

【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9月6日提出
【計算期間】	第9期(自 2023年12月9日至 2024年6月8日)
【ファンド名】	MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信
【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】	株式会社東京証券取引所 （東京都中央区日本橋兜町2番1号）

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、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券および日本株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてMSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（以下「対象指数」といいます。）に採用されている銘柄の株式等に投資を行い、信託財産の１口当たりの純資産額の変動率を、円換算した対象指数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。

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
	海外	債券	MRF	
追加型	内外	不動産投信	ETF	特殊型 ()
		その他資産 ()		
		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	ファミリー	あり	日経２２５	ブル・ベア型
一般	年２回	(日本を含む)	ファンド	()		
大型株	年４回	日本	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
中小型株	年６回	北米				
債券	(隔月)	欧州			その他	ロング・
一般	年１２回	アジア			(MSCI	ショート型／
公債	(毎月)	オセアニア			オール・カント	絶対収益
社債	日々	中南米			リー・ワール	追求型
その他債券	その他	アフリカ			ド・インデック	その他
クレジット	()	中近東			ス(円換算ベー	()
属性		(中東)			ス))	
()		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。

有価証券報告書（内国投資信託）

	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。
投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

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

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

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

円換算した対象指数(MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス)に連動する投資成果をめざします。

ファンドの特色

投資方針

円換算したMSCI オール・カントリー・ワールド・インデックスに連動する投資成果をめざして運用を行います。

- ファンドの1口当たりの純資産額の変動率を、円換算したMSCI オール・カントリー・ワールド・インデックスの変動率に一致させることを目的として、主として対象指数に採用されている銘柄の株式等(DR(預託証券)を含みます。)に投資を行います。
- 円換算した対象指数との連動を維持するため、先物取引等を利用し株式等の実質投資比率が100%を超える場合があります。

【 DR(預託証券)とは、Depositary Receiptの略で、ある国の企業の株式を当該国外の市場で流通させるため、現地法に従い発行した代替証券です。株式と同様に金融商品取引所等で取引されます。

※実際の運用は外国株式インデックスマザーファンド、新興国株式インデックスマザーファンド、日本株式インデックスマザーファンドを通じて行います。

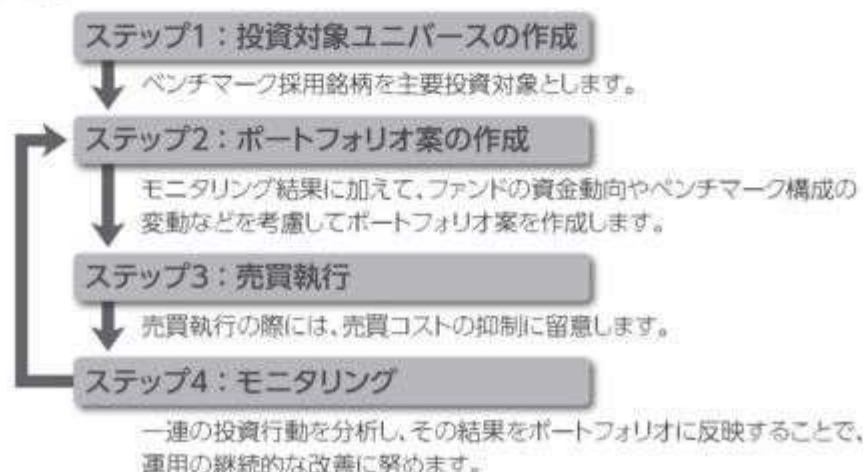
<MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックスについて>

MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の先進国・新興国の株式で構成されています。

MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(円換算ベース)は、MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(米ドルベース)をもとに、委託会社が計算[※]したものです。

※原則として、わが国における計算日の午前10時の対顧客電信売買相場の仲値により円換算

<運用プロセスのイメージ>



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

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

為替対応
方針

原則として、為替ヘッジを行いません。

- 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、新興国株式インデックスマザーファンド、日本株式インデックスマザーファンドへの投資を通じて、日本を含む先進国および新興国の株式等に投資を行うファミリーファンド方式により行います。



