

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年8月9日提出
【計算期間】	第18期(自 2023年5月13日至 2024年5月13日)
【ファンド名】	三菱ＵＦＪ ＤＣ海外株式インデックスファンド
【発行者名】	三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 横川 直
【本店の所在の場所】	東京都港区東新橋一丁目９番１号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【連絡場所】	東京都港区東新橋一丁目９番１号
【電話番号】	03-4223-3037
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

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

信託金の限度額は、5,000億円です。

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

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

商品分類表

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	年１回	グローバル (日本を除く)	ファミリー ファンド	あり ()	日経２２５	ブル・ベア型
一般	年２回					
大型株	年４回	日本			TOPIX	条件付運用型
中小型株	年６回	北米	ファンド・	なし		
債券	(隔月)	欧州	オブ・		その他	ロング・
一般	年１２回	アジア	ファンズ		(MSCIコ	ショート型／
公債	(毎月)	オセアニア			クサイ・イン	絶対収益
社債	日々	中南米			デックス(配	追求型
その他債券	その他	アフリカ			当込み、円換	
クレジット	()	中近東			算ベース))	その他
属性		(中東)				()
()		エマージング				
不動産投信						
その他資産(投資信託証券(株式一般))						
資産複合						
()						

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

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

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

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	ＭＭＦ（マネー・マネージメント・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（ＢＢ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。
	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。
投資対象地域	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。
	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。
投資形態	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第２条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。

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

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

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

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

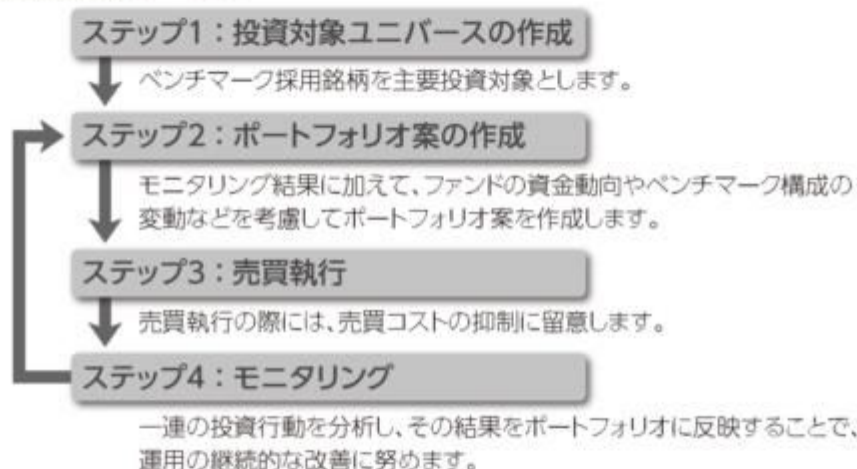
ファンドの特色

特色1

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

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

<運用プロセスのイメージ>



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

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

(<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)

特色2

「外国株式インデックスマザーファンド」を通じて、日本を除く世界の主要国の株式への投資を行います。

外国株式インデックスマザーファンドの株式の実質投資比率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。

特色3

原則として、為替ヘッジは行いません。

為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

■ファンドの仕組み

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



■主な投資制限

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

■分配方針

- ・年1回の決算時(5月12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。

(注)MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。

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

MSCI Inc.は、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入力しますが、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ものではありません。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、並大の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がけ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。

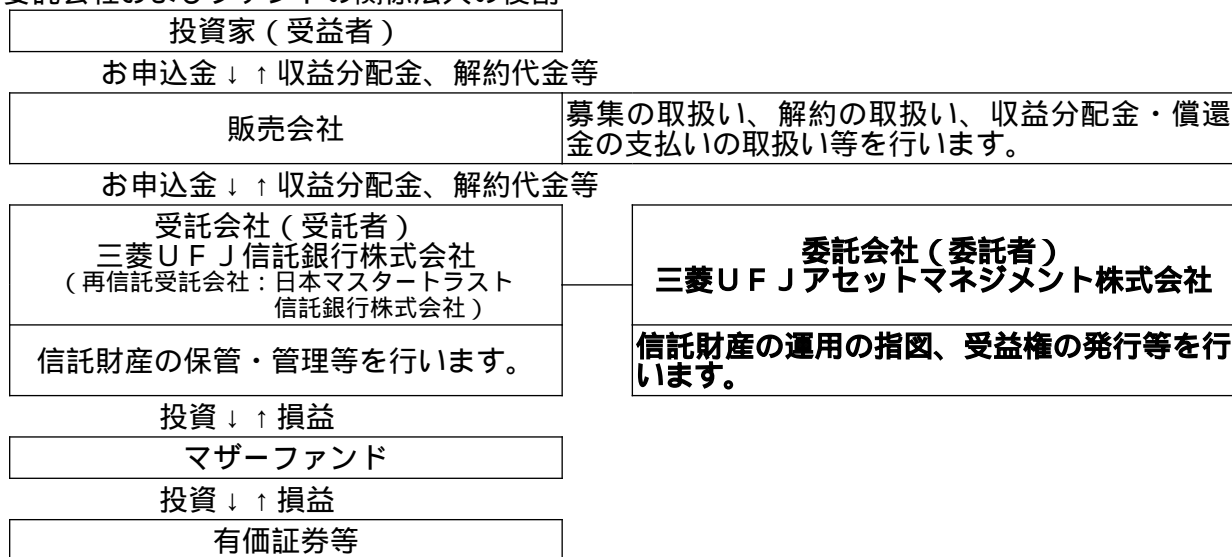
(2) 【ファンドの沿革】

2006年5月15日

設定日、信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割



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。

委託会社の概況（2024年5月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・設立年月日
1985年8月1日
- ・資本金
2,000百万円
- ・沿革
1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
2005年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ投信株式会社に変更
2015年7月 三菱ＵＦＪ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社に変更
2023年10月 エム・ユー投資顧問株式会社の有価証券運用事業を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社へ統合し、商号を三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社に変更

・大株主の状況

株 主 名	住 所	所有株式数	所有比率
株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	211,581株	100.0%

２【投資方針】

（１）【投資方針】

外国株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界各国の株式に直接投資することがあります。

受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、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は行いません。

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ａ．有価証券先物取引等

ｂ．スワップ取引

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社を受託会社とする外国株式インデックスマザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

１．株券または新株引受権証書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

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

11．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

のをいいます。）

- 15．投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16．において同じ。）で16．で定めるものの以外のもの
- 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。
- 19．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 20．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 21．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りま。
- 22．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 23．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 24．受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいい、1．から23．に該当するものを除きま。
- 25．外国の者に対する権利で23．および24．の有価証券の性質を有するもの

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

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

その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

<外国株式インデックスマザーファンドの概要>

（基本方針）

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

（運用方法）

投資対象

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

投資態度

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

- ・株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、ま

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

・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

（投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

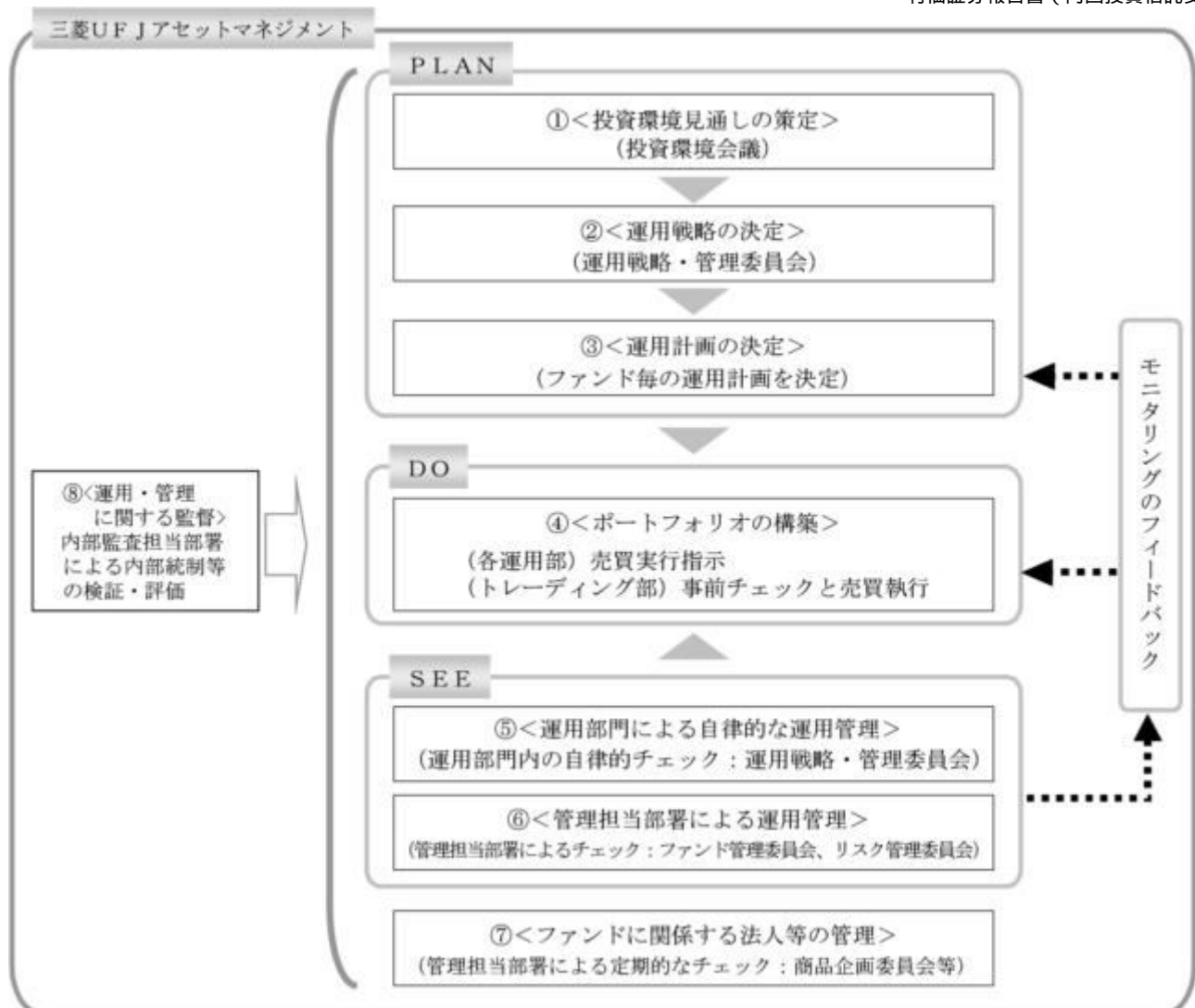
スワップ取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

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

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

（３）【運用体制】



投資環境見通しの策定

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

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。

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。

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。

運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

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

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

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

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

（５）【投資制限】

< 信託約款に定められた投資制限 >

新株引受権証券および新株予約権証券

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

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

投資信託証券

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

b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

同一銘柄の株式

同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。

同一銘柄の転換社債等

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

b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

スワップ取引

- a．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- b．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d．委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

信用取引

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

外国為替予約取引

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

有価証券の借入れ

有価証券の借入れを行いません。

資金の借入れ

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

営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

投資する株式等の範囲

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

有価証券の貸付

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

デリバティブ取引等

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

信用リスクの分散規制

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、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

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動するため、当ファンドはその影響を受け株式の価格が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

為替変動リスク

実質的な主要投資対象である海外の株式は外貨建資産であり、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。そのため、為替相場が円高方向に進んだ場合には、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信用リスク

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

流動性リスク

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

留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受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当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率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。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・当ファンドは、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動することをめざして運用を行います。信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、株価指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因により乖離を生じることがあります。

（２）投資リスクに対する管理体制

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

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。

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。

リスク管理担当部署

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

内部監査担当部署

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

* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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



- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。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0.231%（税抜0.21%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

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

上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

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

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.065%	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等
販売会社	0.09%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	0.055%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

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

個人の受益者に対する課税

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

１．収益分配金の課税

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

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

2. 解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、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

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

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

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

収益分配金について

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

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

上記は2024年5月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

(参考情報)ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間(以下「当期間」といいます。)(2023年5月13日～2024年5月13日)における当ファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
0.25%	0.23%	0.02%

(比率は年率、表示桁数未満四捨五入)

※当期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。消費税等のかかるものは消費税等を含む。)を当期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除しています。

詳細につきましては、当期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

【三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド】

(1)【投資状況】

2024年 5月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国 / 地域	時価合計	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	240,636,198,535	99.99
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	12,167,703	0.01
純資産総額		240,648,366,238	100.00

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

2024年 5月31日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファン ド	33,827,625,750	7.0697	239,153,178,187	7.1136	240,636,198,535	99.99

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

2024年 5月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および2024年5月末日、同日前１年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額		基準価額 （１万口当たりの純資産価額）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第9計算期間末日（2015年 5月12日）	8,885,698,370	8,885,698,370	17,753	17,753
第10計算期間末日（2016年 5月12日）	11,542,468,821	11,542,468,821	15,149	15,149
第11計算期間末日（2017年 5月12日）	18,664,580,996	18,664,580,996	18,621	18,621
第12計算期間末日（2018年 5月14日）	27,246,040,936	27,246,040,936	20,475	20,475
第13計算期間末日（2019年 5月13日）	36,345,311,034	36,345,311,034	21,145	21,145
第14計算期間末日（2020年 5月12日）	44,634,586,604	44,634,586,604	20,419	20,419
第15計算期間末日（2021年 5月12日）	81,181,542,318	81,181,542,318	30,046	30,046
第16計算期間末日（2022年 5月12日）	110,852,706,517	110,852,706,517	33,163	33,163
第17計算期間末日（2023年 5月12日）	145,341,646,121	145,341,646,121	37,135	37,135
第18計算期間末日（2024年 5月13日）	236,767,034,941	236,767,034,941	53,280	53,280
2023年 5月末日	152,673,603,280	—	38,765	—
6月末日	166,743,326,246	—	41,805	—
7月末日	171,124,572,725	—	42,434	—
8月末日	176,400,047,991	—	43,166	—
9月末日	174,285,436,980	—	42,119	—
10月末日	170,567,776,751	—	40,695	—
11月末日	185,971,454,593	—	43,879	—
12月末日	191,521,696,574	—	44,647	—
2024年 1月末日	205,700,031,067	—	47,367	—
2月末日	218,748,296,533	—	49,646	—
3月末日	229,135,879,286	—	51,706	—
4月末日	231,849,394,749	—	52,384	—
5月末日	240,648,366,238	—	53,616	—

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第9計算期間	0円
第10計算期間	0円
第11計算期間	0円
第12計算期間	0円
第13計算期間	0円
第14計算期間	0円
第15計算期間	0円
第16計算期間	0円

第17計算期間	0円
第18計算期間	0円

【収益率の推移】

	収益率（％）
第9計算期間	26.59
第10計算期間	14.66
第11計算期間	22.91
第12計算期間	9.95
第13計算期間	3.27
第14計算期間	3.43
第15計算期間	47.14
第16計算期間	10.37
第17計算期間	11.97
第18計算期間	43.47

（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9計算期間	3,434,566,005	1,176,278,340	5,005,192,243
第10計算期間	3,938,398,553	1,324,507,024	7,619,083,772
第11計算期間	4,098,128,352	1,693,541,631	10,023,670,493
第12計算期間	5,277,344,743	1,994,334,467	13,306,680,769
第13計算期間	6,466,390,819	2,584,465,681	17,188,605,907
第14計算期間	9,214,536,771	4,543,571,103	21,859,571,575
第15計算期間	10,890,278,052	5,730,319,502	27,019,530,125
第16計算期間	13,111,591,586	6,704,492,577	33,426,629,134
第17計算期間	11,405,541,584	5,693,899,277	39,138,271,441
第18計算期間	11,693,679,995	6,394,008,206	44,437,943,230

（参考）

外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

2024年 5月31日現在
（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	アメリカ	4,008,272,662,081	71.43
	イギリス	226,919,842,688	4.04
	カナダ	174,041,904,214	3.10
	フランス	163,039,499,611	2.91
	スイス	144,311,950,001	2.57
	ドイツ	127,805,446,250	2.28

	オーストラリア	100,440,197,033	1.79
	オランダ	98,278,775,263	1.75
	デンマーク	56,495,195,443	1.01
	スウェーデン	47,236,529,003	0.84
	スペイン	39,679,403,909	0.71
	イタリア	31,201,147,472	0.56
	香港	26,333,526,192	0.47
	シンガポール	15,992,205,867	0.28
	フィンランド	15,431,748,499	0.27
	ベルギー	11,581,979,812	0.21
	ノルウェー	8,829,360,462	0.16
	アイルランド	5,505,187,738	0.10
	イスラエル	5,221,606,799	0.09
	オーストリア	3,008,433,946	0.05
	ニュージーランド	2,721,626,258	0.05
	ルクセンブルグ	2,592,308,949	0.05
	ポルトガル	2,450,670,541	0.04
	バミューダ	868,622,429	0.02
	小計	5,318,259,830,460	94.77
投資証券	アメリカ	84,735,114,622	1.51
	オーストラリア	6,810,761,604	0.12
	フランス	2,078,692,129	0.04
	シンガポール	1,840,331,820	0.03
	イギリス	1,790,731,816	0.03
	香港	909,411,860	0.02
	ベルギー	451,254,455	0.01
	カナダ	295,274,847	0.01
	小計	98,911,573,153	1.76
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	194,565,192,519	3.47
純資産総額		5,611,736,596,132	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

