80	2,660.96	212,876.80	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	400	100.86	40,344.00	
	OPEN TEXT CORP	1,300	52.87	68,731.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	4,900	84.11	412,139.00	
	BCE INC	200	58.82	11,764.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	1,500	58.57	87,855.00	
	TELUS CORP	1,100	25.35	27,885.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	2,900	10.61	30,769.00	
	ALTAGAS LTD	800	22.80	18,240.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	300	41.88	12,564.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	300	34.35	10,305.00	
	EMERA INC	1,300	53.38	69,394.00	
	FORTIS INC	2,000	55.43	110,860.00	
	HYDRO ONE LTD	1,500	37.13	55,695.00	
	NORTHLAND POWER INC	1,100	26.79	29,469.00	
	FIRSTSERVICE CORP	200	191.87	38,374.00	
	カナダドル 小計	159,509		9,363,583.46 (1,020,162,417)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	557	29.80	16,598.60	
	SANTOS LTD	13,333	7.30	97,330.90	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	7,688	33.74	259,393.12	
	BHP GROUP LTD	20,342	44.60	907,253.20	
	BLUESCOPE STEEL LTD	1,219	20.09	24,489.71	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	6,951	21.41	148,820.91	

IGO LTD	1,942	15.06	29,246.52
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	1,441	38.73	55,809.93
MINERAL RESOURCES LTD	566	71.96	40,729.36
NEWCREST MINING LTD	3,558	25.88	92,081.04
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	4,679	12.30	57,551.70
ORICA LTD	941	14.90	14,020.90
PILBARA MINERALS LTD	10,953	4.90	53,669.70
RIO TINTO LTD	1,585	113.13	179,311.05
SOUTH32 LTD	20,872	3.72	77,643.84
REECE LTD	697	18.26	12,727.22
BRAMBLES LTD	6,412	14.05	90,088.60
COMPUTERSHARE LTD	2,006	22.67	45,476.02
AURIZON HOLDINGS LTD	4,881	3.84	18,743.04
QANTAS AIRWAYS LTD	2,324	6.20	14,408.80
TRANSURBAN GROUP	12,501	14.22	177,764.22
ARISTOCRAT LEISURE LTD	2,536	38.03	96,444.08
IDP EDUCATION LTD	622	21.71	13,503.62
LOTTERY CORP LTD/THE	11,955	5.07	60,611.85
REA GROUP LTD	142	132.70	18,843.40
SEEK LTD	880	21.59	18,999.20
WESFARMERS LTD	4,560	48.07	219,199.20
COLES GROUP LTD	6,199	18.40	114,061.60
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	7,955	6.27	49,877.85
WOOLWORTHS GROUP LTD	4,697	39.86	187,222.42
TREASURY WINE ESTATES LTD	3,911	11.44	44,741.84
COCHLEAR LTD	321	227.96	73,175.16
RAMSAY HEALTH CARE LTD	745	54.92	40,915.40
SONIC HEALTHCARE LTD	2,069	34.74	71,877.06
CSL LTD	1,980	282.00	558,360.00
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	11,968	22.82	273,109.76
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	6,851	98.51	674,892.01
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	12,644	25.78	325,962.32
WESTPAC BANKING CORP	14,758	20.75	306,228.50
ASX LTD	952	61.63	58,671.76
MACQUARIE GROUP LTD	1,519	172.78	262,452.82
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	1,006	31.95	32,141.70
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	9,767	5.65	55,183.55
MEDIBANK PRIVATE LTD	10,961	3.60	39,459.60
QBE INSURANCE GROUP LTD	5,744	15.40	88,457.60
SUNCORP GROUP LTD	5,303	13.48	71,484.44
WISETECH GLOBAL LTD	877	76.80	67,353.60
XERO LTD	657	111.34	73,150.38

	TELSTRA GROUP LTD	13,973	4.32	60,363.36	
	APA GROUP	4,887	10.01	48,918.87	
	ORIGIN ENERGY LTD	7,063	8.46	59,752.98	
	LENDLEASE GROUP	1,565	7.00	10,955.00	
	オーストラリアドル 小計	284,515		6,489,529.31 (621,502,222)	
イギリスポンド	BP PLC	71,505	4.54	325,097.48	
	SHELL PLC	27,641	23.18	640,856.58	
	ANGLO AMERICAN PLC	5,129	22.48	115,299.92	
	ANTOFAGASTA PLC	2,067	14.52	30,023.17	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	508	55.64	28,265.12	
	ENDEAVOUR MINING PLC	700	18.86	13,202.00	
	GLENCORE PLC	42,640	4.32	184,481.96	
	JOHNSON MATTHEY PLC	520	16.79	8,733.40	
	MONDI PLC	1,934	11.85	22,917.90	
	RIO TINTO PLC	4,527	49.71	225,059.80	
	ASHTED GROUP PLC	1,805	53.82	97,145.10	
	BAE SYSTEMS PLC	12,194	9.37	114,355.33	
	BUNZL PLC	1,389	29.77	41,350.53	
	DCC PLC	253	43.52	11,010.56	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	34,913	1.54	53,992.95	
	SMITHS GROUP PLC	1,453	16.35	23,756.55	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	328	101.70	33,357.60	
	EXPERIAN PLC	3,682	29.07	107,035.74	
	INTERTEK GROUP PLC	793	42.69	33,853.17	
	RELX PLC	7,888	26.04	205,403.52	
	RENTOKIL INITIAL PLC	10,250	6.22	63,755.00	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	3,010	4.07	12,262.74	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	290	37.73	10,941.70	
	BURBERRY GROUP PLC	1,895	21.40	40,553.00	
	PERSIMMON PLC	813	10.59	8,609.67	
	TAYLOR WIMPEY PLC	8,804	1.00	8,865.62	
	COMPASS GROUP PLC	7,101	21.82	154,943.82	
	ENTAIN PLC	2,438	12.30	29,987.40	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	720	52.62	37,886.40	
	PEARSON PLC	1,922	8.21	15,794.99	
	WHITBREAD PLC	854	32.71	27,934.34	
	AUTO TRADER GROUP PLC	4,960	5.91	29,343.36	
	INFORMA PLC	6,469	6.93	44,830.17	
	WPP PLC	3,763	8.40	31,624.25	
	JD SPORTS FASHION PLC	6,745	1.43	9,699.31	
	KINGFISHER PLC	5,496	2.25	12,366.00	