- ・外国株式インデックスマザーファンドは、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざします。
- ・新興国株式インデックスマザーファンドは、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざします。
- ・日本株式インデックスマザーファンドは、MSCI ジャパン・インデックス（配当込み）に連動する投資成果をめざします。

■上場投信の仕組み

ファンドの受益権は、下記の金融商品取引所で上場され、株式と同様に、市場価格で売買することができます。

金融商品取引所における売買単位は1口単位です。

取引方法は、原則として株式と同様です。売買手数料等につきましては、お取引される第一種金融商品取引業者にお問い合わせください。

<金融商品取引所>

- ・東京証券取引所（2020年1月9日に新規上場）

■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。
- ・外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
- ・デリバティブ取引は、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。

 分配方針

年2回の決算時に分配を行います。

- 年2回の決算時(6・12月の各8日)に分配を行います。
- 分配金額は、経費等控除後の配当等収益の全額を原則とします。
- 分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

●「MAXIS(マクシス)」の由来

「MAXIS(マクシス)」は三菱UFJアセットマネジメントが運用するETF(上場投資信託)シリーズの統一ブランドです。このブランドには、「最高(MAX)の品質」と「お客さまの投資の中心軸(Axis)」をめざすという三菱UFJアセットマネジメントの思いが込められています。

「MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス」の著作権等について

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

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

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2020年1月8日	設定日、信託契約締結、運用開始
2020年1月9日	ファンドの受益権を東京証券取引所に上場

(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

投資家（受益者）	
お申込金 ↓ ↑ 解約代金等	
販売会社	募集の取扱い、解約の取扱い等を行います。
お申込金 ↓ ↑ 解約代金等	
受託会社（受託者） 三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）	委託会社（委託者） 三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社
信託財産の保管・管理等を行います。	信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。
投資 ↓ ↑ 損益	
マザーファンド	
投資 ↓ ↑ 損益	
有価証券等	

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 「上場投資信託の取扱い等に関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い等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6月末現在）

- 金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- 設立年月日
1985年8月1日
- 資本金
2,000百万円
- 沿革

1997年5月	東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
2004年10月	東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
2005年10月	三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ投信株式会社に変更
2015年7月	三菱ＵＦＪ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社に変更
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、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券および日本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、株式等（ＤＲ（預託証券）を含みます。以下同じ。）に直接投資することがあります。

外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券および日本株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてMSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス（以下「対象指数」といいます。）に採用されている銘柄の株式等に投資を行い、信託財産の１口当たりの純資産額の変動率を、円換算した対象指数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。

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

円換算した対象指数との連動を維持するため、先物取引等を利用し株式等の実質投資比率が100%を超える場合があります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

- ａ．有価証券先物取引等
- ｂ．スワップ取引
- ｃ．金利先渡取引および為替先渡取引

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

- ２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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、新興国株式インデックスマザーファンドおよび日本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す。）
19. 預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定めるものをいいます。）
22. 外国の者に対する権利で21．の有価証券の性質を有するもの
23. 抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます。）

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

金融商品の指図範囲

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

- １．預金
- ２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）
- ３．コール・ローン
- ４．手形割引市場において売買される手形
- ５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
- ６．外国の者に対する権利で５．の権利の性質を有するもの
- ７．信託の受益権（金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるものをいい、１．から６．に該当するものを除きます。）
- ８．外国の者に対する権利で７．の権利の性質を有するもの
- ９．合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第２条第２項第３号で定めるものをいいます。）
- 10．外国法人の社員権で９．の権利の性質を有するもの
- 11．投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利（金融商品取引法第２条第２項第５号で定めるものをいいます。）
- 12．外国の法令に基づく権利であって、11．の権利に類するもの

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

<マザーファンドの概要>

外国株式インデックスマザーファンド

（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。

新興国株式インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）と連動した投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）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新興国の株式等に投資を行い、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。

株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（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。