2024年 5月31日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	144,334,170,066	2.57
	買建	カナダ	5,874,792,972	0.10
	買建	ドイツ	22,549,126,964	0.40
	買建	オーストラリア	6,090,903,607	0.11
	買建	イギリス	8,129,682,146	0.14
	買建	スイス	4,851,868,280	0.09

（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

2024年 5月31日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア・ サービス	4,011,017	65,006.34	260,741,565,331	64,995.37	260,697,557,255	4.65
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	8,344,098	28,691.25	239,402,660,151	29,982.79	250,179,376,456	4.46
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	1,403,241	140,874.77	197,681,263,233	173,197.70	243,038,113,746	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	5,284,300	29,385.61	155,282,406,401	28,106.61	148,523,795,156	2.65
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディ ア・娯楽	1,261,354	74,639.58	94,146,942,883	73,205.41	92,337,945,555	1.65
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディ ア・娯楽	3,363,102	26,434.20	88,900,914,251	26,976.52	90,724,793,073	1.62
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディ ア・娯楽	2,926,997	26,691.25	78,125,222,140	27,203.79	79,625,424,597	1.42
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	458,776	119,122.40	54,650,498,183	127,752.50	58,609,782,959	1.04
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・ 半導体製 造装置	252,693	208,903.07	52,788,343,973	213,805.89	54,027,254,087	0.96
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1,642,212	31,155.20	51,163,459,396	31,242.98	51,307,603,569	0.91
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サー ビス	744,223	64,584.71	48,065,431,840	64,045.53	47,664,157,515	0.85
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・ 自動車部 品	1,626,748	26,405.98	42,955,887,842	28,023.54	45,587,245,131	0.81
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネル ギー	2,548,099	18,489.05	47,111,930,835	17,866.79	45,526,356,357	0.81
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケ ア機器・ サービス	526,478	80,377.83	42,317,164,131	75,493.82	39,745,835,892	0.71
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	1,857,010	20,108.03	37,340,831,185	20,868.64	38,753,280,594	0.69
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サー ビス	898,755	44,003.18	39,548,084,871	42,523.56	38,218,263,965	0.68
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・ 半導体製 造装置	229,314	146,774.81	33,657,518,781	149,576.18	34,299,912,141	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用 品・パー ソナル用 品	1,338,368	26,152.06	35,001,092,283	25,482.78	34,105,349,616	0.61

アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	475,451	71,627.04	34,055,150,267	69,294.75	32,946,260,084	0.59
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	252,220	123,384.16	31,119,952,986	127,796.39	32,232,805,889	0.57
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	1,368,574	23,496.89	32,157,237,388	22,771.18	31,164,054,751	0.56
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	566,732	54,299.43	30,773,229,210	51,595.67	29,240,919,064	0.52
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	1,442,273	20,385.60	29,401,606,815	19,518.83	28,151,484,674	0.50
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	2,519,079	9,479.63	23,879,949,960	10,170.85	25,621,196,311	0.46
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	249,013	95,747.76	23,842,437,908	101,514.22	25,278,362,557	0.45
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	1,015,711	25,990.62	26,398,965,538	24,805.67	25,195,394,319	0.45
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	1,519,785	16,523.24	25,111,784,462	16,342.70	24,837,396,399	0.44
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	1,005,132	25,195.95	25,325,260,641	24,500.02	24,625,763,551	0.44
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	4,053,564	6,026.65	24,429,423,641	6,054.86	24,543,787,653	0.44
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	919,129	23,811.94	21,886,245,336	26,136.39	24,022,718,600	0.43

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

2024年 5月31日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	エネルギー	4.45
	素材	3.75
	資本財	6.92
	商業・専門サービス	1.51
	運輸	1.54
	自動車・自動車部品	1.54
	耐久消費財・アパレル	1.38
	消費者サービス	1.84
	メディア・娯楽	6.42
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.63
	生活必需品流通・小売り	1.71
	食品・飲料・タバコ	3.12
	家庭用品・パーソナル用品	1.55
	ヘルスケア機器・サービス	3.94

	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.62
	銀行	5.46
	金融サービス	6.40
	保険	2.97
	ソフトウェア・サービス	9.16
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.91
	電気通信サービス	1.07
	公益事業	2.59
	半導体・半導体製造装置	9.03
	不動産管理・開発	0.28
	小計	94.77
投資証券	—	1.76
合計		96.53

（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

2024年 5月31日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2406	買建	3,506	アメリカドル	926,088,803.7	145,155,159,092	920,850,900	144,334,170,066	2.57
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602406	買建	194	カナダドル	51,886,848.75	5,943,638,524	51,285,840	5,874,792,972	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 2406	買建	2,660	ユーロ	134,727,903.45	22,874,103,448	132,813,800	22,549,126,964	0.40
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2406	買建	306	オーストラリアドル	59,644,790.25	6,203,654,633	58,560,750	6,090,903,607	0.11
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2406	買建	494	イギリスポンド	41,569,852.5	8,297,758,257	40,727,830	8,129,682,146	0.14
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX2406	買建	235	スイスフラン	27,808,734.95	4,827,596,387	27,948,550	4,851,868,280	0.09

（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。

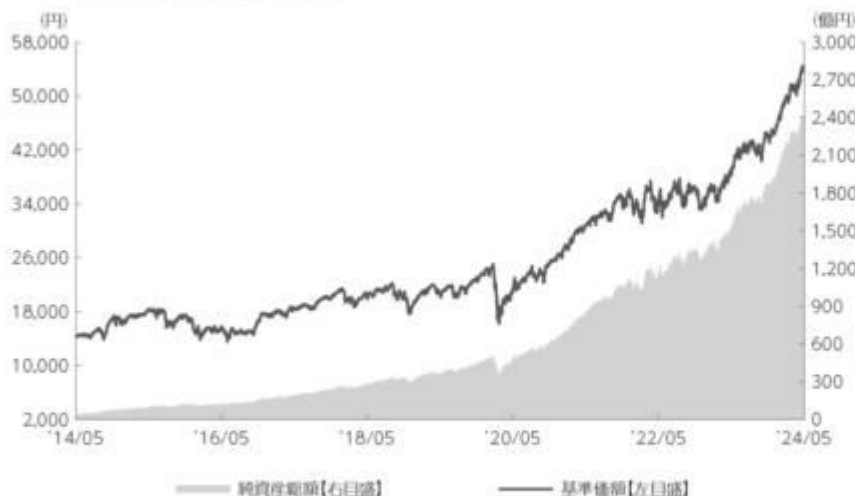
参考情報



運用実績

2024年5月31日現在

■基準価額・純資産の推移 2014年5月30日～2024年5月31日



●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	53,616円
純資産総額	2,406億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024年 5月	0円
2023年 5月	0円
2022年 5月	0円
2021年 5月	0円
2020年 5月	0円
2019年 5月	0円
設定来累計	0円

●分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

組入上位通貨	比率
1 アメリカドル	75.5%
2 ユーロ	9.3%
3 イギリスポンド	4.2%
4 カナダドル	3.2%
5 スイスフラン	2.6%
6 オーストラリアドル	2.0%
7 デンマーククローネ	1.0%
8 スウェーデンクローネ	0.9%
9 香港ドル	0.5%
10 シンガポールドル	0.3%

組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
1 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	4.6%
2 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	4.5%
3 NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	アメリカ	4.3%
4 AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	アメリカ	2.6%
5 META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	アメリカ	1.6%
6 ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	アメリカ	1.6%
7 ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	アメリカ	1.4%
8 ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	アメリカ	1.0%
9 BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	アメリカ	1.0%
10 JPMORGAN CHASE & CO	銀行	アメリカ	0.9%

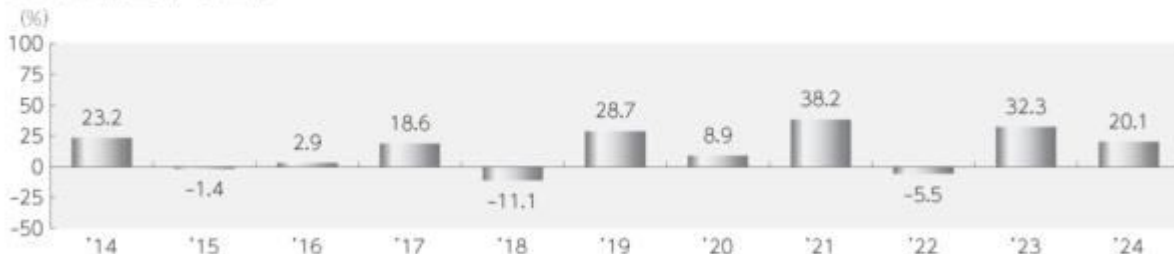
その他資産の状況	比率
株価指数先物取引（買建）	3.4%

●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



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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

申込単位

１円以上１円単位

申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

申込価額の照会方法

申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

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/>

申込手数料

ありません。

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。

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。

ただし、2024年11月５日以降は、以下の通りとなります。

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30分までに、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。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

取得申込みの受付の中止および取消し

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

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

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

解約単位

1口単位

解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

信託財産留保額

ありません。

解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

支払開始日

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して6営業日目から販売会社において支払います。

解約請求受付時間

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

ただし、2024年11月5日以降は、以下の通りとなります。

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時30分までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

解約請求受付の中止および取消し

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

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口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せん。

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

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

・外国為替予約取引

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

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

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（2006年5月15日設定）

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

（４）【計算期間】

毎年５月13日から翌年５月12日まで

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

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

ファンドの償還条件等

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

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

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

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

信託約款の変更

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

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

ファンドの償還等に関する開示方法

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

異議申立ておよび反対者の買取請求権

受益者は、委託会社がファンドの任意償還または信託約款について重大な内容の変更を行おうとする場合、原則として、一定の期間（１ヵ月以上）内に委託会社に対して異議を述べるすることができます。異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。なお、一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の２分の１を超えるときは、ファンドの償還または信託約款

の変更を行いません。その場合、償還しない旨または信託約款を変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、原則として、これらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。

関係法人との契約の更改

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

運用報告書

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

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

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。

公告

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

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

（１）収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

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

（２）償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

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

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

（３）換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。
くわしくは「第２ 管理及び運営 ２ 換金（解約）手続等」を参照してください。

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（2023年5月13日から2024年5月13日まで）の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三菱ＵＦＪ ＤＣ海外株式インデックスファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第17期 [2023年 5月12日現在]	第18期 [2024年 5月13日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	373,614,854	649,616,849
親投資信託受益証券	145,324,008,731	236,735,268,705
未収入金	201,093,360	277,786,725
未収利息	-	1,127
流動資産合計	145,898,716,945	237,662,673,406
資産合計	145,898,716,945	237,662,673,406
負債の部		
流動負債		
未払解約金	401,142,541	655,270,478
未払受託者報酬	40,838,258	62,953,538
未払委託者報酬	115,089,583	177,414,449
未払利息	442	-
流動負債合計	557,070,824	895,638,465
負債合計	557,070,824	895,638,465
純資産の部		
元本等		
元本	39,138,271,441	44,437,943,230
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	106,203,374,680	192,329,091,711
（分配準備積立金）	34,868,879,323	93,416,792,233
元本等合計	145,341,646,121	236,767,034,941
純資産合計	145,341,646,121	236,767,034,941
負債純資産合計	145,898,716,945	237,662,673,406

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期 自 2022年 5月13日 至 2023年 5月12日	第18期 自 2023年 5月13日 至 2024年 5月13日
営業収益		
受取利息	1,683	63,769
有価証券売買等損益	14,902,069,844	68,522,924,872
営業収益合計	14,902,071,527	68,522,988,641
営業費用		
支払利息	115,095	110,016
受託者報酬	78,294,210	113,846,987
委託者報酬	220,647,178	320,841,394
営業費用合計	299,056,483	434,798,397
営業利益又は営業損失（ ）	14,603,015,044	68,088,190,244
経常利益又は経常損失（ ）	14,603,015,044	68,088,190,244
当期純利益又は当期純損失（ ）	14,603,015,044	68,088,190,244
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	1,151,750,818	4,615,606,670
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	77,426,077,383	106,203,374,680
剰余金増加額又は欠損金減少額	28,663,188,609	40,486,407,273
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	28,663,188,609	40,486,407,273
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,337,155,538	17,833,273,816
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,337,155,538	17,833,273,816
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	106,203,374,680	192,329,091,711

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年5月12日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は2023年 5月13日から2024年 5月13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17期 [2023年 5月12日現在]	第18期 [2024年 5月13日現在]
1. 期首元本額	33,426,629,134円	39,138,271,441円
期中追加設定元本額	11,405,541,584円	11,693,679,995円
期中一部解約元本額	5,693,899,277円	6,394,008,206円
2. 受益権の総数	39,138,271,441口	44,437,943,230口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第17期 自 2022年 5月13日 至 2023年 5月12日			第18期 自 2023年 5月13日 至 2024年 5月13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	2,484,975,037円	費用控除後の配当等収益額	A	3,444,269,060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	10,966,289,189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	60,028,314,514円
収益調整金額	C	73,762,948,478円	収益調整金額	C	98,912,299,478円
分配準備積立金額	D	21,417,615,097円	分配準備積立金額	D	29,944,208,659円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	108,631,827,801円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	192,329,091,711円
当ファンドの期末残存口数	F	39,138,271,441口	当ファンドの期末残存口数	F	44,437,943,230口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	27,755円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	43,280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17期 自 2022年 5月13日 至 2023年 5月12日	第18期 自 2023年 5月13日 至 2024年 5月13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。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第17期 [2023年 5月12日現在]	第18期 [2024年 5月13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

区分	第17期 [2023年 5月12日現在]	第18期 [2024年 5月13日現在]
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
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17期 [2023年 5月12日現在]	第18期 [2024年 5月13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	14,706,957,943	67,793,194,502
合計	14,706,957,943	67,793,194,502

（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17期 [2023年 5月12日現在]	第18期 [2024年 5月13日現在]
1口当たり純資産額	3.7135円	5.3280円
(1万口当たり純資産額)	(37,135円)	(53,280円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	33,493,006,523	236,735,268,705	
合計		33,493,006,523	236,735,268,705	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[2024年 5月13日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	99,682,828,423
コール・ローン	8,065,540,827
株式	5,289,674,799,903
投資証券	99,085,654,413
派生商品評価勘定	1,040,970,957
未収入金	201,191,867
未収配当金	6,436,782,471
未収利息	13,996
差入委託証拠金	71,085,644,365
流動資産合計	5,575,273,427,222
資産合計	5,575,273,427,222
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,715,502
未払金	96,312,720,364
未払解約金	3,880,216,299
流動負債合計	100,196,652,165
負債合計	100,196,652,165
純資産の部	
元本等	
元本	774,611,668,743
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,700,465,106,314
元本等合計	5,475,076,775,057
純資産合計	5,475,076,775,057
負債純資産合計	5,575,273,427,222

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）

	[2024年 5月13日現在]
1. 期首	2023年 5月13日
期首元本額	492,758,095,240円
期中追加設定元本額	352,635,498,102円

	[2024年 5月13日現在]
期中一部解約元本額	70,781,924,599円
元本の内訳	
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	171,073,754円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	893,008,302円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	878,561,528円
MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信	3,034,428,477円
MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信	5,891,799,426円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	1,282,188,995円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	8,215,040,381円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	10,009,880,008円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）	41,384,222円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）	112,470,690円
ファンド・マネジャー（海外株式）	777,391円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,965,558,508円
eMAXIS バランス（８資産均等型）	938,554,076円
eMAXIS バランス（波乗り型）	82,496,909円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	1,634,797,228円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３０（確定拠出年金）	195,803,100円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４０（確定拠出年金）	269,526,947円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５０（確定拠出年金）	252,504,051円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	103,891,413,789円
海外株式セクション（ラップ向け）	2,155,934,851円
eMAXIS Slim バランス（８資産均等型）	4,946,100,414円
つみたて先進国株式	34,443,030,510円
つみたて８資産均等バランス	2,468,461,341円
つみたて４資産均等バランス	914,754,080円
eMAXIS マイマネージャー １９７０ｓ	1,890,733円
eMAXIS マイマネージャー １９８０ｓ	3,391,309円
eMAXIS マイマネージャー １９９０ｓ	7,068,306円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３５（確定拠出年金）	167,216,984円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４５（確定拠出年金）	220,684,878円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５５（確定拠出年金）	157,763,789円
三菱ＵＦＪ DC年金バランス（株式１５）	60,071,509円
三菱ＵＦＪ DC年金バランス（株式４０）	487,748,865円
三菱ＵＦＪ DC年金バランス（株式６５）	1,423,269,015円
eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）	61,520,603,152円
eMAXIS Slim 全世界株式（３地域均等型）	707,849,391円
三菱ＵＦＪ DC年金インデックス（先進国株式）	4,771,299,276円
eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）	396,564,089,032円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）	150,858,029円
三菱ＵＦＪ DC年金バランス（株式２５）	41,591,609円
つみたて全世界株式	2,595,955,425円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６５（確定拠出年金）	71,658,696円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	2,774,559,091円
三菱ＵＦＪ DC年金バランス（株式８０）	56,059,955円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	2,889,476,184円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	75,454,408円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０７０（確定拠出年金）	568,491円
三菱ＵＦＪ DC海外株式インデックスファンド	33,493,006,523円
eMAXIS 全世界株式インデックス	6,578,209,797円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	539,658,586円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	1,242,558,534円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	209,645,008円
三菱ＵＦＪ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	751,025,076円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	133,788,927円
eMAXIS バランス（４資産均等型）	383,171,553円