NEXT PLC	607	66.12	40,134.84
OCADO GROUP PLC	1,100	5.37	5,913.60
SAINSBURY (J) PLC	4,929	2.57	12,677.38
TESCO PLC	28,569	2.48	71,079.67
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1,415	19.53	27,634.95
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	8,771	26.25	230,238.75
COCA-COLA HBC AG-DI	947	23.41	22,169.27
DIAGEO PLC	9,049	33.05	299,069.45
IMPERIAL BRANDS PLC	3,548	17.72	62,888.30
HALEON PLC	19,634	3.27	64,203.18
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	3,000	60.82	182,460.00
UNILEVER PLC	10,203	40.90	417,302.70
SMITH & NEPHEW PLC	3,687	12.36	45,571.32
ASTRAZENECA PLC	6,233	114.22	711,933.26
GSK PLC	16,759	14.25	238,849.26
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	361	18.55	6,696.55
BARCLAYS PLC	62,684	1.45	91,029.70
HSBC HOLDINGS PLC	80,529	6.02	484,945.63
LLOYDS BANKING GROUP PLC	266,618	0.42	112,832.73
NATWEST GROUP PLC	23,760	2.29	54,457.92
STANDARD CHARTERED PLC	10,866	6.57	71,389.62
3I GROUP PLC	3,950	18.57	73,351.50
ABRDN PLC	6,100	2.06	12,596.50
HARGREAVES LANSDOWN PLC	905	7.72	6,986.60
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	1,612	84.22	135,762.64
M&G PLC	6,694	1.89	12,701.86
SCHRODERS PLC	3,430	4.30	14,779.87
ST JAMES'S PLACE PLC	2,372	10.60	25,143.20
WISE PLC - A	2,600	5.29	13,759.20
ADMIRAL GROUP PLC	891	21.16	18,853.56
AVIVA PLC	11,704	3.86	45,200.84
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	25,141	2.23	56,064.43
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	3,072	5.30	16,287.74
PRUDENTIAL PLC	11,729	10.78	126,438.62
SAGE GROUP PLC/THE	4,334	8.71	37,775.14
HALMA PLC	1,757	22.59	39,690.63
BT GROUP PLC	29,512	1.27	37,627.80
VODAFONE GROUP PLC	93,390	0.72	67,885.19
CENTRICA PLC	23,300	1.18	27,622.15
NATIONAL GRID PLC	15,490	10.38	160,863.65
SEVERN TRENT PLC	1,067	26.83	28,627.61
SSE PLC	4,243	18.25	77,455.96

	UNITED UTILITIES GROUP PLC	2,504	9.98	24,999.93	
	イギリスポンド 小計	1,106,465		7,168,548.85 (1,309,622,189)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	508	12.49	6,344.92	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	17	668.50	11,364.50	
	GIVAUDAN-REG	36	2,958.00	106,488.00	
	HOLCIM LTD	2,137	59.56	127,279.72	
	SIG GROUP AG	1,257	24.64	30,972.48	
	SIKA AG-REG	585	240.50	140,692.50	
	ABB LTD-REG	6,423	34.30	220,308.90	
	GEBERIT AG-REG	148	454.70	67,295.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	113	191.40	21,628.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	154	200.70	30,907.80	
	VAT GROUP AG	128	350.50	44,864.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	890	28.80	25,632.00	
	SGS SA-REG	600	84.18	50,508.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	229	258.60	59,219.40	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	2,124	146.15	310,422.60	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	139	258.00	35,862.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	243	48.40	11,761.20	
	DUFREY AG-REG	400	38.57	15,428.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	20	1,703.00	34,060.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	8	10,900.00	87,200.00	
	NESTLE SA-REG	11,101	108.78	1,207,566.78	
	ALCON INC	2,009	72.28	145,210.52	
	SONOVA HOLDING AG-REG	216	233.20	50,371.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	480	137.75	66,120.00	
	BACHEM HOLDING AG	90	80.00	7,200.00	
	LONZA GROUP AG-REG	286	529.80	151,522.80	
	NOVARTIS AG-REG	8,272	90.69	750,187.68	
	ROCHE HOLDING AG-BR	149	297.80	44,372.20	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2,817	276.50	778,900.50	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	100	93.05	9,305.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	842	54.62	45,990.04	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	94	817.80	76,873.20	
	UBS GROUP AG-REG	13,279	17.72	235,370.27	
	BALOISE HOLDING AG - REG	230	135.70	31,211.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	150	123.80	18,570.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	120	529.80	63,576.00	
	SWISS RE AG	1,197	88.50	105,934.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	603	424.80	256,154.40	
	TEMENOS AG - REG	172	69.16	11,895.52	