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。

金利先渡取引および為替先渡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。

日本株式インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、MSCI ジャパン・インデックス（配当込み）に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

わが国の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。

株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（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（上場投資信託証券を除きます。）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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

有価証券先物取引等を行うことができます。

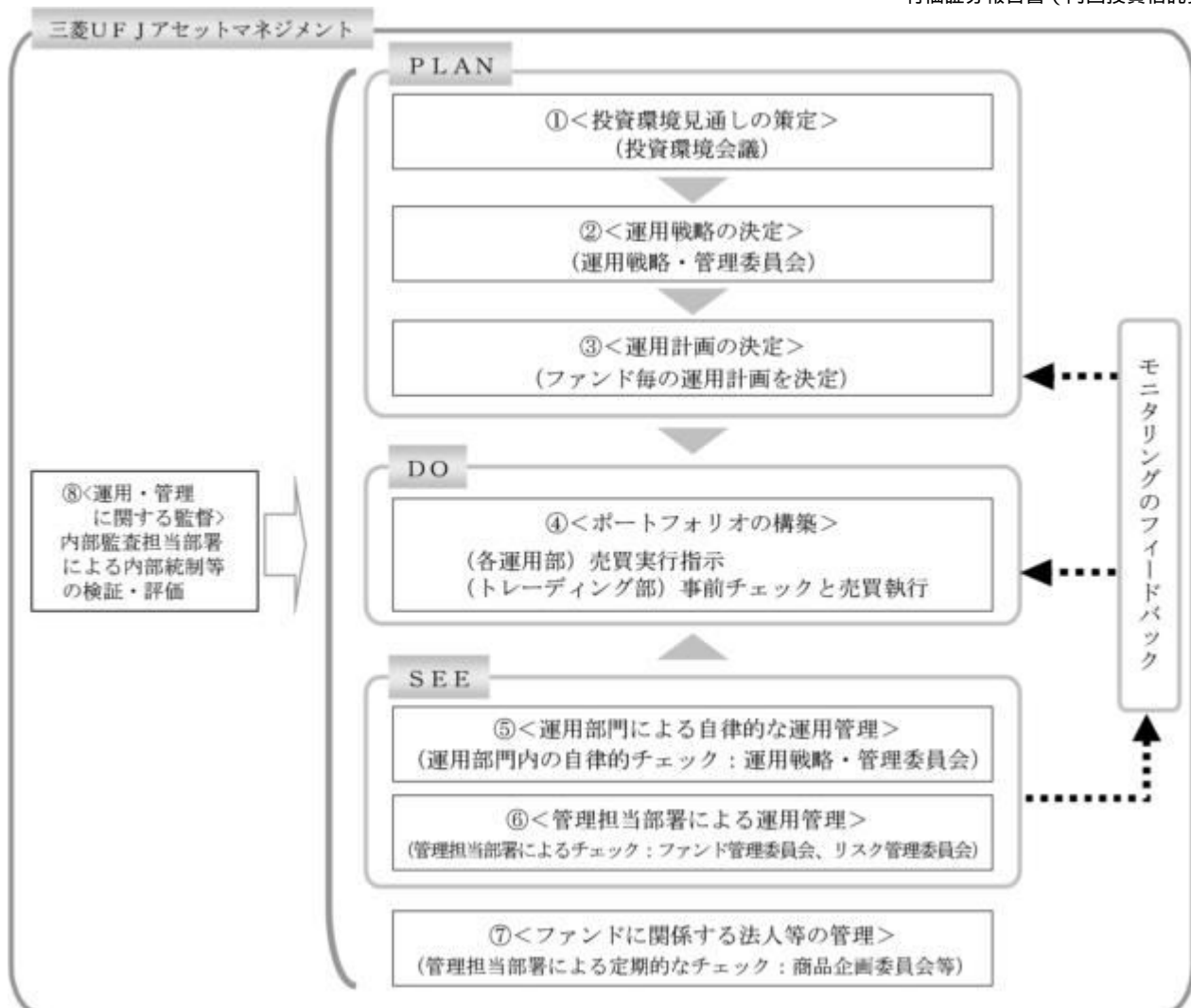
スワップ取引を行うことができます。

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。

ファンドに關係する法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に關係する法人については、その業務に關係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.mufig.jp/investment_policy/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。