	[2024年 5月13日現在]
e M A X I S 最適化バランス（マイゴールキーパー）	79,078,211円
e M A X I S 最適化バランス（マイディフェンダー）	116,954,168円
e M A X I S 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	512,237,230円
e M A X I S 最適化バランス（マイフォワード）	437,696,236円
e M A X I S 最適化バランス（マイストライカー）	905,109,245円
三菱ＵＦＪ 外国株式ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	1,159,859,644円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,334,601円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,774,378,925円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	28,240,118円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	566,476,024円
M U A M 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	8,795,121,217円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	58,173円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	451,419,128円
M U A M 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	4,162,118,971円
アドバンスト・バランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	7,524,849円
アドバンスト・バランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	47,833,270円
M U K A M バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	1,718,105,228円
M U K A M バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	539,064,955円
M U K A M スマート・クオリティ・セクション（適格機関投資家転売制限付）	163,183,895円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	53,264,440円
M U K A M 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	1,504,011,958円
M U K A M バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	74,150,341円
M U K A M 外国株式インデックスファンド２（適格機関投資家限定）	2,574,905,062円
M U K A M スマート・クオリティ・セクション２（適格機関投資家限定）	82,874,954円
M U K A M 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	8,359,055,960円
M U K A M バランス・イノベーション（リスク抑制型）２（適格機関投資家転売制限付）	15,832,711円
マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）	199,817円
海外株式インデックスファンドＳ	8,360,393,838円
外国株式インデックスオープンＶ（適格機関投資家限定）	231,260,768円
全世界株式インデックスファンドＶ（適格機関投資家限定）	122,902,019円
グローバルバランスオープンＶ（適格機関投資家限定）	1,020,334円
全世界株式（除く日本）インデックスファンドＶ（適格機関投資家限定）	27,797,533円
M U A M グローバルバランス（退職給付信託向け）（適格機関投資家限定）	4,776,531,798円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンド	2,924,353,561円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	618,598円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	1,500,623円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	396,072円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	1,689,831円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンドＶＡ	20,214,208円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	686,006円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	5,943,134円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	659,162円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	6,840,467円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>外国株式インデックスファンド	7,097,334,937円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	74,062,642円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	321,266,335円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	358,685,869円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	374,680,568円

	[2024年 5月13日現在]
合計	774,611,668,743円
2. 受益権の総数	774,611,668,743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 2023年 5月13日 至 2024年 5月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年 5月13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	[2024年 5月13日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	776,312,301,806
投資証券	853,097,346
合計	777,165,399,152

(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

[2024年 5月13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				
		91,444,796,873	—	92,472,007,949	1,027,211,076
合計		91,444,796,873	—	92,472,007,949	1,027,211,076

（注）時価の算定方法

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

〔2024年 5月13日現在〕

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	9,718,024,615	—	9,724,667,557	6,642,942
	カナダドル	134,225,000	—	134,525,310	300,310
	オーストラリアドル	110,605,315	—	110,578,234	27,081
	イギリスポンド	179,058,879	—	179,399,736	340,857
	スイスフラン	363,808,480	—	363,990,692	182,212
	香港ドル	55,830,732	—	55,829,053	1,679
	スウェーデンクローネ	69,241,076	—	69,238,668	2,408
	デンマーククローネ	549,739,736	—	552,074,549	2,334,813
	ユーロ	339,293,358	—	339,567,771	274,413
合計		11,519,827,191	—	11,529,871,570	10,044,379

（注）時価の算定方法

- 1 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。
当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
（イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
（ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	〔2024年 5月13日現在〕
1口当たり純資産額	7.0682円
（1万口当たり純資産額）	（70,682円）

附属明細表

第1 有価証券明細表 (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	220,657	30.38	6,703,559.66	
	BAKER HUGHES CO	593,714	32.34	19,200,710.76	
	CHENIERE ENERGY INC	135,380	157.07	21,264,136.60	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	58,377	87.12	5,085,804.24	
	CHEVRON CORP	1,015,711	165.82	168,425,198.02	
	CONOCOPHILLIPS	674,896	121.91	82,276,571.36	
	COTERRA ENERGY INC	444,081	28.08	12,469,794.48	
	DEVON ENERGY CORP	374,397	50.12	18,764,777.64	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	98,666	202.19	19,949,278.54	
	EOG RESOURCES INC	327,549	130.10	42,614,124.90	
	EQT CORP	227,806	38.93	8,868,487.58	
	EXXON MOBIL CORP	2,548,099	117.96	300,573,758.04	
	HALLIBURTON CO	500,674	37.07	18,559,985.18	
	HESS CORP	152,187	160.40	24,410,794.80	
	HF SINCLAIR CORP	77,822	56.67	4,410,172.74	
	KINDER MORGAN INC	1,156,301	19.08	22,062,223.08	
	MARATHON OIL CORP	355,072	26.59	9,441,364.48	
	MARATHON PETROLEUM CORP	214,673	179.56	38,546,683.88	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	372,922	63.57	23,706,651.54	
	ONEOK INC	335,474	80.07	26,861,403.18	
	OVINTIV INC	156,183	49.94	7,799,779.02	
	PHILLIPS 66	252,751	145.60	36,800,545.60	
	SCHLUMBERGER LTD	806,539	48.50	39,117,141.50	
	TARGA RESOURCES CORP	115,380	113.20	13,061,016.00	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	9,681	623.72	6,038,233.32	
	VALERO ENERGY CORP	188,694	156.13	29,460,794.22	
	WILLIAMS COS INC	699,797	39.64	27,739,953.08	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	123,932	250.55	31,051,162.60	
	ALBEMARLE CORP	62,065	129.62	8,044,865.30	
	AMCOR PLC	830,703	10.36	8,606,083.08	
	AVERY DENNISON CORP	47,408	225.61	10,695,718.88	
	BALL CORP	181,633	69.16	12,561,738.28	
	CELANESE CORP	55,524	156.69	8,700,055.56	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	101,273	73.95	7,489,138.35	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	275,888	17.32	4,778,380.16	
	CORTEVA INC	413,021	57.48	23,740,447.08	
	CROWN HOLDINGS INC	62,964	84.03	5,290,864.92	
	DOW INC	405,118	59.41	24,068,060.38	
	DUPONT DE NEMOURS INC	250,741	78.76	19,748,361.16	

EASTMAN CHEMICAL CO	72,970	101.03	7,372,159.10
ECOLAB INC	147,578	233.52	34,462,414.56
FMC CORP	66,809	67.53	4,511,611.77
FREEMPORT-MCMORAN INC	812,647	51.59	41,924,458.73
INTERNATIONAL PAPER CO	197,342	38.58	7,613,454.36
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	145,984	97.18	14,186,725.12
LINDE PLC	275,900	434.39	119,848,201.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	154,531	101.37	15,664,807.47
MARTIN MARIETTA MATERIALS	34,640	610.43	21,145,295.20
MOSAIC CO/THE	174,017	29.43	5,121,320.31
NEWMONT CORP	675,828	42.49	28,715,931.72
NUCOR CORP	138,599	174.47	24,181,367.53
PACKAGING CORP OF AMERICA	55,207	179.40	9,904,135.80
PPG INDUSTRIES INC	136,514	135.33	18,474,439.62
RELIANCE INC	32,720	293.15	9,591,868.00
RPM INTERNATIONAL INC	77,162	112.84	8,706,960.08
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	139,485	320.86	44,755,157.10
STEEL DYNAMICS INC	87,241	135.18	11,793,238.38
VULCAN MATERIALS CO	74,803	272.07	20,351,652.21
WESTLAKE CORP	25,469	158.15	4,027,922.35
WESTROCK CO	151,038	51.64	7,799,602.32
3M CO	312,277	98.93	30,893,563.61
AECOM	82,034	93.05	7,633,263.70
AERCAP HOLDINGS NV	120,566	91.17	10,992,002.22
ALLEGION PLC	47,118	125.99	5,936,396.82
AMETEK INC	133,706	170.80	22,836,984.80
AXON ENTERPRISE INC	39,674	303.43	12,038,281.82
BOEING CO/THE	323,450	178.51	57,739,059.50
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	71,496	166.96	11,936,972.16
CARLISLE COS INC	28,880	416.63	12,032,274.40
CARRIER GLOBAL CORP	451,959	65.50	29,603,314.50
CATERPILLAR INC	290,015	354.79	102,894,421.85
CNH INDUSTRIAL NV	529,492	11.52	6,099,747.84
CUMMINS INC	78,098	298.61	23,320,843.78
DEERE & CO	151,664	407.89	61,862,228.96
DOVER CORP	81,759	185.55	15,170,382.45
EATON CORP PLC	223,846	330.57	73,996,772.22
EMERSON ELECTRIC CO	316,140	115.55	36,529,977.00
FASTENAL CO	319,247	67.88	21,670,486.36
FERGUSON PLC	115,069	221.53	25,491,235.57
FORTIVE CORP	205,604	76.88	15,806,835.52
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	73,576	75.32	5,541,744.32

GE VERNOVA INC	154,505	167.27	25,844,051.35
GENERAL DYNAMICS CORP	130,467	296.44	38,675,637.48
GENERAL ELECTRIC CO	620,103	163.38	101,312,428.14
GRACO INC	88,867	83.56	7,425,726.52
HEICO CORP	23,226	215.44	5,003,809.44
HEICO CORP-CLASS A	47,152	172.15	8,117,216.80
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	375,021	202.92	76,099,261.32
HOWMET AEROSPACE INC	219,860	80.87	17,780,078.20
HUBBELL INC	31,805	407.27	12,953,222.35
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	25,628	252.03	6,459,024.84
IDEX CORP	39,908	226.16	9,025,593.28
ILLINOIS TOOL WORKS	168,143	250.33	42,091,237.19
INGERSOLL-RAND INC	235,808	91.26	21,519,838.08
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	84,100	40.43	3,400,163.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	391,990	65.59	25,710,624.10
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	105,849	219.60	23,244,440.40
LENNOX INTERNATIONAL INC	17,039	494.51	8,425,955.89
LOCKHEED MARTIN CORP	125,102	468.88	58,657,825.76
MASCO CORP	135,869	72.31	9,824,687.39
NORDSON CORP	28,510	278.89	7,951,153.90
NORTHROP GRUMMAN CORP	82,268	474.80	39,060,846.40
OTIS WORLDWIDE CORP	231,793	97.10	22,507,100.30
OWENS CORNING	53,631	176.81	9,482,497.11
PACCAR INC	290,236	109.18	31,687,966.48
PARKER HANNIFIN CORP	72,504	561.13	40,684,169.52
PENTAIR PLC	90,296	83.32	7,523,462.72
QUANTA SERVICES INC	83,333	271.48	22,623,242.84
ROCKWELL AUTOMATION INC	66,320	273.59	18,144,488.80
RTX CORP	820,209	106.32	87,204,620.88
SMITH (A.O.) CORP	75,351	86.38	6,508,819.38
SNAP-ON INC	31,639	280.91	8,887,711.49
STANLEY BLACK & DECKER INC	85,688	89.84	7,698,209.92
TEXTRON INC	113,409	88.55	10,042,366.95
TORO CO	51,819	87.42	4,530,016.98
TRANE TECHNOLOGIES PLC	128,242	331.98	42,573,779.16
TRANSDIGM GROUP INC	31,231	1,310.49	40,927,913.19
UNITED RENTALS INC	38,553	698.13	26,915,005.89
VERTIV HOLDINGS CO-A	203,328	95.40	19,397,491.20
WABTEC CORP	102,624	168.34	17,275,724.16
WATSCO INC	20,130	479.26	9,647,503.80
WW GRAINGER INC	25,293	958.68	24,247,893.24
XYLEM INC	135,895	143.00	19,432,985.00

AUTOMATIC DATA PROCESSING	230,687	246.86	56,947,392.82
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	75,179	156.06	11,732,434.74
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	66,371	195.69	12,988,140.99
CINTAS CORP	50,740	700.27	35,531,699.80
COPART INC	498,707	54.74	27,299,221.18
DAYFORCE INC	81,226	60.70	4,930,418.20
EQUIFAX INC	72,867	241.59	17,603,938.53
JACOBS SOLUTIONS INC	74,200	139.24	10,331,608.00
LEIDOS HOLDINGS INC	76,768	147.48	11,321,744.64
PAYCHEX INC	187,642	122.55	22,995,527.10
PAYCOM SOFTWARE INC	35,074	173.39	6,081,480.86
PAYLOCITY HOLDING CORP	24,837	163.62	4,063,829.94
REPUBLIC SERVICES INC	121,100	189.24	22,916,964.00
ROBERT HALF INC	57,823	70.76	4,091,555.48
ROLLINS INC	150,661	46.63	7,025,322.43
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	132,756	62.96	8,358,317.76
TRANSUNION	106,627	78.00	8,316,906.00
VERALTO CORP	133,020	96.50	12,836,430.00
VERISK ANALYTICS INC	81,461	248.31	20,227,580.91
WASTE CONNECTIONS INC	142,494	167.38	23,850,645.72
WASTE MANAGEMENT INC	230,305	211.49	48,707,204.45
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	75,471	82.72	6,242,961.12
CSX CORP	1,131,742	34.38	38,909,289.96
DELTA AIR LINES INC	96,256	52.60	5,063,065.60
EXPEDITORS INTL WASH INC	85,680	118.33	10,138,514.40
FEDEX CORP	135,703	265.73	36,060,358.19
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	1,217,326	3.50	4,260,641.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	42,716	170.59	7,286,922.44
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	86,238	49.85	4,298,964.30
NORFOLK SOUTHERN CORP	130,488	230.29	30,050,081.52
OLD DOMINION FREIGHT LINE	112,027	185.04	20,729,476.08
SOUTHWEST AIRLINES CO	70,510	27.36	1,929,153.60
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	55,698	66.51	3,704,473.98
UBER TECHNOLOGIES INC	1,056,026	66.99	70,743,181.74
UNION PACIFIC CORP	346,883	247.40	85,818,854.20
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	405,963	147.37	59,826,767.31
APTIV PLC	162,072	82.78	13,416,320.16
BORGWARNER INC	121,246	37.50	4,546,725.00
FORD MOTOR CO	2,234,596	11.99	26,792,806.04
GENERAL MOTORS CO	785,014	45.21	35,490,482.94
LEAR CORP	36,593	131.07	4,796,244.51
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	351,762	9.99	3,514,102.38

TESLA INC	1,626,748	168.47	274,058,235.56
DECKERS OUTDOOR CORP	15,095	861.99	13,011,739.05
DR HORTON INC	169,800	149.97	25,464,906.00
GARMIN LTD	86,203	168.93	14,562,272.79
HASBRO INC	69,310	60.09	4,164,837.90
LENNAR CORP-A	142,731	162.93	23,255,161.83
LULULEMON ATHLETICA INC	65,392	352.96	23,080,760.32
NIKE INC -CL B	695,115	90.94	63,213,758.10
NVR INC	1,822	7,655.39	13,948,120.58
PULTEGROUP INC	124,567	117.68	14,659,044.56
AIRBNB INC-CLASS A	246,172	146.32	36,019,887.04
BOOKING HOLDINGS INC	19,965	3,805.75	75,981,798.75
CAESARS ENTERTAINMENT INC	115,054	36.18	4,162,653.72
CARNIVAL CORP	525,292	14.43	7,579,963.56
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	15,699	3,239.23	50,852,671.77
DARDEN RESTAURANTS INC	69,659	148.25	10,326,946.75
DOMINO'S PIZZA INC	20,479	518.65	10,621,433.35
DOORDASH INC - A	145,489	114.84	16,707,956.76
DRAFTKINGS INC-CL A	239,128	43.27	10,347,068.56
EXPEDIA GROUP INC	79,073	112.84	8,922,597.32
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	143,911	208.08	29,945,000.88
HYATT HOTELS CORP - CL A	24,388	152.20	3,711,853.60
LAS VEGAS SANDS CORP	225,905	46.54	10,513,618.70
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	145,398	240.46	34,962,403.08
MCDONALD'S CORP	412,852	275.00	113,534,300.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	154,928	40.57	6,285,428.96
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	138,908	141.04	19,591,584.32
STARBUCKS CORP	636,992	76.11	48,481,461.12
VAIL RESORTS INC	20,649	198.52	4,099,239.48
WYNN RESORTS LTD	54,362	96.39	5,239,953.18
YUM! BRANDS INC	159,504	137.62	21,950,940.48
ALPHABET INC-CL A	3,363,102	168.65	567,187,152.30
ALPHABET INC-CL C	2,926,997	170.29	498,438,319.13
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	53,480	275.55	14,736,414.00
COMCAST CORP-CLASS A	2,290,197	39.31	90,027,644.07
ELECTRONIC ARTS INC	146,773	127.14	18,660,719.22
FOX CORP - CLASS A	120,205	33.41	4,016,049.05
FOX CORP - CLASS B	88,642	30.94	2,742,583.48
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	239,094	31.15	7,447,778.10
LIBERTY BROADBAND-C	64,383	53.06	3,416,161.98
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	109,976	70.01	7,699,419.76
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	91,985	24.69	2,271,109.65

LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	96,075	97.02	9,321,196.50
MATCH GROUP INC	134,711	30.69	4,134,280.59
META PLATFORMS INC-CLASS A	1,261,354	476.20	600,656,774.80
NETFLIX INC	249,013	610.87	152,114,571.31
NEWS CORP - CLASS A	205,514	25.03	5,144,015.42
OMNICOM GROUP	113,234	95.82	10,850,081.88
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	317,208	13.05	4,139,564.40
PINTEREST INC- CLASS A	331,931	42.00	13,941,102.00
ROBLOX CORP -CLASS A	242,978	31.45	7,641,658.10
ROKU INC	59,908	57.91	3,469,272.28
SEA LTD-ADR	212,887	64.91	13,818,495.17
SIRIUS XM HOLDINGS INC	334,269	3.03	1,012,835.07
SNAP INC - A	613,729	16.01	9,825,801.29
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	95,193	145.88	13,886,754.84
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	255,033	87.26	22,254,179.58
WALT DISNEY CO/THE	1,044,563	105.79	110,504,319.77
WARNER BROS DISCOVERY INC	1,344,492	8.15	10,957,609.80
AMAZON.COM INC	5,284,300	187.48	990,700,564.00
AUTOZONE INC	9,577	2,979.32	28,532,947.64
BATH & BODY WORKS INC	130,365	47.55	6,198,855.75
BEST BUY CO INC	102,296	74.17	7,587,294.32
BURLINGTON STORES INC	37,211	190.40	7,084,974.40
CARMAX INC	84,559	71.71	6,063,725.89
DICK'S SPORTING GOODS INC	33,562	196.09	6,581,172.58
EBAY INC	298,311	51.00	15,213,861.00
ETSY INC	60,720	61.92	3,759,782.40
GENUINE PARTS CO	83,745	155.27	13,003,086.15
GLOBAL-E ONLINE LTD	65,600	29.55	1,938,480.00
HOME DEPOT INC	566,732	346.43	196,332,966.76
LKQ CORP	157,065	44.21	6,943,843.65
LOWE'S COS INC	328,502	235.03	77,207,825.06
MERCADOLIBRE INC	25,719	1,693.97	43,567,214.43
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	33,437	1,019.33	34,083,337.21
POOL CORP	21,752	374.21	8,139,815.92
ROSS STORES INC	195,243	133.48	26,061,035.64
TJX COMPANIES INC	640,302	98.81	63,268,240.62
TRACTOR SUPPLY COMPANY	63,516	271.43	17,240,147.88
ULTA BEAUTY INC	26,292	401.59	10,558,604.28
WILLIAMS-SONOMA INC	32,309	315.94	10,207,705.46
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	183,466	20.74	3,805,084.84
COSTCO WHOLESALE CORP	252,220	787.19	198,545,061.80
DOLLAR GENERAL CORP	126,974	140.95	17,896,985.30

DOLLAR TREE INC	115,976	121.04	14,037,735.04
KROGER CO	387,622	55.90	21,668,069.80
SYSCO CORP	280,521	76.17	21,367,284.57
TARGET CORP	260,156	163.13	42,439,248.28
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	387,829	17.19	6,666,780.51
WALMART INC	2,519,079	60.48	152,353,897.92
ALTRIA GROUP INC	1,008,320	44.90	45,273,568.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	296,589	62.98	18,679,175.22
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	185,783	49.12	9,125,660.96
BUNGE GLOBAL SA	83,582	106.03	8,862,199.46
CAMPBELL SOUP CO	120,360	45.95	5,530,542.00
CELSIUS HOLDINGS INC	80,388	82.81	6,656,930.28
COCA-COLA CO/THE	2,329,297	63.26	147,351,328.22
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	116,740	73.83	8,618,914.20
CONAGRA BRANDS INC	284,657	31.13	8,861,372.41
CONSTELLATION BRANDS INC-A	90,935	261.95	23,820,423.25
DARLING INGREDIENTS INC	88,310	46.35	4,093,168.50
GENERAL MILLS INC	313,584	70.70	22,170,388.80
HERSHEY CO/THE	81,802	204.78	16,751,413.56
HORMEL FOODS CORP	189,173	35.63	6,740,233.99
JM SMUCKER CO/THE	55,002	115.34	6,343,930.68
KELLANOVA	155,222	61.86	9,602,032.92
KEURIG DR PEPPER INC	625,118	34.03	21,272,765.54
KRAFT HEINZ CO/THE	498,155	36.24	18,053,137.20
LAMB WESTON HOLDINGS INC	79,379	85.16	6,759,915.64
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	148,517	76.15	11,309,569.55
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	99,682	59.05	5,886,222.10
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	765,796	71.20	54,524,675.20
MONSTER BEVERAGE CORP	448,501	55.46	24,873,865.46
PEPSICO INC	780,745	179.79	140,370,143.55
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	882,605	99.66	87,960,414.30
TYSON FOODS INC-CL A	165,986	59.65	9,901,064.90
CHURCH & DWIGHT CO INC	138,870	107.31	14,902,139.70
CLOROX COMPANY	70,270	143.35	10,073,204.50
COLGATE-PALMOLIVE CO	436,504	95.10	41,511,530.40
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	128,682	132.00	16,986,024.00
KENVUE INC	1,009,703	20.54	20,739,299.62
KIMBERLY-CLARK CORP	185,600	136.67	25,365,952.00
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,338,368	166.85	223,306,700.80
ABBOTT LABORATORIES	988,638	104.74	103,549,944.12
ALIGN TECHNOLOGY INC	39,533	271.70	10,741,116.10
BAXTER INTERNATIONAL INC	277,171	35.69	9,892,232.99

BECTON DICKINSON AND CO	163,215	235.67	38,464,879.05
BOSTON SCIENTIFIC CORP	823,443	73.69	60,679,514.67
CARDINAL HEALTH INC	136,795	99.53	13,615,206.35
CENCORA INC	94,871	224.60	21,308,026.60
CENTENE CORP	297,829	77.79	23,168,117.91
COOPER COS INC/THE	119,122	94.76	11,288,000.72
CVS HEALTH CORP	722,912	55.82	40,352,947.84
DAVITA INC	29,535	137.52	4,061,653.20
DEXCOM INC	222,118	127.05	28,220,091.90
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	349,812	86.72	30,335,696.64
ELEVANCE HEALTH INC	131,813	539.18	71,070,933.34
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	233,011	83.40	19,433,117.40
HCA HEALTHCARE INC	115,217	326.65	37,635,633.05
HENRY SCHEIN INC	70,861	73.31	5,194,819.91
HOLOGIC INC	144,223	75.14	10,836,916.22
HUMANA INC	71,884	335.59	24,123,551.56
IDEXX LABORATORIES INC	48,033	509.82	24,488,184.06
INSULET CORP	41,321	165.90	6,855,153.90
INTUITIVE SURGICAL INC	200,897	386.70	77,686,869.90
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	50,788	207.67	10,547,143.96
MCKESSON CORP	76,498	559.91	42,831,995.18
MEDTRONIC PLC	759,039	82.84	62,878,790.76
MOLINA HEALTHCARE INC	31,568	354.60	11,194,012.80
QUEST DIAGNOSTICS INC	68,501	138.42	9,481,908.42
RESMED INC	81,674	213.82	17,463,534.68
SOLVENTUM CORP	73,943	63.74	4,713,126.82
STERIS PLC	56,061	231.33	12,968,591.13
STRYKER CORP	191,671	330.58	63,362,599.18
TELEFLEX INC	25,117	203.93	5,122,109.81
THE CIGNA GROUP	164,305	348.39	57,242,218.95
UNITEDHEALTH GROUP INC	526,478	512.81	269,983,183.18
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	31,888	178.09	5,678,933.92
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	88,545	203.78	18,043,700.10
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	117,535	121.31	14,258,170.85
ABBVIE INC	1,005,132	160.75	161,574,969.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	168,056	149.76	25,168,066.56
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	73,985	150.47	11,132,522.95
AMGEN INC	305,357	310.15	94,706,473.55
AVANTOR INC	389,080	24.79	9,645,293.20
BIO-RAD LABORATORIES-A	11,720	282.00	3,305,040.00
BIO-TECHNE CORP	84,689	80.91	6,852,186.99
BIOGEN INC	81,283	221.50	18,004,184.50

BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	99,283	81.03	8,044,901.49
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,147,748	44.94	51,579,795.12
CATALENT INC	93,028	55.81	5,191,892.68
CHARLES RIVER LABORATORIES	29,813	228.12	6,800,941.56
DANAHER CORP	400,671	253.38	101,522,017.98
ELI LILLY & CO	458,776	760.00	348,669,760.00
EXACT SCIENCES CORP	103,405	53.51	5,533,201.55
GILEAD SCIENCES INC	714,563	65.96	47,132,575.48
ILLUMINA INC	91,078	110.53	10,066,851.34
INCYTE CORP	115,210	53.06	6,113,042.60
IQVIA HOLDINGS INC	107,104	234.08	25,070,904.32
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	31,964	109.63	3,504,213.32
JOHNSON & JOHNSON	1,368,574	149.91	205,162,928.34
MERCK & CO. INC.	1,442,273	130.06	187,582,026.38
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	12,144	1,510.25	18,340,476.00
MODERNA INC	179,346	117.31	21,039,079.26
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	51,839	136.70	7,086,391.30
PFIZER INC	3,228,338	28.01	90,425,747.38
REGENERON PHARMACEUTICALS	61,246	973.80	59,641,354.80
REPLIGEN CORP	27,634	166.81	4,609,627.54
REVVITY INC	76,788	104.80	8,047,382.40
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	208,355	28.09	5,852,691.95
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	608,467	16.25	9,887,588.75
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	220,408	593.03	130,708,556.24
UNITED THERAPEUTICS CORP	24,588	264.27	6,497,870.76
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	144,735	422.78	61,191,063.30
VIATRIS INC	629,398	11.16	7,024,081.68
WATERS CORP	35,175	351.11	12,350,294.25
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	43,055	364.19	15,680,200.45
ZOETIS INC	263,692	169.04	44,574,495.68
BANK OF AMERICA CORP	4,053,564	38.45	155,859,535.80
CITIGROUP INC	1,067,935	63.53	67,845,910.55
CITIZENS FINANCIAL GROUP	256,640	36.06	9,254,438.40
FIFTH THIRD BANCORP	394,016	38.78	15,279,940.48
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	5,538	1,736.90	9,618,952.20
HUNTINGTON BANCSHARES INC	784,804	14.06	11,034,344.24
JPMORGAN CHASE & CO	1,642,212	198.77	326,422,479.24
KEYCORP	488,764	15.08	7,370,561.12
M & T BANK CORP	93,007	153.66	14,291,455.62
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	229,345	157.58	36,140,185.10
REGIONS FINANCIAL CORP	526,791	19.83	10,446,265.53
TRUIST FINANCIAL CORP	769,144	39.47	30,358,113.68

US BANCORP	880,591	41.85	36,852,733.35
WELLS FARGO & CO	2,064,997	61.89	127,802,664.33
ALLY FINANCIAL INC	150,075	39.41	5,914,455.75
AMERICAN EXPRESS CO	332,610	242.30	80,591,403.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	56,185	433.55	24,359,006.75
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	269,558	19.97	5,383,073.26
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	230,296	112.06	25,806,969.76
ARES MANAGEMENT CORP - A	98,146	142.27	13,963,231.42
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	428,435	58.44	25,037,741.40
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	744,223	412.05	306,657,087.15
BLACKROCK INC	84,919	796.67	67,652,419.73
BLACKSTONE INC	408,014	124.04	50,610,056.56
BLOCK INC	320,741	71.31	22,872,040.71
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	211,664	142.56	30,174,819.84
CARLYLE GROUP INC/THE	126,277	42.50	5,366,772.50
CBOE GLOBAL MARKETS INC	62,382	181.06	11,294,884.92
CME GROUP INC	201,875	208.46	42,082,862.50
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	98,501	200.92	19,790,820.92
COREBRIDGE FINANCIAL INC	135,682	29.55	4,009,403.10
CORPAY INC	40,935	283.44	11,602,616.40
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	147,039	123.40	18,144,612.60
EQUITABLE HOLDINGS INC	194,443	39.84	7,746,609.12
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	21,946	439.16	9,637,805.36
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	336,456	74.64	25,113,075.84
FISERV INC	336,910	154.22	51,958,260.20
FRANKLIN RESOURCES INC	152,703	23.74	3,625,169.22
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	37,000	68.90	2,549,300.00
GLOBAL PAYMENTS INC	151,430	109.23	16,540,698.90
GOLDMAN SACHS GROUP INC	186,010	454.73	84,584,327.30
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	321,077	133.99	43,021,107.23
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	37,305	169.24	6,313,498.20
KKR & CO INC	332,391	103.13	34,279,483.83
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	42,069	268.64	11,301,416.16
MARKETAXESS HOLDINGS INC	18,161	206.11	3,743,163.71
MASTERCARD INC - A	475,451	456.98	217,271,597.98
MOODY'S CORP	92,936	400.35	37,206,927.60
MORGAN STANLEY	703,233	98.28	69,113,739.24
MSCI INC	45,899	485.16	22,268,358.84
NASDAQ INC	197,159	60.66	11,959,664.94
NORTHERN TRUST CORP	120,683	86.70	10,463,216.10
PAYPAL HOLDINGS INC	587,337	62.93	36,961,117.41
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	111,311	125.70	13,991,792.70

ROBINHOOD MARKETS INC - A	227,332	16.23	3,689,598.36
S&P GLOBAL INC	184,758	431.57	79,736,010.06
SCHWAB (CHARLES) CORP	843,439	76.11	64,194,142.29
SEI INVESTMENTS COMPANY	60,138	68.50	4,119,453.00
STATE STREET CORP	173,980	76.58	13,323,388.40
SYNCHRONY FINANCIAL	229,216	45.73	10,482,047.68
T ROWE PRICE GROUP INC	125,316	111.60	13,985,265.60
TOAST INC-CLASS A	172,934	26.83	4,639,819.22
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	56,615	110.41	6,250,862.15
VISA INC-CLASS A SHARES	898,755	280.74	252,316,478.70
AFLAC INC	319,652	86.08	27,515,644.16
ALLSTATE CORP	150,417	172.71	25,978,520.07
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	36,267	131.35	4,763,670.45
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	406,176	80.11	32,538,759.36
AON PLC-CLASS A	114,614	293.10	33,593,363.40
ARCH CAPITAL GROUP LTD	214,039	100.05	21,414,601.95
ARTHUR J GALLAGHER & CO	122,758	250.82	30,790,161.56
ASSURANT INC	28,492	176.50	5,028,838.00
BROWN & BROWN INC	142,201	87.07	12,381,441.07
CHUBB LTD	232,195	254.84	59,172,573.80
CINCINNATI FINANCIAL CORP	89,731	118.87	10,666,323.97
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	12,973	406.57	5,274,432.61
EVEREST GROUP LTD	22,854	382.93	8,751,482.22
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	152,029	51.53	7,834,054.37
GLOBE LIFE INC	49,712	86.50	4,300,088.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	167,347	101.89	17,050,985.83
LOEWS CORP	113,501	77.98	8,850,807.98
MARKEL GROUP INC	7,277	1,652.22	12,023,204.94
MARSH & MCLENNAN COS	276,014	205.55	56,734,677.70
METLIFE INC	363,442	72.73	26,433,136.66
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	142,164	83.96	11,936,089.44
PROGRESSIVE CORP	327,772	215.76	70,720,086.72
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	211,962	118.83	25,187,444.46
TRAVELERS COS INC/THE	129,589	218.50	28,315,196.50
WILLIS TOWERS WATSON PLC	57,587	256.93	14,795,827.91
WR BERKLEY CORP	123,178	79.74	9,822,213.72
ACCENTURE PLC-CL A	357,066	306.33	109,380,027.78
ADOBE INC	257,405	482.29	124,143,857.45
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	90,523	91.19	8,254,792.37
ANSYS INC	50,694	328.25	16,640,305.50
APPROVIN CORP-CLASS A	102,190	86.43	8,832,281.70
ASPEN TECHNOLOGY INC	16,366	209.08	3,421,803.28