	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	685	49.90	34,181.50	
	SWISSCOM AG-REG	103	556.20	57,288.60	
	BKW AG	60	152.10	9,126.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	364	76.15	27,718.60	
	スイスフラン 小計	59,578		5,622,886.13 (900,505,213)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	10,332	48.15	497,485.80	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	6,000	81.15	486,900.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	4,000	11.60	46,400.00	
	MTR CORP	8,000	36.20	289,600.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	4,000	13.64	54,560.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	9,000	52.05	468,450.00	
	SANDS CHINA LTD	10,000	28.00	280,000.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	8,000	20.75	166,000.00	
	WH GROUP LTD	21,000	4.20	88,200.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	17,000	24.00	408,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	2,900	111.90	324,510.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	4,700	301.40	1,416,580.00	
	AIA GROUP LTD	47,600	78.15	3,719,940.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	10,000	9.05	90,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	1,500	41.15	61,725.00	
	CLP HOLDINGS LTD	6,500	61.55	400,075.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	44,474	6.75	300,199.50	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	7,000	40.70	284,900.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	9,832	42.95	422,284.40	
	ESR GROUP LTD	4,400	13.10	57,640.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	5,000	12.24	61,200.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	4,118	23.15	95,331.70	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	4,250	19.52	82,960.00	
	SINO LAND CO	17,000	9.39	159,630.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	6,500	97.65	634,725.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	1,000	52.35	52,350.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	7,200	18.72	134,784.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	8,000	40.20	321,600.00	
	香港ドル 小計	289,306		11,406,530.40 (208,967,636)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	400	33.25	13,300.00	
	KEPPEL CORP LTD	6,100	6.64	40,504.00	
	SEATRUM LTD	66,797	0.12	8,349.62	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	8,500	3.61	30,685.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	5,900	7.41	43,719.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	26,300	0.93	24,590.50	

	WILMAR INTERNATIONAL LTD	7,900	3.92	30,968.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	7,700	31.43	242,011.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	14,600	12.32	179,872.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	4,600	27.99	128,754.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	4,200	9.58	40,236.00	
	VENTURE CORP LTD	700	14.96	10,472.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	34,400	2.50	86,000.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	11,900	3.27	38,913.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	1,100	6.72	7,392.00	
	UOL GROUP LTD	1,100	6.39	7,029.00	
	シンガポールドル 小計	202,197		932,795.12 (99,053,513)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	7,379	8.46	62,426.34	
	EBOS GROUP LTD	979	36.80	36,027.20	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	2,411	24.00	57,864.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	4,546	5.12	23,275.52	
	MERCURY NZ LTD	1,273	6.41	8,159.93	
	MERIDIAN ENERGY LTD	3,652	5.40	19,720.80	
	ニュージーランドドル 小計	20,240		207,473.79 (18,324,085)	
スウェーデンクローネ	BOLIDEN AB	1,225	308.70	378,157.50	
	HOLMEN AB-B SHARES	252	382.50	96,390.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	2,922	138.55	404,843.10	
	ALFA LAVAL AB	1,376	379.40	522,054.40	
	ASSA ABLOY AB-B	4,073	246.00	1,001,958.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	11,114	153.85	1,709,888.90	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	5,979	134.05	801,484.95	
	BEIJER REF AB	1,400	134.30	188,020.00	
	EPIROC AB-A	2,618	195.75	512,473.50	
	EPIROC AB-B	2,211	166.20	367,468.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	1,008	94.18	94,933.44	
	INDUTRADE AB	800	242.40	193,920.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	423	205.90	87,095.70	
	LIFCO AB-B SHS	1,047	223.60	234,109.20	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	6,107	100.90	616,196.30	
	SAAB AB-B	300	592.00	177,600.00	
	SANDVIK AB	4,260	203.70	867,762.00	
	SKANSKA AB-B SHS	1,927	141.60	272,863.20	
	SKF AB-B SHARES	1,382	188.20	260,092.40	
	VOLVO AB-A SHS	1,869	219.40	410,058.60	
	VOLVO AB-B SHS	5,273	212.80	1,122,094.40	
	SECURITAS AB-B SHS	897	84.00	75,348.00	