ATLASSIAN CORP-CL A	89,690	179.75	16,121,777.50
AUTODESK INC	124,555	217.77	27,124,342.35
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	115,702	55.48	6,419,146.96
BILL HOLDINGS INC	41,762	56.48	2,358,717.76
CADENCE DESIGN SYS INC	155,775	287.48	44,782,197.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	53,285	151.57	8,076,407.45
CLOUDFLARE INC - CLASS A	166,624	71.92	11,983,598.08
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	288,979	66.98	19,355,813.42
CONFLUENT INC-CLASS A	90,238	29.42	2,654,801.96
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	130,932	320.76	41,997,748.32
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	21,827	233.57	5,098,132.39
DATADOG INC - CLASS A	153,151	118.97	18,220,374.47
DOCUSIGN INC	117,791	58.03	6,835,411.73
DROPBOX INC-CLASS A	143,057	23.13	3,308,908.41
DYNATRACE INC	144,110	46.21	6,659,323.10
EPAM SYSTEMS INC	29,589	183.40	5,426,622.60
FAIR ISAAC CORP	14,348	1,328.61	19,062,896.28
FORTINET INC	376,625	58.16	21,904,510.00
GARTNER INC	42,848	439.27	18,821,840.96
GEN DIGITAL INC	292,070	23.46	6,851,962.20
GODADDY INC - CLASS A	71,554	133.92	9,582,511.68
HUBSPOT INC	27,985	597.95	16,733,630.75
INTL BUSINESS MACHINES CORP	519,967	167.15	86,912,484.05
INTUIT INC	159,758	632.31	101,016,580.98
MANHATTAN ASSOCIATES INC	38,101	217.73	8,295,730.73
MICROSOFT CORP	4,011,017	414.74	1,663,529,190.58
MONDAY.COM LTD	14,400	181.76	2,617,344.00
MONGODB INC	40,846	353.47	14,437,835.62
OKTA INC	92,998	97.42	9,059,865.16
ORACLE CORP	938,293	116.67	109,470,644.31
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	1,036,127	20.60	21,344,216.20
PALO ALTO NETWORKS INC	180,408	297.47	53,665,967.76
PTC INC	65,062	180.00	11,711,160.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	61,345	523.50	32,114,107.50
SALESFORCE INC	551,213	276.67	152,504,100.71
SAMSARA INC-CL A	92,043	39.84	3,666,993.12
SERVICENOW INC	115,596	729.79	84,360,804.84
SNOWFLAKE INC-CLASS A	159,302	157.15	25,034,309.30
SYNOPSYS INC	86,997	556.71	48,432,099.87
TWILIO INC - A	101,280	60.10	6,086,928.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	24,361	484.76	11,809,238.36
UIPATH INC - CLASS A	198,903	19.22	3,822,915.66

UNITY SOFTWARE INC	132,776	21.69	2,879,911.44
VERISIGN INC	55,384	171.23	9,483,402.32
WIX.COM LTD	30,341	122.26	3,709,490.66
WORKDAY INC-CLASS A	119,233	246.34	29,371,857.22
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	140,544	61.97	8,709,511.68
ZSCALER INC	53,450	174.62	9,333,439.00
AMPHENOL CORP-CL A	341,373	127.57	43,548,953.61
APPLE INC	8,344,098	183.05	1,527,387,138.90
ARISTA NETWORKS INC	151,156	314.03	47,467,518.68
CDW CORP/DE	74,230	222.46	16,513,205.80
CISCO SYSTEMS INC	2,304,552	48.06	110,756,769.12
CORNING INC	475,112	34.17	16,234,577.04
DELL TECHNOLOGIES -C	130,598	132.77	17,339,496.46
F5 INC	35,964	171.62	6,172,141.68
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	730,353	17.06	12,459,822.18
HP INC	528,091	29.72	15,694,864.52
JABIL INC	66,575	117.95	7,852,521.25
JUNIPER NETWORKS INC	170,230	34.64	5,896,767.20
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	102,332	150.21	15,371,289.72
MOTOROLA SOLUTIONS INC	91,255	362.85	33,111,876.75
NETAPP INC	121,738	108.50	13,208,573.00
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	116,599	94.01	10,961,471.99
SUPER MICRO COMPUTER INC	28,843	798.50	23,031,135.50
TE CONNECTIVITY LTD	178,510	146.19	26,096,376.90
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	27,598	393.49	10,859,537.02
TRIMBLE INC	130,417	56.80	7,407,685.60
WESTERN DIGITAL CORP	188,209	71.60	13,475,764.40
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	30,509	315.80	9,634,742.20
AT&T INC	4,068,780	17.17	69,860,952.60
LIBERTY GLOBAL LTD-C	110,741	17.23	1,908,067.43
T-MOBILE US INC	294,660	164.20	48,383,172.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,390,117	40.40	96,560,726.80
AES CORP	353,972	19.94	7,058,201.68
ALLIANT ENERGY CORP	149,496	51.33	7,673,629.68
AMEREN CORPORATION	142,796	74.40	10,624,022.40
AMERICAN ELECTRIC POWER	292,410	91.61	26,787,680.10
AMERICAN WATER WORKS CO INC	108,003	135.50	14,634,406.50
ATMOS ENERGY CORP	91,064	117.18	10,670,879.52
CENTERPOINT ENERGY INC	354,590	29.70	10,531,323.00
CMS ENERGY CORP	173,174	62.93	10,897,839.82
CONSOLIDATED EDISON INC	202,194	97.70	19,754,353.80
CONSTELLATION ENERGY	182,753	214.93	39,279,102.29

DOMINION ENERGY INC	468,338	53.07	24,854,697.66
DTE ENERGY COMPANY	117,670	115.49	13,589,708.30
DUKE ENERGY CORP	440,357	102.67	45,211,453.19
EDISON INTERNATIONAL	215,379	74.89	16,129,733.31
ENTERGY CORP	115,804	111.99	12,968,889.96
ESSENTIAL UTILITIES INC	146,859	39.24	5,762,747.16
EVERGY INC	138,949	55.42	7,700,553.58
EVERSOURCE ENERGY	211,633	61.92	13,104,315.36
EXELON CORP	553,937	37.67	20,866,806.79
FIRSTENERGY CORP	313,958	39.94	12,539,482.52
NEXTERA ENERGY INC	1,168,898	73.79	86,252,983.42
NISOURCE INC	260,713	28.68	7,477,248.84
NRG ENERGY INC	127,510	83.65	10,666,211.50
P G & E CORP	1,158,371	17.83	20,653,754.93
PPL CORP	421,673	29.14	12,287,551.22
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	272,300	74.01	20,152,923.00
SEMPRA	364,613	77.18	28,140,831.34
SOUTHERN CO/THE	607,675	78.14	47,483,724.50
VISTRA CORP	188,705	93.42	17,628,821.10
WEC ENERGY GROUP INC	178,536	85.43	15,252,330.48
XCEL ENERGY INC	322,605	55.46	17,891,673.30
ADVANCED MICRO DEVICES	919,129	151.92	139,634,077.68
ANALOG DEVICES INC	282,525	207.19	58,536,354.75
APPLIED MATERIALS INC	472,381	209.73	99,072,467.13
BROADCOM INC	252,693	1,332.80	336,789,230.40
ENPHASE ENERGY INC	80,001	108.35	8,668,108.35
ENTEGRIS INC	85,564	131.55	11,255,944.20
FIRST SOLAR INC	53,586	191.05	10,237,605.30
INTEL CORP	2,400,635	29.85	71,658,954.75
KLA CORP	77,420	718.27	55,608,463.40
LAM RESEARCH CORP	73,993	915.42	67,734,672.06
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	71,939	69.55	5,003,357.45
MARVELL TECHNOLOGY INC	494,603	68.47	33,865,467.41
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	309,713	91.50	28,338,739.50
MICRON TECHNOLOGY INC	628,327	121.24	76,178,365.48
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	26,809	702.54	18,834,394.86
NVIDIA CORP	1,403,241	898.78	1,261,204,945.98
NXP SEMICONDUCTORS NV	145,822	261.73	38,165,992.06
ON SEMICONDUCTOR	247,439	70.46	17,434,551.94
QORVO INC	59,269	97.69	5,789,988.61
QUALCOMM INC	635,353	182.08	115,685,074.24
SKYWORKS SOLUTIONS INC	96,505	92.20	8,897,761.00

	TERADYNE INC	85,879	122.92	10,556,246.68	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	515,397	187.05	96,405,008.85	
	CBRE GROUP INC - A	169,154	90.22	15,261,073.88	
	COSTAR GROUP INC	232,892	89.88	20,932,332.96	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	487,100	3.35	1,631,785.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	82,122	42.36	3,478,687.92	
	アメリカドル 小計	193,674,563		25,518,640,620.68 (3,980,397,564,013)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	312,000	25.51	7,959,120.00	
	CAMECO CORP	253,500	69.60	17,643,600.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	614,100	104.59	64,228,719.00	
	CENOVUS ENERGY INC	801,500	28.07	22,498,105.00	
	ENBRIDGE INC	1,220,400	51.67	63,058,068.00	
	IMPERIAL OIL LTD	106,800	95.44	10,192,992.00	
	KEYERA CORP	124,900	35.54	4,438,946.00	
	MEG ENERGY CORP	137,000	31.00	4,247,000.00	
	PARKLAND CORP	59,200	40.00	2,368,000.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	351,932	50.35	17,719,776.20	
	SUNCOR ENERGY INC	744,500	54.79	40,791,155.00	
	TC ENERGY CORP	577,400	52.78	30,475,172.00	
	TOURMALINE OIL CORP	200,400	65.09	13,044,036.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	281,040	93.53	26,285,671.20	
	BARRICK GOLD CORP	993,700	23.14	22,994,218.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	82,500	70.73	5,835,225.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	400,400	18.24	7,303,296.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	116,100	174.75	20,288,475.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	329,600	19.66	6,479,936.00	
	KINROSS GOLD CORP	677,600	10.38	7,033,488.00	
	LUNDIN MINING CORP	362,100	16.06	5,815,326.00	
	NUTRIEN LTD	275,859	79.47	21,922,514.73	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	243,300	27.86	6,778,338.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	260,900	70.70	18,445,630.00	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	26,600	107.00	2,846,200.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	278,000	75.11	20,880,580.00	
	CAE INC	166,100	28.62	4,753,782.00	
	STANTEC INC	65,700	110.59	7,265,763.00	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	49,100	124.31	6,103,621.00	
	WSP GLOBAL INC	68,400	219.03	14,981,652.00	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	211,400	22.54	4,764,956.00	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	120,300	44.19	5,316,057.00	
	RB GLOBAL INC	94,600	104.53	9,888,538.00	
	THOMSON REUTERS CORP	88,932	229.48	20,408,115.36	

AIR CANADA	62,200	18.80	1,169,360.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	307,800	174.21	53,621,838.00
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	535,000	113.34	60,636,900.00
TFI INTERNATIONAL INC	42,800	188.25	8,057,100.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	162,200	64.11	10,398,642.00
BRP INC/CA- SUB VOTING	15,700	96.21	1,510,497.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	74,300	45.93	3,412,599.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	168,710	100.16	16,897,993.60
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	25,300	144.07	3,644,971.00
DOLLARAMA INC	153,500	118.32	18,162,120.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	443,800	75.69	33,591,222.00
EMPIRE CO LTD 'A'	108,000	32.84	3,546,720.00
LOBLAW COMPANIES LTD	92,800	156.12	14,487,936.00
METRO INC/CN	119,000	74.08	8,815,520.00
WESTON (GEORGE) LTD	36,011	190.00	6,842,090.00
SAPUTO INC	150,300	27.25	4,095,675.00
BANK OF MONTREAL	413,800	128.16	53,032,608.00
BANK OF NOVA SCOTIA	693,500	65.67	45,542,145.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	539,100	67.55	36,416,205.00
NATIONAL BANK OF CANADA	191,700	116.02	22,241,034.00
ROYAL BANK OF CANADA	809,300	141.08	114,176,044.00
TORONTO-DOMINION BANK	1,000,300	77.38	77,403,214.00
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	187,188	54.35	10,173,667.80
BROOKFIELD CORP	791,450	60.46	47,851,067.00
IGM FINANCIAL INC	39,400	37.63	1,482,622.00
ONEX CORPORATION	41,700	95.33	3,975,261.00
TMX GROUP LTD	176,300	36.48	6,431,424.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	12,000	1,571.02	18,852,240.00
GREAT-WEST LIFE CO INC	176,800	43.28	7,651,904.00
IA FINANCIAL CORP INC	58,800	91.36	5,371,968.00
INTACT FINANCIAL CORP	104,300	228.70	23,853,410.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,033,600	35.60	36,796,160.00
POWER CORP OF CANADA	305,600	40.12	12,260,672.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	322,300	68.51	22,080,773.00
CGI INC	110,700	139.90	15,486,930.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	11,600	3,736.30	43,341,080.00
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	50,600	133.09	6,734,354.00
OPEN TEXT CORP	144,900	41.46	6,007,554.00
SHOPIFY INC - CLASS A	680,000	80.58	54,794,400.00
BCE INC	57,900	46.39	2,685,981.00
QUEBECOR INC -CL B	98,000	30.66	3,004,680.00
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	217,400	54.06	11,752,644.00

	TELUS CORP	231,200	22.01	5,088,712.00	
	ALTAGAS LTD	172,600	30.58	5,278,108.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	94,950	42.91	4,074,304.50	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	58,500	31.83	1,862,055.00	
	EMERA INC	160,600	48.60	7,805,160.00	
	FORTIS INC	276,200	56.19	15,519,678.00	
	HYDRO ONE LTD	169,900	40.47	6,875,853.00	
	NORTHLAND POWER INC	148,200	21.68	3,212,976.00	
	FIRSTSERVICE CORP	24,100	206.00	4,964,600.00	
	カナダドル 小計	22,797,772		1,538,028,743.39 (175,366,037,321)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	168,058	36.15	6,075,296.70	
	SANTOS LTD	1,889,577	7.86	14,852,075.22	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	1,053,960	28.63	30,174,874.80	
	BHP GROUP LTD	2,924,553	42.91	125,492,569.23	
	BLUESCOPE STEEL LTD	246,529	22.07	5,440,895.03	
	FORTESCUE LTD	939,551	26.21	24,625,631.71	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	263,533	55.60	14,652,434.80	
	MINERAL RESOURCES LTD	95,706	77.12	7,380,846.72	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	568,880	14.67	8,345,469.60	
	ORICA LTD	225,412	18.30	4,125,039.60	
	PILBARA MINERALS LTD	1,540,998	4.14	6,379,731.72	
	RIO TINTO LTD	207,976	130.02	27,041,039.52	
	SOUTH32 LTD	2,464,507	3.65	8,995,450.55	
	REECE LTD	130,639	27.40	3,579,508.60	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	92,198	39.94	3,682,388.12	
	BRAMBLES LTD	859,720	14.32	12,311,190.40	
	COMPUTERSHARE LTD	288,146	26.77	7,713,668.42	
	AURIZON HOLDINGS LTD	1,366,902	3.81	5,207,896.62	
	QANTAS AIRWAYS LTD	658,092	6.24	4,106,494.08	
	TRANSURBAN GROUP	1,818,456	12.81	23,294,421.36	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	316,075	39.42	12,459,676.50	
	IDP EDUCATION LTD	98,033	16.24	1,592,055.92	
	LOTTERY CORP LTD/THE	1,165,622	5.08	5,921,359.76	
	CAR GROUP LTD	236,772	34.90	8,263,342.80	
	REA GROUP LTD	32,440	187.32	6,076,660.80	
	SEEK LTD	199,466	23.44	4,675,483.04	
	WESFARMERS LTD	636,548	67.95	43,253,436.60	
	COLES GROUP LTD	725,274	16.24	11,778,449.76	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	801,622	5.20	4,168,434.40	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	700,223	30.72	21,510,850.56	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	476,918	11.74	5,599,017.32	

	COCHLEAR LTD	38,183	320.33	12,231,160.39	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	129,562	50.11	6,492,351.82	
	SONIC HEALTHCARE LTD	252,714	26.76	6,762,626.64	
	CSL LTD	278,028	279.18	77,619,857.04	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	1,668,879	29.09	48,547,690.11	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	945,257	117.54	111,105,507.78	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,797,896	33.81	60,786,863.76	
	WESTPAC BANKING CORP	2,015,943	26.66	53,745,040.38	
	ASX LTD	113,672	64.20	7,297,742.40	
	MACQUARIE GROUP LTD	213,218	193.27	41,208,642.86	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	138,803	32.61	4,526,365.83	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,221,541	6.26	7,646,846.66	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	1,517,475	3.65	5,538,783.75	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	816,152	17.61	14,372,436.72	
	SUNCORP GROUP LTD	676,331	16.25	10,990,378.75	
	WISETECH GLOBAL LTD	85,300	96.72	8,250,216.00	
	XERO LTD	75,597	125.36	9,476,839.92	
	TELSTRA GROUP LTD	2,180,806	3.66	7,981,749.96	
	APA GROUP	737,148	8.78	6,472,159.44	
	ORIGIN ENERGY LTD	1,048,250	9.93	10,409,122.50	
	オーストラリアドル 小計	39,143,141		980,238,072.97 (100,846,892,947)	
イギリスポンド	BP PLC	9,584,101	5.06	48,514,719.26	
	SHELL PLC	3,705,935	29.46	109,176,845.10	
	ANGLO AMERICAN PLC	708,184	27.73	19,641,483.24	
	ANTOFAGASTA PLC	229,746	22.55	5,180,772.30	
	CRH PLC	393,280	67.80	26,664,384.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	81,986	48.65	3,988,618.90	
	ENDEAVOUR MINING PLC	106,898	17.23	1,841,852.54	
	GLENCORE PLC	6,068,192	4.76	28,884,593.92	
	MONDI PLC	239,805	15.75	3,778,127.77	
	RIO TINTO PLC	632,474	56.05	35,450,167.70	
	ASHTAD GROUP PLC	247,826	59.26	14,686,168.76	
	BAE SYSTEMS PLC	1,759,744	13.94	24,530,831.36	
	BUNZL PLC	205,485	31.84	6,542,642.40	
	DCC PLC	56,482	58.50	3,304,197.00	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	818,590	6.01	4,921,363.08	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	4,779,549	4.23	20,246,169.56	
	SMITHS GROUP PLC	180,764	17.27	3,121,794.28	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	46,237	93.50	4,323,159.50	
	EXPERIAN PLC	539,897	34.53	18,642,643.41	
	INTERTEK GROUP PLC	82,511	50.00	4,125,550.00	

RELX PLC	1,083,151	34.59	37,466,193.09
RENTOKIL INITIAL PLC	1,426,851	4.25	6,064,116.75
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	519,922	4.93	2,566,854.91
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	65,065	52.45	3,412,659.25
BURBERRY GROUP PLC	223,981	11.75	2,631,776.75
PERSIMMON PLC	151,061	14.24	2,151,863.94
TAYLOR WIMPEY PLC	2,505,525	1.44	3,615,472.57
COMPASS GROUP PLC	995,178	23.08	22,968,708.24
ENTAIN PLC	318,737	7.78	2,482,323.75
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	102,844	162.45	16,707,007.80
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	88,617	78.90	6,991,881.30
PEARSON PLC	322,789	9.97	3,220,143.06
WHITBREAD PLC	109,945	30.69	3,374,212.05
AUTO TRADER GROUP PLC	520,853	7.48	3,897,022.14
INFORMA PLC	861,202	8.50	7,321,939.40
WPP PLC	574,384	8.45	4,856,991.10
JD SPORTS FASHION PLC	1,458,356	1.21	1,777,735.96
KINGFISHER PLC	1,064,697	2.61	2,785,247.35
NEXT PLC	73,640	92.94	6,844,101.60
OCADO GROUP PLC	232,705	3.48	810,511.51
SAINSBURY (J) PLC	864,017	2.76	2,384,686.92
TESCO PLC	4,028,188	3.11	12,555,861.99
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	178,973	27.02	4,835,850.46
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,159,112	24.33	28,201,194.96
COCA-COLA HBC AG-DI	139,727	27.16	3,794,985.32
DIAGEO PLC	1,282,603	28.50	36,554,185.50
IMPERIAL BRANDS PLC	475,337	18.68	8,879,295.16
HALEON PLC	4,003,569	3.27	13,123,699.18
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	416,618	45.97	19,151,929.46
UNILEVER PLC	1,426,611	42.88	61,173,079.68
SMITH & NEPHEW PLC	543,981	10.04	5,464,289.14
ASTRAZENECA PLC	884,108	123.70	109,364,159.60
GSK PLC	2,309,180	17.99	41,553,694.10
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	72,292	19.94	1,441,502.48
BARCLAYS PLC	8,359,006	2.13	17,884,093.33
HSBC HOLDINGS PLC	10,918,577	6.96	75,993,295.92
LLOYDS BANKING GROUP PLC	34,967,246	0.54	18,987,214.57
NATWEST GROUP PLC	3,044,015	3.19	9,719,539.89
STANDARD CHARTERED PLC	1,327,549	7.75	10,288,504.75
3I GROUP PLC	531,283	28.51	15,146,878.33
ABRDN PLC	805,516	1.58	1,275,131.82
HARGREAVES LANSDOWN PLC	208,222	8.62	1,794,873.64

	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	236,877	91.28	21,622,132.56	
	M&G PLC	1,211,540	2.05	2,489,714.70	
	SCHRODERS PLC	465,209	3.73	1,735,229.57	
	ST JAMES'S PLACE PLC	312,234	4.84	1,513,710.43	
	WISE PLC - A	304,193	7.98	2,428,981.10	
	ADMIRAL GROUP PLC	145,253	27.50	3,994,457.50	
	AVIVA PLC	1,466,553	4.90	7,190,509.35	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,328,554	2.48	8,274,785.24	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	427,896	5.20	2,227,198.68	
	PRUDENTIAL PLC	1,563,873	8.01	12,539,133.71	
	SAGE GROUP PLC/THE	595,993	11.98	7,139,996.14	
	HALMA PLC	207,364	23.28	4,827,433.92	
	BT GROUP PLC	3,495,838	1.05	3,684,613.25	
	VODAFONE GROUP PLC	12,220,327	0.69	8,480,906.93	
	CENTRICA PLC	2,862,357	1.37	3,935,740.87	
	NATIONAL GRID PLC	2,108,846	11.17	23,555,809.82	
	SEVERN TRENT PLC	147,941	25.87	3,827,233.67	
	SSE PLC	627,105	18.12	11,363,142.60	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	366,180	10.94	4,007,840.10	
	イギリスポンド 小計	153,207,052		1,163,919,362.94 (227,243,616,420)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	99,007	14.20	1,405,899.40	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	4,820	768.00	3,701,760.00	
	GIVAUDAN-REG	5,281	4,053.00	21,403,893.00	
	HOLCIM LTD	289,072	81.60	23,588,275.20	
	SIG GROUP AG	180,750	19.19	3,468,592.50	
	SIKA AG-REG	84,709	278.10	23,557,572.90	
	ABB LTD-REG	917,405	47.16	43,264,819.80	
	GEBERIT AG-REG	20,321	550.60	11,188,742.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	11,030	230.50	2,542,415.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	22,674	237.40	5,382,807.60	
	VAT GROUP AG	14,382	470.20	6,762,416.40	
	ADECCO GROUP AG-REG	89,253	34.46	3,075,658.38	
	SGS SA-REG	79,187	82.24	6,512,338.88	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	28,395	248.90	7,067,515.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	308,838	135.50	41,847,549.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	15,105	196.00	2,960,580.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	26,795	39.45	1,057,062.75	
	AVOLTA AG	58,100	37.60	2,184,560.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	1,816	1,533.00	2,783,928.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	516	10,530.00	5,433,480.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	69	106,200.00	7,327,800.00	

	NESTLE SA-REG	1,519,785	95.18	144,653,136.30	
	ALCON INC	284,677	73.60	20,952,227.20	
	SONOVA HOLDING AG-REG	30,986	270.30	8,375,515.80	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	65,136	119.25	7,767,468.00	
	BACHEM HOLDING AG	12,632	83.40	1,053,508.80	
	LONZA GROUP AG-REG	42,468	526.20	22,346,661.60	
	NOVARTIS AG-REG	1,169,032	92.32	107,925,034.24	
	ROCHE HOLDING AG-BR	17,136	246.80	4,229,164.80	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	402,857	225.10	90,683,110.70	
	SANDOZ GROUP AG	237,909	32.55	7,743,937.95	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	14,828	96.30	1,427,936.40	
	JULIUS BAER GROUP LTD	123,773	54.08	6,693,643.84	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	13,341	1,258.50	16,789,648.50	
	UBS GROUP AG-REG	1,883,731	26.95	50,766,550.45	
	BALOISE HOLDING AG - REG	24,788	145.50	3,606,654.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	20,883	124.70	2,604,110.10	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	17,162	648.80	11,134,705.60	
	SWISS RE AG	175,000	106.05	18,558,750.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	82,427	457.40	37,702,109.80	
	TEMENOS AG - REG	34,525	54.40	1,878,160.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	89,920	77.02	6,925,638.40	
	SWISSCOM AG-REG	15,056	501.00	7,543,056.00	
	BKW AG	9,300	142.40	1,324,320.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	41,126	85.60	3,520,385.60	
	スイスフラン 小計	8,586,003		812,723,100.99 (139,812,755,063)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,515,868	41.15	62,377,968.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	787,000	112.00	88,144,000.00	
	MTR CORP	1,006,500	27.85	28,031,025.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	622,000	19.26	11,979,720.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,163,000	37.30	43,379,900.00	
	SANDS CHINA LTD	1,265,600	20.05	25,375,280.00	
	WH GROUP LTD	3,953,000	5.74	22,690,220.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,992,000	25.15	50,098,800.00	
	HANG SENG BANK LTD	496,100	109.10	54,124,510.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	726,800	285.80	207,719,440.00	
	AIA GROUP LTD	6,388,400	64.20	410,135,280.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	2,189,000	9.00	19,701,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	453,000	47.00	21,291,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	855,000	65.50	56,002,500.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	5,821,348	6.28	36,558,065.44	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	675,500	46.70	31,545,850.00	

	CK ASSET HOLDINGS LTD	1,381,368	34.65	47,864,401.20	
	ESR GROUP LTD	1,052,000	10.00	10,520,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	724,000	8.12	5,878,880.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	965,641	24.80	23,947,896.80	
	SINO LAND CO	1,773,400	8.58	15,215,772.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	761,500	77.00	58,635,500.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	221,500	69.35	15,361,025.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	500,800	15.04	7,532,032.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	527,000	24.95	13,148,650.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,110,000	25.35	28,138,500.00	
	香港ドル 小計	38,927,325		1,395,397,215.64 (27,852,128,424)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	100,200	27.04	2,709,408.00	
	KEPPEL LTD	801,600	6.73	5,394,768.00	
	SEATRIM LTD	789,740	1.76	1,389,942.40	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	754,200	3.98	3,001,716.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	860,940	6.75	5,811,345.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	2,772,500	0.88	2,453,662.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	897,000	3.18	2,852,460.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,116,830	35.40	39,535,782.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,943,900	14.12	27,447,868.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	738,300	30.34	22,400,022.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	409,000	9.29	3,799,610.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,413,360	2.40	10,592,064.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	748,700	5.29	3,960,623.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	1,432,100	2.59	3,709,139.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	224,100	5.98	1,340,118.00	
	シンガポールドル 小計	18,002,470		136,398,527.90 (15,703,562,517)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	743,217	7.79	5,789,660.43	
	EBOS GROUP LTD	85,400	34.85	2,976,190.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	313,297	28.85	9,038,618.45	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	1,073,324	4.38	4,701,159.12	
	MERCURY NZ LTD	288,052	6.40	1,843,532.80	
	MERIDIAN ENERGY LTD	765,945	6.17	4,725,880.65	
	ニュージーランドドル 小計	3,269,235		29,075,041.45 (2,727,529,638)	
スウェーデンクローネ	BOLIDEN AB	142,133	369.30	52,489,716.90	
	HOLMEN AB-B SHARES	33,017	445.40	14,705,771.80	
	SVENSKA CELLULOSEA AB SCA-B	304,602	165.30	50,350,710.60	
	ALFA LAVAL AB	159,289	486.80	77,541,885.20	
	ASSA ABLOY AB-B	600,345	315.40	189,348,813.00	

	ATLAS COPCO AB-A SHS	1,580,116	202.50	319,973,490.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	859,982	175.70	151,098,837.40	
	BEIJER REF AB	222,900	168.45	37,547,505.00	
	EPIROC AB-A	411,012	218.00	89,600,616.00	
	EPIROC AB-B	210,487	197.20	41,508,036.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	159,232	89.66	14,276,741.12	
	INDUTRADE AB	150,700	272.80	41,110,960.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	58,459	291.10	17,017,414.90	
	LIFCO AB-B SHS	130,200	277.20	36,091,440.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	745,899	57.20	42,665,422.80	
	SAAB AB-B	160,400	226.30	36,298,520.00	
	SANDVIK AB	641,798	233.10	149,603,113.80	
	SKANSKA AB-B SHS	209,707	192.30	40,326,656.10	
	SKF AB-B SHARES	208,393	237.70	49,535,016.10	
	VOLVO AB-A SHS	129,112	292.80	37,803,993.60	
	VOLVO AB-B SHS	872,806	282.60	246,654,975.60	
	SECURITAS AB-B SHS	235,929	108.55	25,610,092.95	
	VOLVO CAR AB-B	442,279	35.06	15,506,301.74	
	EVOLUTION AB	104,162	1,240.00	129,160,880.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	375,134	170.55	63,979,103.70	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	363,596	279.10	101,479,643.60	
	GETINGE AB-B SHS	131,116	211.90	27,783,480.40	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	93,763	288.00	27,003,744.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	907,944	153.15	139,051,623.60	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	803,955	98.30	79,028,776.50	
	SWEDBANK AB - A SHARES	487,581	219.40	106,975,271.40	
	EQT AB	212,742	325.60	69,268,795.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	91,454	364.80	33,362,419.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	89,196	364.60	32,520,861.60	
	INVESTOR AB-B SHS	966,311	282.35	272,837,910.85	
	LUNDBERGS AB-B SHS	43,685	569.00	24,856,765.00	
	ERICSSON LM-B SHS	1,531,407	58.20	89,127,887.40	
	HEXAGON AB-B SHS	1,187,146	122.05	144,891,169.30	
	TELE2 AB-B SHS	367,709	104.55	38,443,975.95	
	TELIA CO AB	1,284,253	25.83	33,172,254.99	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	296,348	72.00	21,337,056.00	
	SAGAX AB-B	105,140	284.40	29,901,816.00	
	スウェーデンクローネ 小計	18,111,439		3,240,849,465.70 (46,603,415,316)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	166,028	275.90	45,807,125.20	
	EQUINOR ASA	496,346	312.75	155,232,211.50	
	NORSK HYDRO ASA	701,222	66.60	46,701,385.20	

	YARA INTERNATIONAL ASA	83,488	320.80	26,782,950.40	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	46,700	831.50	38,831,050.00	
	MOWI ASA	251,136	197.15	49,511,462.40	
	ORKLA ASA	493,828	82.55	40,765,501.40	
	SALMAR ASA	40,591	677.50	27,500,402.50	
	DNB BANK ASA	533,264	203.70	108,625,876.80	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	114,704	186.80	21,426,707.20	
	TELENOR ASA	333,379	126.30	42,105,767.70	
	ノルウェークローネ 小計	3,260,686		603,290,440.30 (8,663,250,722)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	211,746	418.40	88,594,526.40	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	3,501	2,576.00	9,018,576.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	544,248	191.05	103,978,580.40	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	870	10,160.00	8,839,200.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	2,834	10,435.00	29,572,790.00	
	DSV A/S	100,380	1,018.50	102,237,030.00	
	PANDORA A/S	44,829	1,131.50	50,724,013.50	
	CARLSBERG AS-B	58,566	956.20	56,000,809.20	
	COLOPLAST-B	70,770	845.20	59,814,804.00	
	DEMANT A/S	60,610	320.40	19,419,444.00	
	GENMAB A/S	39,585	2,003.00	79,288,755.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	1,825,906	883.20	1,612,640,179.20	
	DANSKE BANK A/S	406,811	190.75	77,599,198.25	
	TRYG A/S	186,282	142.80	26,601,069.60	
	ORSTED A/S	94,899	431.10	40,910,958.90	
	デンマーククローネ 小計	3,651,837		2,365,239,934.45 (53,265,203,323)	
イスラエルシェケル	ICL GROUP LTD	547,223	17.60	9,631,124.80	
	ELBIT SYSTEMS LTD	14,469	741.00	10,721,529.00	
	BANK HAPOLIM BM	615,641	33.92	20,882,542.72	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	900,703	29.46	26,534,710.38	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	759,946	19.10	14,514,968.60	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	107,140	137.00	14,678,180.00	
	NICE LTD	32,481	845.50	27,462,685.50	
	AZRIELI GROUP LTD	14,806	242.00	3,583,052.00	
	イスラエルシェケル 小計	2,992,409		128,008,793.00 (5,376,919,743)	
ユーロ	ENI SPA	1,279,529	15.18	19,423,250.22	
	GALP ENERGIA SGPS SA	244,234	19.94	4,870,025.96	
	NESTE OYJ	240,492	22.45	5,399,045.40	
	OMV AG	76,362	46.84	3,576,796.08	
	REPSOL SA	673,115	14.84	9,989,026.60	