	VOLVO CAR AB-B	1,500	42.68	64,020.00	
	EVOLUTION AB	789	1,340.20	1,057,417.80	
	EMBRACER GROUP AB	1,300	26.01	33,813.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	2,789	155.38	433,354.82	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	2,366	285.70	675,966.20	
	GETINGE AB-B SHS	567	182.65	103,562.55	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	458	210.80	96,546.40	
	NORDEA BANK ABP	12,996	112.26	1,458,930.96	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	6,423	114.75	737,039.25	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	5,968	88.62	528,884.16	
	SWEDBANK AB - A SHARES	3,577	178.30	637,779.10	
	EQT AB	1,724	208.80	359,971.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	531	288.60	153,246.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	1,044	287.70	300,358.80	
	INVESTOR AB-A SHS	1,961	209.90	411,613.90	
	INVESTOR AB-B SHS	6,998	208.95	1,462,232.10	
	KINNEVIK AB - B	570	140.35	79,999.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	218	445.30	97,075.40	
	ERICSSON LM-B SHS	11,774	54.18	637,915.32	
	HEXAGON AB-B SHS	8,535	127.10	1,084,798.50	
	TELE2 AB-B SHS	1,425	88.26	125,770.50	
	TELIA CO AB	10,158	23.10	234,649.80	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	1,722	37.94	65,332.68	
	SAGAX AB-B	500	211.30	105,650.00	
	スウェーデンクローネ 小計	144,356		21,340,740.33 (285,965,920)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	1,571	246.30	386,937.30	
	EQUINOR ASA	3,756	308.55	1,158,913.80	
	NORSK HYDRO ASA	5,537	62.32	345,065.84	
	YARA INTERNATIONAL ASA	934	376.90	352,024.60	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	191	487.20	93,055.20	
	ADEVINTA ASA	545	74.85	40,793.25	
	MOWI ASA	2,348	170.15	399,512.20	
	ORKLA ASA	1,843	77.26	142,390.18	
	SALMAR ASA	163	423.40	69,014.20	
	DNB BANK ASA	3,605	190.95	688,374.75	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	557	172.50	96,082.50	
	TELENOR ASA	3,694	109.50	404,493.00	
	ノルウェークローネ 小計	24,744		4,176,656.82 (55,466,002)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	387	475.00	183,825.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	919	318.90	293,069.10	

	ROCKWOOL A/S-B SHS	21	1,630.00	34,230.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	3,967	180.06	714,298.02	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	20	11,690.00	233,800.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	13	11,805.00	153,465.00	
	DSV A/S	743	1,358.50	1,009,365.50	
	PANDORA A/S	455	576.20	262,171.00	
	CARLSBERG AS-B	404	1,067.50	431,270.00	
	COLOPLAST-B	512	860.80	440,729.60	
	DEMANT A/S	235	280.30	65,870.50	
	GENMAB A/S	240	2,618.00	628,320.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	6,663	1,088.40	7,252,009.20	
	DANSKE BANK A/S	2,679	159.00	425,961.00	
	TRYG A/S	1,827	149.20	272,588.40	
	ORSTED A/S	798	625.60	499,228.80	
	デンマーククローネ 小計	19,883		12,900,201.12 (271,033,225)	
イスラエルシェケル	ICL GROUP LTD	1,984	20.75	41,168.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	62	760.50	47,151.00	
	BANK HAPOLIM BM	6,230	30.43	189,578.90	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	7,509	27.50	206,497.50	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	7,431	18.37	136,507.47	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	381	124.20	47,320.20	
	NICE LTD	214	750.00	160,500.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	300	139.40	41,820.00	
	AZRIELI GROUP LTD	97	215.60	20,913.20	
	イスラエルシェケル 小計	24,208		891,456.27 (35,286,246)	
ユーロ	ENI SPA	9,447	12.79	120,883.81	
	GALP ENERGIA SGPS SA	2,025	10.54	21,343.50	
	NESTE OYJ	1,715	34.70	59,510.50	
	OMV AG	826	37.57	31,032.82	
	REPSOL SA	5,273	12.95	68,285.35	
	TENARIS SA	2,501	12.80	32,025.30	
	TOTALENERGIES SE	9,498	52.05	494,370.90	
	AIR LIQUIDE SA	2,155	158.58	341,739.90	
	AKZO NOBEL N.V.	703	70.42	49,505.26	
	ARCELORMITTAL	1,863	24.57	45,773.91	
	ARKEMA	244	80.12	19,549.28	
	BASF SE	3,573	42.23	150,905.65	
	COVESTRO AG	782	49.00	38,318.00	
	CRH PLC	2,876	48.83	140,435.08	
	DSM-FIRMENICH AG	745	94.44	70,357.80	

EVONIK INDUSTRIES AG	1,243	16.67	20,720.81
HEIDELBERG MATERIALS AG	574	73.08	41,947.92
OCI NV	260	22.35	5,811.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	1,261	30.32	38,233.52
SOLVAY SA	357	98.96	35,328.72
STORA ENSO OYJ-R SHS	2,470	10.55	26,058.50
SYMRISE AG	512	93.42	47,831.04
UMICORE	1,075	25.73	27,659.75
UPM-KYMMENE OYJ	2,285	27.16	62,060.60
VOESTALPINE AG	334	32.04	10,701.36
WACKER CHEMIE AG	50	120.25	6,012.50
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	938	30.97	29,049.86
AIRBUS SE	2,423	126.74	307,091.02
ALSTOM	1,467	26.87	39,418.29
BOUYGUES SA	660	29.60	19,536.00
BRENTAG SE	667	70.06	46,730.02
CNH INDUSTRIAL NV	4,636	12.87	59,688.50
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	1,974	54.05	106,694.70
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	2,162	30.74	66,459.88
DASSAULT AVIATION SA	154	178.20	27,442.80
EIFFAGE	269	94.74	25,485.06
FERROVIAL SE	2,035	28.55	58,099.25
GEA GROUP AG	570	37.84	21,568.80
IMCD NV	271	127.30	34,498.30
KINGSPAN GROUP PLC	695	57.16	39,726.20
KNORR-BREMSE AG	163	65.40	10,660.20
KONE OYJ-B	1,436	47.39	68,052.04
LEGRAND SA	1,090	87.02	94,851.80
METSO CORP	2,801	10.61	29,732.61
MTU AERO ENGINES AG	195	237.30	46,273.50
PRYSMIAN SPA	1,270	35.08	44,551.60
RATIONAL AG	13	629.00	8,177.00
RHEINMETALL AG	193	255.90	49,388.70
SAFRAN SA	1,369	139.48	190,948.12
SCHNEIDER ELECTRIC SE	2,202	158.10	348,136.20
SIEMENS AG-REG	3,056	156.98	479,730.88
SIEMENS ENERGY AG	1,948	14.65	28,538.20
THALES SA	378	134.65	50,897.70
VINCI SA	2,141	104.00	222,664.00
WARTSILA OYJ ABP	2,007	10.26	20,601.85
BUREAU VERITAS SA	1,404	24.41	34,271.64
RANDSTAD NV	429	47.27	20,278.83

TELEPERFORMANCE	215	153.15	32,927.25
WOLTERS KLUWER	1,100	117.30	129,030.00
ADP	62	132.10	8,190.20
AENA SME SA	297	144.95	43,050.15
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	2,723	9.21	25,081.55
DEUTSCHE POST AG-REG	4,035	43.19	174,271.65
GETLINK SE	1,857	15.45	28,699.93
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	1,397	108.62	151,742.14
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	159	100.40	15,963.60
CONTINENTAL AG	586	66.82	39,156.52
DR ING HC F PORSCHE AG	427	108.40	46,286.80
FERRARI NV	483	282.60	136,495.80
MERCEDES-BENZ GROUP AG	3,417	72.03	246,126.51
MICHELIN (CGDE)	2,525	26.26	66,306.50
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	630	54.14	34,108.20
RENAULT SA	907	35.67	32,352.69
STELLANTIS NV	9,112	15.11	137,736.99
VALEO	541	19.19	10,381.79
VOLKSWAGEN AG	85	150.75	12,813.75
VOLKSWAGEN AG-PREF	837	122.36	102,415.32
ADIDAS AG	664	176.88	117,448.32
HERMES INTERNATIONAL	133	1,901.40	252,886.20
KERING	286	502.20	143,629.20
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	1,135	830.10	942,163.50
MONCLER SPA	735	62.44	45,893.40
PUMA SE	593	51.90	30,776.70
SEB SA	52	88.40	4,596.80
ACCOR SA	797	32.83	26,165.51
AMADEUS IT GROUP SA	1,767	68.34	120,756.78
DELIVERY HERO SE	738	34.71	25,615.98
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	667	180.05	120,093.35
JUST EAT TAKEAWAY	417	12.43	5,185.81
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	450	35.44	15,948.00
SODEXO SA	376	102.40	38,502.40
BOLLORE SE	2,292	5.50	12,617.46
PUBLICIS GROUPE	863	71.04	61,307.52
SCOUT24 SE	199	57.34	11,410.66
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	2,869	19.28	55,328.66
VIVENDI SE	2,927	8.26	24,194.58
D'IETEREN GROUP	66	157.20	10,375.20
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	4,507	33.90	152,787.30
PROSUS NV	3,360	62.89	211,310.40

ZALANDO SE	1,193	26.65	31,793.45
CARREFOUR SA	2,601	16.40	42,669.40
HELLOFRESH SE	407	20.52	8,351.64
JERONIMO MARTINS	1,616	25.26	40,820.16
KESKO OYJ-B SHS	701	16.97	11,899.47
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	3,864	30.24	116,847.36
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	3,603	52.40	188,797.20
DANONE	2,565	56.09	143,870.85
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	2,156	12.29	26,508.02
HEINEKEN HOLDING NV	559	80.20	44,831.80
HEINEKEN NV	997	95.46	95,173.62
JDE PEET'S NV	306	27.32	8,359.92
KERRY GROUP PLC-A	622	87.10	54,176.20
PERNOD RICARD SA	806	196.75	158,580.50
REMY COINTREAU	59	139.90	8,254.10
BEIERSDORF AG	420	120.60	50,652.00
HENKEL AG & CO KGAA	683	63.68	43,493.44
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	561	72.00	40,392.00
L'OREAL	991	406.40	402,742.40
AMPLIFON SPA	308	33.30	10,256.40
BIOMERIEUX	121	90.84	10,991.64
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	100	103.85	10,385.00
DIASORIN SPA	77	96.10	7,399.70
ESSILORLUXOTTICA	1,196	167.56	200,401.76
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	999	44.84	44,795.16
FRESENIUS SE & CO KGAA	1,809	25.19	45,568.71
KONINKLIJKE PHILIPS NV	3,726	18.74	69,832.69
SIEMENS HEALTHINEERS AG	1,100	51.24	56,364.00
ARGENX SE	227	363.20	82,446.40
BAYER AG-REG	4,084	50.50	206,242.00
EUROFINS SCIENTIFIC	636	56.58	35,984.88
GRIFOLS SA	945	11.46	10,834.42
IPSEN	84	108.60	9,122.40
MERCK KGAA	495	152.95	75,710.25
ORION OYJ-CLASS B	302	38.22	11,542.44
QIAGEN N.V.	1,052	41.41	43,563.32
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	259	43.13	11,170.67
SANOFI	4,583	98.60	451,883.80
SARTORIUS AG-VORZUG	104	309.30	32,167.20
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	140	231.50	32,410.00
UCB SA	401	83.68	33,555.68
ABN AMRO BANK NV-CVA	2,053	13.47	27,664.17