TENARIS SA	260,856	15.96	4,163,261.76
TOTALENERGIES SE	1,238,219	68.68	85,040,880.92
AIR LIQUIDE SA	303,850	186.64	56,710,564.00
AKZO NOBEL N.V.	91,917	63.08	5,798,124.36
ARCELORMITTAL	310,796	23.88	7,421,808.48
ARKEMA	35,633	98.00	3,492,034.00
BASF SE	523,118	48.80	25,530,773.99
COVESTRO AG	104,095	48.21	5,018,419.95
DSM-FIRMENICH AG	109,408	103.10	11,279,964.80
EVONIK INDUSTRIES AG	123,314	20.31	2,504,507.34
HEIDELBERG MATERIALS AG	73,831	102.95	7,600,901.45
OCI NV	80,550	24.70	1,989,585.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	134,656	43.75	5,891,200.00
STORA ENSO OYJ-R SHS	298,391	13.11	3,913,397.96
SYENSQO SA	37,756	94.04	3,550,574.24
SYMRISE AG	70,651	101.95	7,202,869.45
UMICORE	118,677	21.80	2,587,158.60
UPM-KYMMENE OYJ	311,739	34.46	10,742,525.94
VOESTALPINE AG	62,408	25.48	1,590,155.84
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	129,451	39.00	5,048,589.00
AIRBUS SE	333,306	159.84	53,275,631.04
ALSTOM	192,488	17.11	3,293,469.68
BOUYGUES SA	103,648	35.91	3,721,999.68
BRENTAG SE	71,852	77.74	5,585,774.48
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	255,609	80.74	20,637,870.66
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	297,944	41.49	12,361,696.56
DASSAULT AVIATION SA	9,266	206.80	1,916,208.80
EIFFAGE	38,587	105.00	4,051,635.00
FERROVIAL SE	303,733	34.58	10,503,087.14
GEA GROUP AG	88,362	38.36	3,389,566.32
IMCD NV	29,880	147.30	4,401,324.00
KINGSPAN GROUP PLC	92,479	89.15	8,244,502.85
KNORR-BREMSE AG	40,814	74.70	3,048,805.80
KONE OYJ-B	180,414	49.31	8,896,214.34
LEGRAND SA	149,051	103.35	15,404,420.85
LEONARDO SPA	240,845	22.76	5,481,632.20
METSO CORP	358,750	11.32	4,062,843.75
MTU AERO ENGINES AG	28,240	233.40	6,591,216.00
PRYSMIAN SPA	139,842	56.00	7,831,152.00
RATIONAL AG	3,372	796.00	2,684,112.00
REXEL SA	122,383	27.98	3,424,276.34
RHEINMETALL AG	24,268	535.80	13,002,794.40

SAFRAN SA	198,070	212.50	42,089,875.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	311,869	234.00	72,977,346.00
SIEMENS AG-REG	433,487	188.40	81,668,950.80
SIEMENS ENERGY AG	300,754	24.28	7,302,307.12
THALES SA	52,989	167.10	8,854,461.90
VINCI SA	289,310	115.60	33,444,236.00
WARTSILA OYJ ABP	296,181	18.68	5,534,141.98
BUREAU VERITAS SA	201,388	28.14	5,667,058.32
RANDSTAD NV	52,875	49.12	2,597,220.00
TELEPERFORMANCE	29,501	102.60	3,026,802.60
WOLTERS KLUWER	142,806	146.95	20,985,341.70
ADP	17,115	125.40	2,146,221.00
AENA SME SA	40,448	175.90	7,114,803.20
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	338,250	6.66	2,255,451.00
DHL GROUP	568,735	39.58	22,510,531.30
GETLINK SE	172,576	16.59	2,863,035.84
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	176,648	101.60	17,947,436.80
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	40,076	96.60	3,871,341.60
CONTINENTAL AG	69,435	60.88	4,227,202.80
DR ING HC F PORSCHE AG	58,770	81.54	4,792,105.80
FERRARI NV	72,165	374.50	27,025,792.50
MERCEDES-BENZ GROUP AG	455,941	68.19	31,090,616.79
MICHELIN (CGDE)	376,967	37.12	13,993,015.04
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	83,301	49.32	4,108,405.32
RENAULT SA	114,124	48.30	5,512,189.20
STELLANTIS NV	1,261,074	20.28	25,574,580.72
VOLKSWAGEN AG	19,218	134.90	2,592,508.20
VOLKSWAGEN AG-PREF	117,861	116.95	13,783,843.95
ADIDAS AG	89,231	224.40	20,023,436.40
HERMES INTERNATIONAL	17,849	2,296.00	40,981,304.00
KERING	41,639	332.45	13,842,885.55
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	157,641	788.40	124,284,164.40
MONCLER SPA	121,056	63.44	7,679,792.64
PUMA SE	70,653	50.82	3,590,585.46
SEB SA	9,694	115.90	1,123,534.60
ACCOR SA	103,418	41.45	4,286,676.10
AMADEUS IT GROUP SA	254,821	62.26	15,865,155.46
DELIVERY HERO SE	104,269	25.24	2,631,749.56
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	68,879	34.08	2,347,396.32
SODEXO SA	45,147	82.40	3,720,112.80
BOLLORE SE	416,392	6.15	2,562,892.76
PUBLICIS GROUPE	129,210	108.10	13,967,601.00

SCOUT24 SE	41,543	71.15	2,955,784.45
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	457,346	28.01	12,810,261.46
VIVENDI SE	404,329	9.95	4,024,690.86
D'IETEREN GROUP	13,308	216.80	2,885,174.40
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	619,831	42.88	26,578,353.28
PROSUS NV	841,775	33.96	28,586,679.00
ZALANDO SE	125,157	25.24	3,158,962.68
CARREFOUR SA	330,839	16.49	5,455,535.11
JERONIMO MARTINS	169,984	20.38	3,464,273.92
KESKO OYJ-B SHS	133,348	16.45	2,194,241.34
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	548,403	29.69	16,282,085.07
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	477,834	59.48	28,421,566.32
DANONE	356,789	59.50	21,228,945.50
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	367,895	9.82	3,613,464.69
HEINEKEN HOLDING NV	65,661	77.60	5,095,293.60
HEINEKEN NV	157,616	93.76	14,778,076.16
JDE PEET'S NV	53,600	20.96	1,123,456.00
KERRY GROUP PLC-A	86,856	80.00	6,948,480.00
LOTUS BAKERIES	279	9,870.00	2,753,730.00
PERNOD RICARD SA	121,189	149.35	18,099,577.15
REMY COINTREAU	9,646	96.45	930,356.70
BEIERSDORF AG	56,324	147.25	8,293,709.00
HENKEL AG & CO KGAA	57,972	73.10	4,237,753.20
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	102,673	82.28	8,447,934.44
L'OREAL	135,063	453.45	61,244,317.35
AMPLIFON SPA	68,691	34.47	2,367,778.77
BIOMERIEUX	22,555	99.30	2,239,711.50
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	22,646	94.55	2,141,179.30
DIASORIN SPA	9,103	98.54	897,009.62
ESSILORLUXOTTICA	166,205	205.90	34,221,609.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	102,446	40.40	4,138,818.40
FRESENIUS SE & CO KGAA	246,854	28.67	7,077,304.18
KONINKLIJKE PHILIPS NV	445,127	24.88	11,074,759.76
SIEMENS HEALTHINEERS AG	167,713	52.58	8,818,349.54
ARGENX SE	34,568	347.90	12,026,207.20
BAYER AG-REG	548,439	28.95	15,880,051.24
EUROFINS SCIENTIFIC	69,815	57.66	4,025,532.90
GRIFOLS SA	126,564	9.41	1,191,726.62
IPSEN	21,710	119.90	2,603,029.00
MERCK KGAA	70,217	155.50	10,918,743.50
ORION OYJ-CLASS B	50,154	37.68	1,889,802.72
QIAGEN N.V.	131,652	40.87	5,380,617.24

RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	58,531	50.80	2,973,374.80
SANOFI	653,405	94.33	61,635,693.65
SARTORIUS AG-VORZUG	12,941	278.80	3,607,950.80
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	13,983	205.70	2,876,303.10
UCB SA	68,376	123.00	8,410,248.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	290,262	16.23	4,710,952.26
AIB GROUP PLC	865,126	4.98	4,313,518.23
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,312,859	9.71	32,167,860.89
BANCO BPM SPA	723,370	6.22	4,505,148.36
BANCO SANTANDER SA	9,292,565	4.73	43,995,648.99
BANK OF IRELAND GROUP PLC	639,461	9.85	6,298,690.85
BNP PARIBAS	593,817	71.20	42,279,770.40
CAIXABANK SA	2,212,480	4.92	10,903,101.44
COMMERZBANK AG	626,119	14.00	8,768,796.59
CREDIT AGRICOLE SA	617,427	15.45	9,539,247.15
ERSTE GROUP BANK AG	202,525	45.70	9,255,392.50
FINECOBANK SPA	326,073	15.15	4,940,005.95
ING GROEP NV	1,908,807	16.05	30,651,622.80
INTESA SANPAOLO	8,401,099	3.60	30,248,156.94
KBC GROUP NV	137,336	71.38	9,803,043.68
MEDIOBANCA SPA	298,281	14.45	4,310,160.45
NORDEA BANK ABP	1,759,456	11.34	19,952,231.04
SOCIETE GENERALE SA	437,480	25.92	11,339,481.60
UNICREDIT SPA	885,372	36.02	31,895,526.30
ADYEN NV	11,955	1,246.60	14,903,103.00
AMUNDI SA	42,569	71.00	3,022,399.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	1,095,593	15.87	17,395,825.65
DEUTSCHE BOERSE AG	108,813	187.45	20,396,996.85
EDENRED	146,617	47.14	6,911,525.38
EURAZEO SE	19,619	85.60	1,679,386.40
EURONEXT NV	49,351	87.05	4,296,004.55
EXOR NV	49,620	102.40	5,081,088.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	58,617	70.65	4,141,291.05
NEXI SPA	338,814	6.22	2,108,778.33
SOFINA	9,693	222.80	2,159,600.40
WORLDLINE SA	93,323	11.63	1,085,346.49
AEGON LTD	856,692	6.13	5,256,662.11
AGEAS	85,112	45.86	3,903,236.32
ALLIANZ SE-REG	220,131	265.50	58,444,780.50
ASR NEDERLAND NV	95,241	48.68	4,636,331.88
ASSICURAZIONI GENERALI	561,075	24.40	13,690,230.00
AXA SA	1,020,491	33.72	34,410,956.52

HANNOVER RUECK SE	33,983	237.30	8,064,165.90
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	78,575	455.40	35,783,055.00
NN GROUP NV	160,370	45.74	7,335,323.80
POSTE ITALIANE SPA	269,406	12.30	3,315,040.83
SAMPO OYJ-A SHS	268,909	39.43	10,603,081.87
TALANX AG	40,850	69.75	2,849,287.50
BECHTLE AG	39,938	45.64	1,822,770.32
CAPGEMINI SE	86,052	205.40	17,675,080.80
DASSAULT SYSTEMES SE	392,835	38.16	14,990,583.60
NEMETSCHEK SE	32,589	85.35	2,781,471.15
SAP SE	595,150	176.06	104,782,109.00
NOKIA OYJ	3,149,790	3.47	10,958,119.41
CELLNEX TELECOM SA	275,682	33.48	9,229,833.36
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,844,331	21.97	40,519,952.07
ELISA OYJ	88,430	42.14	3,726,440.20
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	180,053	10.37	1,867,149.61
KONINKLIJKE KPN NV	1,778,922	3.40	6,062,566.17
ORANGE	1,094,314	10.57	11,572,370.55
TELECOM ITALIA SPA	3,630,827	0.22	821,293.06
TELEFONICA SA	2,783,952	4.11	11,442,042.72
ACCIONA SA	13,178	121.20	1,597,173.60
E.ON SE	1,248,132	13.19	16,469,101.74
EDP RENOVAVEIS SA	231,965	14.61	3,389,008.65
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,709,490	3.84	6,574,698.54
ELIA GROUP SA/NV	17,969	99.65	1,790,610.85
ENAGAS SA	120,868	14.49	1,751,377.32
ENDESA SA	199,107	17.99	3,581,934.93
ENEL SPA	4,566,849	6.75	30,849,064.99
ENGIE	999,539	15.84	15,832,697.76
FORTUM OYJ	254,538	13.40	3,412,081.89
IBERDROLA SA	3,424,842	12.21	41,817,320.82
REDEIA CORP SA	220,809	16.45	3,632,308.05
RWE AG	362,247	34.50	12,497,521.50
SNAM SPA	1,023,585	4.42	4,530,387.21
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	732,192	7.87	5,763,815.42
VEOLIA ENVIRONNEMENT	396,328	29.27	11,600,520.56
VERBUND AG	48,497	71.15	3,450,561.55
ASM INTERNATIONAL NV	26,424	621.80	16,430,443.20
ASML HOLDING NV	229,314	864.50	198,241,953.00
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	46,282	133.35	6,171,704.70
INFINEON TECHNOLOGIES AG	747,933	38.00	28,421,454.00
STMICROELECTRONICS NV	375,404	37.65	14,135,837.62

	LEG IMMOBILIEN SE	41,849	82.20	3,439,987.80	
	VONOVIA SE	431,666	27.62	11,922,614.92	
	ユーロ 小計	99,494,175		3,011,526,104.17 (505,815,924,456)	
	合 計	605,118,107		5,289,674,799,903 (5,289,674,799,903)	

(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	99,307	12,074,738.13	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	170,912	6,164,795.84	
		AMERICAN TOWER CORP	266,240	49,118,617.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	80,057	15,762,422.73	
		BOSTON PROPERTIES INC	93,232	5,733,768.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	68,399	7,294,069.36	
		CROWN CASTLE INC	250,133	24,890,734.83	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	174,171	24,638,229.66	
		EQUINIX INC	53,682	40,673,777.76	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	94,973	5,963,354.67	
		EQUITY RESIDENTIAL	205,240	13,710,032.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	37,480	9,705,446.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	122,615	17,983,942.05	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	138,287	6,121,965.49	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	437,815	8,559,283.25	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	370,078	6,787,230.52	
		INVITATION HOMES INC	353,860	12,307,250.80	
		IRON MOUNTAIN INC	164,114	13,091,373.78	
		KIMCO REALTY CORP	388,713	7,377,772.74	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	61,851	8,378,954.97	
		PROLOGIS INC	528,050	56,760,094.50	
		PUBLIC STORAGE	91,236	25,175,661.84	
		REALTY INCOME CORP	480,816	26,449,688.16	
		REGENCY CENTERS CORP	92,410	5,504,863.70	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	60,761	12,000,905.11	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	184,446	27,246,363.12	
		SUN COMMUNITIES INC	75,315	8,849,512.50	
		UDR INC	183,019	7,145,061.76	
		VENTAS INC	240,064	11,417,443.84	
		VICI PROPERTIES INC	591,962	17,462,879.00	
		WELLTOWER INC	316,194	31,249,453.02	

		WEYERHAEUSER CO	413,253	12,798,445.41	
		WP CAREY INC	115,948	6,770,203.72	
アメリカドル合計			7,004,633	545,168,335.86 (85,035,357,027)	
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	36,100	1,663,127.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	58,600	1,037,806.00	
カナダドル合計			94,700	2,700,933.00 (307,960,380)	
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS/AU	603,939	4,306,085.07	
		GOODMAN GROUP	965,604	32,492,574.60	
		GPT GROUP	891,183	3,814,263.24	
		MIRVAC GROUP	2,214,980	4,629,308.20	
		SCENTRE GROUP	3,534,724	11,205,075.08	
		STOCKLAND	1,319,965	6,032,240.05	
		VICINITY CENTRES	1,843,215	3,538,972.80	
オーストラリアドル合計			11,373,610	66,018,519.04 (6,791,985,238)	
イギリス ポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	352,124	2,353,948.94	
		SEGRO PLC	726,973	6,398,816.34	
イギリスポンド合計			1,079,097	8,752,765.28 (1,708,889,893)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	1,336,000	47,294,400.00	
香港ドル合計			1,336,000	47,294,400.00 (943,996,224)	
シンガ ポールド ル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	2,228,300	5,793,580.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	2,977,171	5,805,483.45	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,470,700	2,014,859.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	1,782,700	2,210,548.00	
シンガポールドル合計			8,458,871	15,824,470.45 (1,821,871,282)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	26,523	1,283,182.74	
		GECINA SA	24,517	2,451,700.00	
		KLEPIERRE	129,417	3,292,368.48	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE	64,908	5,154,993.36	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	98,953	2,556,945.52	
ユーロ合計			344,318	14,739,190.10 (2,475,594,369)	
合計				99,085,654,413 (99,085,654,413)	

(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 591銘柄	97.91%	—	73.86%
	投資証券 33銘柄	—	2.09%	1.58%
カナダドル	株式 85銘柄	99.82%	—	3.25%
	投資証券 2銘柄	—	0.18%	0.01%
オーストラリアドル	株式 51銘柄	93.69%	—	1.87%
	投資証券 7銘柄	—	6.31%	0.13%
イギリスポンド	株式 81銘柄	99.25%	—	4.22%
	投資証券 2銘柄	—	0.75%	0.03%
スイスフラン	株式 45銘柄	100.00%	—	2.59%
香港ドル	株式 26銘柄	96.72%	—	0.52%
	投資証券 1銘柄	—	3.28%	0.02%
シンガポールドル	株式 15銘柄	89.60%	—	0.29%
	投資証券 4銘柄	—	10.40%	0.03%
ニュージーランドドル	株式 6銘柄	100.00%	—	0.05%
スウェーデンクローネ	株式 42銘柄	100.00%	—	0.86%
ノルウェークローネ	株式 11銘柄	100.00%	—	0.16%
デンマーククローネ	株式 15銘柄	100.00%	—	0.99%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.00%	—	0.10%
ユーロ	株式 217銘柄	99.51%	—	9.39%
	投資証券 5銘柄	—	0.49%	0.05%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