AIB GROUP PLC	3,189	3.81	12,150.09
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	24,389	6.65	162,235.62
BANCO SANTANDER SA	66,613	3.06	204,235.45
BANK OF IRELAND GROUP PLC	4,910	8.69	42,677.72
BNP PARIBAS	4,489	54.85	246,221.65
CAIXABANK SA	16,916	3.65	61,743.40
COMMERZBANK AG	3,630	9.62	34,920.60
CREDIT AGRICOLE SA	5,426	10.47	56,810.22
ERSTE GROUP BANK AG	1,252	30.43	38,098.36
FINECOBANK SPA	2,331	11.97	27,902.07
ING GROEP NV	14,468	11.70	169,304.53
INTESA SANPAOLO	65,240	2.33	152,335.40
KBC GROUP NV	1,025	60.74	62,258.50
MEDIOBANCA SPA	2,276	10.76	24,489.76
SOCIETE GENERALE SA	2,923	22.70	66,352.10
UNICREDIT SPA	7,442	20.14	149,919.09
ADYEN NV	84	1,540.20	129,376.80
AMUNDI SA	166	52.05	8,640.30
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	8,185	9.16	75,015.52
DEUTSCHE BOERSE AG	775	167.70	129,967.50
EDENRED	905	59.88	54,191.40
EURAZEO SE	89	62.70	5,580.30
EURONEXT NV	361	63.35	22,869.35
EXOR NV	485	79.34	38,479.90
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	286	71.44	20,431.84
NEXI SPA	2,562	6.92	17,729.04
SOFINA	37	191.00	7,067.00
WENDEL	66	92.90	6,131.40
WORLDLINE SA	1,170	31.81	37,217.70
AEGON NV	7,811	4.51	35,227.61
AGEAS	837	36.91	30,893.67
ALLIANZ SE-REG	1,589	209.15	332,339.35
ASSICURAZIONI GENERALI	4,263	18.26	77,842.38
AXA SA	7,334	26.41	193,690.94
HANNOVER RUECK SE	255	190.30	48,526.50
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	581	330.60	192,078.60
NN GROUP NV	1,184	32.49	38,468.16
POSTE ITALIANE SPA	1,649	9.52	15,701.77
SAMPO OYJ-A SHS	1,934	41.07	79,429.38
TALANX AG	250	50.80	12,700.00
BECHTLE AG	184	36.12	6,646.08
CAPGEMINI SE	681	169.35	115,327.35

DASSAULT SYSTEMES SE	2,583	39.68	102,493.44
NEMETSCHEK SE	131	68.92	9,028.52
SAP SE	4,210	122.58	516,061.80
NOKIA OYJ	21,056	3.75	78,960.00
CELLNEX TELECOM SA	2,270	36.34	82,491.80
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	13,017	19.55	254,586.48
ELISA OYJ	717	49.07	35,183.19
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	742	11.74	8,711.08
KONINKLIJKE KPN NV	14,661	3.21	47,135.11
ORANGE	8,233	10.36	85,359.74
TELECOM ITALIA SPA	29,748	0.25	7,674.98
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	1,533	2.59	3,982.73
TELEFONICA SA	21,283	3.64	77,512.68
ACCIONA SA	68	154.00	10,472.00
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	200	29.96	5,992.00
E.ON SE	9,803	11.37	111,460.11
EDP RENOVAVEIS SA	748	18.72	14,006.30
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	11,754	4.48	52,716.69
ELIA GROUP SA/NV	178	113.60	20,220.80
ENAGAS SA	745	17.71	13,197.67
ENDESA SA	1,330	20.85	27,730.50
ENEL SPA	33,075	6.05	200,335.27
ENGIE	7,071	14.11	99,785.95
FORTUM OYJ	1,124	12.39	13,931.98
IBERDROLA SA	23,611	11.67	275,658.42
NATURGY ENERGY GROUP SA	286	26.60	7,607.60
RED ELECTRICA CORPORACION SA	2,086	15.91	33,188.26
RWE AG	2,477	39.73	98,411.21
SNAM SPA	9,302	4.70	43,728.70
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	6,123	7.61	46,596.03
VEOLIA ENVIRONNEMENT	2,776	28.18	78,227.68
VERBUND AG	172	69.45	11,945.40
ASM INTERNATIONAL NV	187	376.70	70,442.90
ASML HOLDING NV	1,642	640.80	1,052,193.60
INFINEON TECHNOLOGIES AG	5,289	35.70	188,843.74
STMICROELECTRONICS NV	2,748	42.63	117,160.98
LEG IMMOBILIEN SE	186	50.70	9,430.20
VONOVIA SE	3,089	17.32	53,501.48
ユーロ 小計	718,958		18,785,475.04 (2,939,551,134)
合 計	4,426,444		29,587,477,842 (29,587,477,842)