２【ファンドの現況】

【三菱ＵＦＪ ＤＣ海外株式インデックスファンド】

【純資産額計算書】

2024年 5月31日現在

（単位：円）

資産総額	240,984,570,728
負債総額	336,204,490
純資産総額（ - ）	240,648,366,238
発行済口数	44,883,325,380口
1口当たり純資産価額（ / ）	5.3616
（10,000口当たり）	（53,616）

（参考）

外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年 5月31日現在

（単位：円）

資産総額	5,613,640,677,725
負債総額	1,904,081,593
純資産総額（ - ）	5,611,736,596,132
発行済口数	788,876,742,479口
1口当たり純資産価額（ / ）	7.1136
（10,000口当たり）	（71,136）

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

（２）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

該当事項はありません。

（４）受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとし、

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（５）受益権の譲渡の対抗要件

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額等

2024年5月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近５年間における資本金の額の増減はありません。

（２）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

・投資運用の意思決定機構

投資環境見通しの策定

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

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。

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。

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。

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。

2024年 5月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本 数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	830	34,787,186
追加型公社債投資信託	16	1,569,411
単位型株式投資信託	95	418,728
単位型公社債投資信託	49	98,111
合 計	990	36,873,436

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アセットマネジメント株式会社（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39期事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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38期 (2023年3月31日現在)			第39期 (2024年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	51,733,041	2	58,206,340
有価証券		1,579,691		15,283
前払費用		770,747		679,199
未収入金		81,854		138,388
未収委託者報酬		16,753,855		21,064,747
未収収益	2	688,142	2	1,485,701
金銭の信託		10,400,000		10,500,500

その他		745,576		371,400
流動資産合計		82,752,908		92,461,561
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	181,551	1	2,936,036
器具備品	1	730,357	1	1,531,857
土地		628,433		628,433
建設仮勘定		1,111,177		45,140
有形固定資産合計		2,651,520		5,141,467
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		4,183,644		5,008,987
ソフトウェア仮勘定		1,907,739		1,587,548
無形固定資産合計		6,107,206		6,612,357
投資その他の資産				
投資有価証券		12,022,365		13,788,071
関係会社株式		159,536		159,536
投資不動産	1	807,066	1	1,788,120
長期差入保証金		689,492		689,867
前払年金費用		118,832		47,573
繰延税金資産		1,675,132		1,088,836
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		15,494,056		17,583,636
固定資産合計		24,252,782		29,337,461
資産合計		107,005,691		121,799,022

(単位：千円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	507,559	807,451
未払金		
未払収益分配金	114,094	105,550
未払償還金	7,418	43,553
未払手数料	2 6,139,595	2 7,523,485
その他未払金	2 955,697	2 885,002
未払費用	2 5,778,896	2 8,611,140
未払消費税等	439,657	623,219
未払法人税等	2,375,281	2,235,007
賞与引当金	849,840	1,182,242
役員賞与引当金	154,872	175,992
その他	5,517	12,303
流動負債合計	17,328,431	22,204,949
固定負債		
退職給付引当金	1,333,882	1,608,101
役員退職慰労引当金	75,667	30,105
時効後支払損引当金	254,296	250,350

資産除去債務	-	1,428,586
その他	-	29,109
固定負債合計	1,663,846	3,346,253
負債合計	18,992,277	25,551,202

(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	33,267,700	40,236,787
利益剰余金合計	40,608,289	47,577,377
株主資本合計	87,341,133	94,310,221

(単位：千円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024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	672,279	1,937,598
評価・換算差額等合計	672,279	1,937,598
純資産合計	88,013,413	96,247,820
負債純資産合計	107,005,691	121,799,022

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	84,121,445	98,635,342
投資顧問料	2,750,601	3,117,320
その他営業収益	10,412	148,442
営業収益合計	86,882,459	101,901,104
営業費用		
支払手数料	4 31,461,274	4 34,494,219
広告宣伝費	798,894	593,586
公告費	375	1,017
調査費		
調査費	2,849,042	3,537,103
委託調査費	19,236,505	27,296,058
事務委託費	1,751,807	1,861,577
営業雑経費		

通信費	113,480	137,737
印刷費	367,379	390,143
協会費	58,128	68,869
諸会費	18,447	20,108
事務機器関連費	2,238,382	2,531,009
その他営業雑経費	-	139,012
営業費用合計	58,893,717	71,070,444
一般管理費		
給料		
役員報酬	416,461	400,592
給料・手当	6,565,766	7,202,711
賞与引当金繰入	849,840	1,182,242
役員賞与引当金繰入	154,872	175,992
福利厚生費	1,279,885	1,424,215
交際費	8,942	10,054
旅費交通費	75,274	108,782
租税公課	403,955	397,138
不動産賃借料	719,707	728,550
退職給付費用	388,176	381,449
固定資産減価償却費	2,418,341	2,469,755
諸経費	444,313	490,104
一般管理費合計	13,725,534	14,971,590
営業利益	14,263,207	15,859,070

(単位：千円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	47,353	54,618
受取利息	4 10,279	4 12,836
投資有価証券償還益	609,102	204,527
収益分配金等時効完成分	94,351	17,722
受取賃貸料	4 65,808	4 162,111
その他	36,894	44,734
営業外収益合計	863,788	496,550
営業外費用		
投資有価証券償還損	32,995	234,700
時効後支払損引当金繰入	31,951	-
事務過誤費	2,680	10,822
賃貸関連費用	14,262	108,773
その他	32,394	25,903
営業外費用合計	114,284	380,199
経常利益	15,012,711	15,975,421
特別利益		
投資有価証券売却益	387,113	464,927
固定資産売却益	-	1 16,229
資産除去債務履行差額	-	87,050
特別利益合計	387,113	568,207

特別損失

投資有価証券売却損		15,828		57,011
投資有価証券評価損		104,554		31,651
固定資産除却損	3	32,791	3	20,246
固定資産売却損		-	2	65,427
減損損失	5	315,350		-
企業結合関連費用		-	6	1,187,136
特別損失合計		468,524		1,361,473
税引前当期純利益		14,931,300		15,182,154
法人税、住民税及び事業税	4	4,860,444	4	4,542,085
法人税等調整額		271,471		102,468
法人税等合計		4,588,973		4,644,553
当期純利益		10,342,327		10,537,601

(3) 【株主資本等変動計算書】

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

	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
当期首残高	1,626,775	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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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				
企業結合による増加				
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	33,267,700	40,608,289	87,341,133
当期変動額					
企業結合による増加			1,602,526	1,602,526	1,602,526
剰余金の配当			5,171,039	5,171,039	5,171,039
当期純利益			10,537,601	10,537,601	10,537,601
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)					
当期変動額合計	—	—	6,969,087	6,969,087	6,969,087
当期末残高	342,589	6,998,000	40,236,787	47,577,377	94,310,221

	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	672,279	672,279	88,013,413

当期変動額			
企業結合による増加			1,602,526
剰余金の配当			5,171,039
当期純利益			10,537,601
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	1,265,319	1,265,319	1,265,319
当期変動額合計	1,265,319	1,265,319	8,234,406
当期末残高	1,937,598	1,937,598	96,247,820

[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 3年～50年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5) 役員退職慰労引当金

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

(6) 時効後支払損引当金

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

6. 収益及び費用の計上基準

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

(1) 委託者報酬

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

(2) 投資顧問料

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

7. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

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。

(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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
建物	1,006,606千円	498,805千円
器具備品	1,985,072千円	1,643,689千円
投資不動産	163,978千円	211,090千円

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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
預金	40,165,058千円	39,776,992千円
未収収益	15,046千円	12,312千円
未払手数料	790,279千円	886,173千円
その他未払金	77,007千円	105,407千円
未払費用	277,358千円	599,493千円

(損益計算書関係)

1. 固定資産売却益の内訳

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
器具備品	-	16,229千円
計	-	16,229千円

2. 固定資産売却損の内訳

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
器具備品	-	65,427千円
計	-	65,427千円

3. 固定資産除却損の内訳

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
建物	1,047千円	15,825千円
器具備品	29,762千円	3,986千円
ソフトウェア	1,981千円	434千円
計	32,791千円	20,246千円

4. 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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
支払手数料	4,893,312千円	5,006,309千円
受取利息	10,236千円	12,747千円
受取賃貸料	68,168千円	152,876千円
法人税、住民税及び事業税	3,947,200千円	132,303千円

5. 減損損失

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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つのグループिंगとしております。

ホームページのリニューアルに伴い、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ため考慮していません。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

当事業年度については、該当事項はありません。

6. 企業結合関連費用

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

前事業年度については、該当事項はありません。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

企業結合に伴うものであり、主にシステム統合費用などであります。

（株主資本等変動計算書関係）

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。

配当金の総額	6,075,125千円
1株当たり配当額	28,713円
基準日	2022年3月31日
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において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	5,171,039千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	24,440円
基準日	2023年3月31日
効力発生日	2023年6月29日

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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

2023年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	5,171,039千円
1株当たり配当額	24,440円
基準日	2023年3月31日
効力発生日	2023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

2024年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

配当金の総額	45,747,620千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	216,218円
基準日	2024年3月31日
効力発生日	2024年6月27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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
1年内	962,809千円	681,212千円
1年超	1,532,728千円	851,515千円
合計	2,495,537千円	1,532,728千円

（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（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	-

第39期(2024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	15,283	15,283	-
(2) 金銭の信託	10,500,500	10,500,500	-
(3) 投資有価証券	13,788,071	13,788,071	-
資産計	24,303,855	24,303,855	-

(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39期(2024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	58,206,340	-	-	-
金銭の信託	10,500,500	-	-	-
未収委託者報酬	21,064,747	-	-	-
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	15,283	5,351,373	347,505	11,696
合計	89,786,871	5,351,373	347,505	11,696

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。

第39期(2024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	-	15,283	-	15,283
金銭の信託	-	10,500,500	-	10,500,500
投資有価証券	2,014,968	11,773,103	-	13,788,071

資産計	2,014,968	22,288,887	-	24,303,855
-----	-----------	------------	---	------------

（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38期（2023年3月31日現在）及び第39期（2024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。

第39期(2024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	17,364,277	14,269,984	3,094,293
	小計	17,364,277	14,269,984	3,094,293
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	6,939,577	7,241,136	301,559
	小計	6,939,577	7,241,136	301,559
合計		24,303,855	21,511,121	2,792,733

（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10,500,500千円、取得原価は10,500,000千円）を含めております。

3. 売却したその他有価証券

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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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	3,750,272	464,927	57,011
合計	3,750,272	464,927	57,011

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。

当事業年度において、有価証券について31,651千円（その他有価証券のその他31,651千円）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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,723,521 千円	3,582,778 千円
勤務費用	196,190	182,947
利息費用	25,925	39,626
数理計算上の差異の発生額	186,130	79,379
退職給付の支払額	176,727	300,286
過去勤務費用の発生額	-	-
企業結合による影響額	-	226,499
退職給付債務の期末残高	3,582,778	3,652,185

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
年金資産の期首残高	2,583,927 千円	2,425,752 千円
期待運用収益	46,453	43,626
数理計算上の差異の発生額	103,934	227,699
事業主からの拠出額	-	-
退職給付の支払額	100,694	204,536
年金資産の期末残高	2,425,752	2,492,542

(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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
積立型制度の 退職給付債務	2,468,195 千円	2,250,427 千円
年金資産	2,425,752	2,492,542
	42,442	242,114
非積立型制度の退職給付債務	1,114,583	1,401,758
未積立退職給付債務	1,157,025	1,159,643
未認識数理計算上の差異	281,343	558,841
未認識過去勤務費用	223,319	157,957
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,215,049	1,560,527
退職給付引当金	1,333,882	1,608,101
前払年金費用	118,832	47,573
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,215,049	1,560,527

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	196,190 千円	182,947 千円
利息費用	25,925	39,626
期待運用収益	46,453	43,626
数理計算上の差異の 費用処理額	6,532	29,581
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
退職給付制度の統合に係る 調整額	-	34,505
その他	1,600	2,196
確定給付制度に係る 退職給付費用	236,091	251,429

(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。「退職給付制度の統合に係る調整額」は企業結合関連費用の一部として特別損失に計上しております。

(5)年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
債券	63.6 %	62.0 %
株式	34.2	35.9
その他	2.2	2.1
合計	100	100

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
--	------------------------	------------------------

割引率	0.066～1.13%	1.39～1.41%
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152,084千円、当事業年度164,524千円であります。

（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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	499,742千円	389,750千円
投資有価証券評価損	47,876	30,021
未払事業税	169,997	126,161
賞与引当金	260,221	362,002
役員賞与引当金	29,828	33,564
役員退職慰労引当金	23,169	9,218
退職給付引当金	408,434	492,400
減価償却超過額	227,100	199,986
差入保証金	52,869	-
資産除去債務	-	16,900
時効後支払損引当金	77,865	76,657
その他	212,315	227,182
繰延税金資産 小計	2,009,420	1,963,847
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	2,009,420	1,963,847
繰延税金負債		
前払年金費用	36,386	14,567
その他有価証券評価差額金	296,702	855,135
その他	1,199	5,308
繰延税金負債 合計	334,288	875,010
繰延税金資産の純額	1,675,132	1,088,836

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38期（2023年3月31日現在）及び第39期（2024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、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。

（企業結合等関係）

当社は、2023年7月31日開催の取締役会において、三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社(旧商号：MU投資顧問株式会社)と吸収分割契約を締結することを決議し、同日、吸収分割の効力発生日を2023年10月1日とする吸収分割契約を締結いたしました。本吸収分割契約に基づき、当社と三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社は、2023年10月1日付で吸収分割を実施いたしました。

なお、2023年10月1日付で当社は「三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社」へ商号変更しました。

1. 取引の概要

(1) 被取得企業の名称及びその事業の内容

被取得企業の名称 三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社

事業の内容 投資顧問業、私募投資信託の設定・運用等

(2) 企業結合日

2023年10月1日

(3) 企業結合の法的形式

当社と兄弟会社である三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする無対価吸収分割

(4) 結合後企業の名称

分割会社：三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社

承継会社：三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

(5) 企業結合を行った主な理由

法人投資家の運用ニーズが拡大しており、両社で取り組みを強化している法人投資家ビジネスにかかる運用・営業等の関連機能を三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社に統合することで、リソースやノウハウの集約を通じた運用機能等の強化を図ってまいります。

2. 会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準（企業会計基準第21号2019年1月16日）」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針（企業会計基準適用指針第10号2019年1月16日）」に基づき、共通支配下の取引として処理いたしました。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

建物の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を取得から15年と見積り、割引率は1.1%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3. 当該資産除去債務の総額の増減

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
期首残高	-	-
有形固定資産の取得に伴う増加	-	1,420,750千円
時の経過による調整額	-	7,835千円
期末残高	-	1,428,586千円

（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38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）及び第39期（自 2023年4月1日 至 2024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38期（自2022年4月1日 至 2023年3月31日）及び第39期（自 2023年4月1日 至 2024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	㈱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1)	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㈱	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	投資助言料 (注3)	463,416 千円	未払費用	253,093 千円
						役員の兼任				

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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	㈱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%	グループ通算制 度	グループ通算 制度に伴う通 算税効果額 (注4)	132,303 千円	その他未払金	105,407 千円
親	三菱UFJ 信託銀行㈱	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,006,309 千円	未払手数料	886,173 千円

会社						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 （注3）	463,831 千円	未払費用	260,800 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。

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．グループ通算制度に基づく通算税効果額であります。

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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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)	4,354,007 千円	未払手数料	1,028,586 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㈱	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)	7,493,449 千円	未払手数料	1,449,414 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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	415,979.76円	454,898.22円
1株当たり当期純利益金額	48,881.17円	49,804.10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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益金額（千円）	10,342,327	10,537,601
普通株主に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	10,342,327	10,537,601
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。

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

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

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める

要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

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

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

5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（2023年9月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (2023年9月末現在)	事業の内容
株式会社三菱ＵＦＪ銀行	1,711,958 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社南都銀行	37,924 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社中国銀行	15,149 百万円	銀行業務を営んでいます。
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
株式会社京葉銀行	49,759 百万円	銀行業務を営んでいます。
損保ジャパンＤＣ証券株式会社	3,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

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

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

3【資本関係】

該当ありません。（2024年5月末現在）

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

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2023年 8月10日	有価証券届出書
2023年 8月10日	有価証券報告書
2024年 2月 9日	有価証券届出書の訂正届出書
2024年 2月 9日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2024年6月7日

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 山田 信之

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 田嶋 大士

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アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39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アセットマネジメント株式会社の2024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するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用し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

2024年7月17日

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

PwC Japan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 久保 直毅
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱ＵＦＪ ＤＣ海外株式インデックスファンドの2023年5月13日から2024年5月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱ＵＦＪ ＤＣ海外株式インデックスファンドの2024年5月13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アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（注）１．上記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。