(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	616	67,193.28	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	1,316	44,375.52	
		AMERICAN TOWER CORP	1,921	357,363.63	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	546	99,028.02	
		BOSTON PROPERTIES INC	579	29,818.50	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	442	46,790.12	
		CROWN CASTLE INC	1,819	199,071.36	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	1,124	117,064.60	
		EQUINIX INC	384	286,506.24	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	662	43,208.74	
		EQUITY RESIDENTIAL	1,417	88,364.12	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	272	59,845.44	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	594	84,324.24	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	1,014	47,881.08	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1,572	28,500.36	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2,301	44,340.27	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	2,978	48,362.72	
		INVITATION HOMES INC	2,415	79,067.10	
		IRON MOUNTAIN INC	1,141	61,579.77	
		KIMCO REALTY CORP	2,597	47,836.74	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	464	67,576.96	
		PROLOGIS INC	3,692	431,594.80	
		PUBLIC STORAGE	660	187,162.80	
		REALTY INCOME CORP	2,639	155,067.64	
		REGENCY CENTERS CORP	599	34,742.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	418	93,247.44	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	1,377	148,357.98	
		SUN COMMUNITIES INC	507	63,440.91	
		UDR INC	1,395	56,120.85	
		VENTAS INC	1,799	80,001.53	
		VICI PROPERTIES INC	3,943	120,774.09	
		WELLTOWER INC	2,007	153,093.96	
		WEYERHAEUSER CO	2,920	88,797.20	
		WP CAREY INC	840	55,683.60	
			48,970	3,616,183.61	

アメリカドル合計				(518,886,186)	
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	200	9,558.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	200	3,678.00	
カナダドル合計			400	13,236.00	(1,442,062)
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS/AU	4,310	33,057.70	
		GOODMAN GROUP	6,917	135,780.71	
		GPT GROUP	8,117	32,630.34	
		MIRVAC GROUP	16,699	36,737.80	
		SCENTRE GROUP	25,276	63,190.00	
		STOCKLAND	10,086	40,444.86	
		VICINITY CENTRES	11,078	19,829.62	
オーストラリアドル合計			82,483	361,671.03	(34,637,234)
イギリスポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	2,026	6,027.35	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	1,851	10,358.19	
		SEGRO PLC	5,574	39,218.66	
イギリスポンド合計			9,451	55,604.20	(10,158,331)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	10,400	458,640.00	
香港ドル合計			10,400	458,640.00	(8,402,284)
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	12,900	34,443.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	23,199	44,310.09	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	8,800	14,344.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	4,100	6,601.00	
シンガポールドル合計			48,999	99,698.09	(10,586,940)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	129	5,541.84	
		GECINA SA	213	19,990.05	
		KLEPIERRE	951	20,722.29	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	684	31,190.40	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	408	10,159.20	
ユーロ合計			2,385	87,603.78	(13,708,239)
合計				597,821,276	(597,821,276)

(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 605銘柄	97.68%	—	72.29%
	投資証券 34銘柄	—	2.32%	1.72%
カナダドル	株式 85銘柄	99.86%	—	3.38%
	投資証券 2銘柄	—	0.14%	0.00%
オーストラリアドル	株式 52銘柄	94.72%	—	2.06%
	投資証券 7銘柄	—	5.28%	0.11%
イギリスポンド	株式 79銘柄	99.23%	—	4.34%
	投資証券 3銘柄	—	0.77%	0.03%
スイスフラン	株式 43銘柄	100.00%	—	2.98%
香港ドル	株式 28銘柄	96.13%	—	0.69%
	投資証券 1銘柄	—	3.87%	0.03%
シンガポールドル	株式 16銘柄	90.34%	—	0.33%
	投資証券 4銘柄	—	9.66%	0.04%
ニュージーランドドル	株式 6銘柄	100.00%	—	0.06%
スウェーデンクローネ	株式 46銘柄	100.00%	—	0.95%
ノルウェークローネ	株式 12銘柄	100.00%	—	0.18%
デンマーククローネ	株式 16銘柄	100.00%	—	0.90%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	100.00%	—	0.12%
ユーロ	株式 221銘柄	99.54%	—	9.74%
	投資証券 5銘柄	—	0.46%	0.05%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

２【ファンドの現況】

【ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン（ラップ向け）】

【純資産額計算書】

2023年 6月30日現在

(単位：円)

I 資産総額	2,005,417,233
II 負債総額	3,023,061
III 純資産総額（I－II）	2,002,394,172
IV 発行済口数	2,060,591,722口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	0.9718
（10,000口当たり）	（9,718）

(参考)

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2023年 6月30日現在

(単位：円)

I 資産総額	33,377,046,677
II 負債総額	1,367,799,478
III 純資産総額（I－II）	32,009,247,199
IV 発行済口数	12,649,563,010口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	2.5305
（10,000口当たり）	（25,305）

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6月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

（2）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

・投資運用の意思決定機構

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 6月30日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本 数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	865	26,216,265
追加型公社債投資信託	16	1,572,275
単位型株式投資信託	92	417,827
単位型公社債投資信託	49	110,246
合 計	1,022	28,316,612

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 (2022年9月末現在)	③事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
農林中央金庫	4,040,198 百万円	金融業務を営んでいます。
東京都信用農業協同組合連合会	132,435 百万円※	金融業務を営んでいます。
石川県信用農業協同組合連合会	33,047 百万円※	金融業務を営んでいます。
福井県信用農業協同組合連合会	23,373 百万円※	金融業務を営んでいます。
兵庫県信用農業協同組合連合会	258,320 百万円※	金融業務を営んでいます。
徳島県信用農業協同組合連合会	32,545 百万円※	金融業務を営んでいます。
みやぎ仙南農業協同組合	3,756 百万円※	金融業務を営んでいます。
はが野農業協同組合	3,960 百万円※	金融業務を営んでいます。
下野農業協同組合	2,001 百万円※	金融業務を営んでいます。
塩野谷農業協同組合	3,028 百万円※	金融業務を営んでいます。
那須野農業協同組合	3,858 百万円※	金融業務を営んでいます。
那須南農業協同組合	1,171 百万円※	金融業務を営んでいます。
足利市農業協同組合	2,059 百万円※	金融業務を営んでいます。
あさか野農業協同組合	862 百万円※	金融業務を営んでいます。
いるま野農業協同組合	5,616 百万円※	金融業務を営んでいます。
くまがや農業協同組合	2,706 百万円※	金融業務を営んでいます。

南彩農業協同組合	2,880 百万円※	金融業務を営んでいます。
さいかつ農業協同組合	1,832 百万円※	金融業務を営んでいます。
東京中央農業協同組合	1,147 百万円※	金融業務を営んでいます。
横浜農業協同組合	11,721 百万円※	金融業務を営んでいます。
セレサ川崎農業協同組合	2,485 百万円※	金融業務を営んでいます。
よこすか葉山農業協同組合	1,358 百万円※	金融業務を営んでいます。
さがみ農業協同組合	5,060 百万円※	金融業務を営んでいます。
湘南農業協同組合	3,195 百万円※	金融業務を営んでいます。
秦野市農業協同組合	1,640 百万円※	金融業務を営んでいます。
かながわ西湘農業協同組合	2,384 百万円※	金融業務を営んでいます。
厚木市農業協同組合	2,420 百万円※	金融業務を営んでいます。
県央愛川農業協同組合	446 百万円※	金融業務を営んでいます。
相模原市農業協同組合	841 百万円※	金融業務を営んでいます。
神奈川つくい農業協同組合	762 百万円※	金融業務を営んでいます。
信州うへだ農業協同組合	4,019 百万円※	金融業務を営んでいます。
信州諏訪農業協同組合	6,255 百万円※	金融業務を営んでいます。
上伊那農業協同組合	8,056 百万円※	金融業務を営んでいます。
みなみ信州農業協同組合	4,372 百万円※	金融業務を営んでいます。
中野市農業協同組合	2,527 百万円※	金融業務を営んでいます。
ながの農業協同組合	12,995 百万円※	金融業務を営んでいます。
黒部市農業協同組合	1,326 百万円※	金融業務を営んでいます。
小松市農業協同組合	2,052 百万円※	金融業務を営んでいます。
金沢中央農業協同組合	1,063 百万円※	金融業務を営んでいます。
金沢市農業協同組合	3,108 百万円※	金融業務を営んでいます。
ぎふ農業協同組合	7,118 百万円※	金融業務を営んでいます。
ハイナン農業協同組合	819 百万円※	金融業務を営んでいます。
あいち尾東農業協同組合	1,187 百万円※	金融業務を営んでいます。
愛知北農業協同組合	744 百万円※	金融業務を営んでいます。
あいち中央農業協同組合	3,589 百万円※	金融業務を営んでいます。
鈴鹿農業協同組合	1,547 百万円※	金融業務を営んでいます。
伊賀ふるさと農業協同組合	3,798 百万円※	金融業務を営んでいます。
越前たけふ農業協同組合	3,000 百万円※	金融業務を営んでいます。
兵庫六甲農業協同組合	5,666 百万円※	金融業務を営んでいます。
あかし農業協同組合	423 百万円※	金融業務を営んでいます。
兵庫南農業協同組合	3,721 百万円※	金融業務を営んでいます。
みのり農業協同組合	4,264 百万円※	金融業務を営んでいます。
兵庫みらい農業協同組合	3,411 百万円※	金融業務を営んでいます。
加古川市南農業協同組合	497 百万円※	金融業務を営んでいます。
兵庫西農業協同組合	12,627 百万円※	金融業務を営んでいます。
相生市農業協同組合	102 百万円※	金融業務を営んでいます。
丹波ひかみ農業協同組合	2,158 百万円※	金融業務を営んでいます。
丹波ささやま農業協同組合	2,056 百万円※	金融業務を営んでいます。
淡路日の出農業協同組合	1,844 百万円※	金融業務を営んでいます。
あわじ島農業協同組合	3,900 百万円※	金融業務を営んでいます。
晴れの国岡山農業協同組合	25,687 百万円※	金融業務を営んでいます。
徳島市農業協同組合	3,991 百万円※	金融業務を営んでいます。
長崎西彼農業協同組合	3,261 百万円※	金融業務を営んでいます。
長崎県央農業協同組合	5,740 百万円※	金融業務を営んでいます。

※は「出資金」を記載しております。

2【関係業務の概要】

- （１）受託会社：ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。
- （２）販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。

3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2023年6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8月30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」に掲げられているヘッジ付先進国株式インデックス・オープン（ラップ向け）の2022年6月28日から2023年6月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン（ラップ向け）の2023年6月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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