経費等控除後の配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。）の全額を分配することを原則とします。ただし、当該金額が少額の場合等には分配を行わないことがあります。

売買益（評価益を含みます。）からの分配は行いません。

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

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、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の権利行使により取得する株券
 - 2．株式分割により取得する株券
 - 3．有償増資により取得する株券
 - 4．売出しにより取得する株券
 - 5．信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（ 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券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（ 5．に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

外国為替予約取引

- a．委託会社は、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。）について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、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．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。

有価証券の借入れ

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

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、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。

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。

金利先渡取引および為替先渡取引

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

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。

有価証券の空売り

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

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、ファンドはその影響を受け組入株式の価格の下落は基準価額の下落要因となります。
為替変動 リスク	組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。
信用リスク	組入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は、当該組入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・償還金の支払いが滞ることがあります。
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場合または取引が不可能となる場合、市場実勢から期待される価格より不利な価格での取引となる可能性があります。
カントリー・ リスク	新興国への投資は、先進国への投資を行う場合に比べ、投資対象国におけるクーデターや重大な政治体制の変更、資産凍結を含む重大な規制の導入、政府のデフォルト等の発生による影響を受けることにより、価格変動・為替変動・信用・流動性の各リスクが大きくなる可能性があります。

留意事項

- ・ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・有価証券の貸付等においては、取引先の倒産等による決済不履行リスクを伴い、ファンドが損失を被る可能性があります。
- ・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。
- ・ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・ファンドは、換金時期に制限がありますのでご注意ください。

- ・ ファンドは、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（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が、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、株価指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因により乖離を生じることがあります。
- ・ ファンドは金融商品取引所に上場され取引が行われますが、金融商品取引所における市場価格はファンドの需給などによって決まり、時間とともに変化します。このため、ファンドの市場価格は基準価額に必ずしも一致せず、またその差異の程度については予測できません。
- ・ コンピューター関係の不慮の出来事に起因する取引上のリスクやシステム上のリスクが生じる可能性があります。

（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

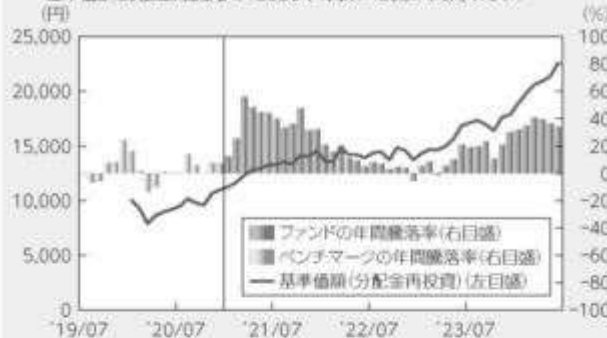
下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

ファンドの年間騰落率は、2021年1月～2024年6月です。

ベンチマークの年間騰落率は、2019年7月～2020年12月です。

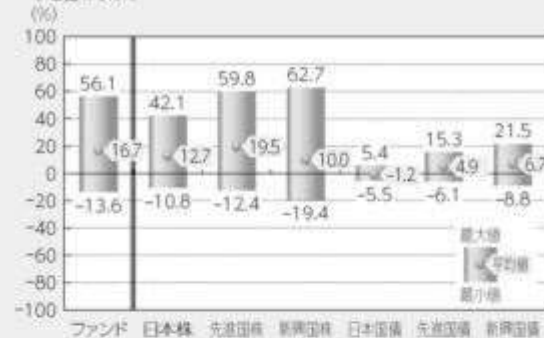
基準価額(分配金再投資)は、2020年1月末～2024年6月末です。



● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2019年7月末～2024年6月末)

ファンドの年間騰落率はベンチマーク(2020年12月以前)の年間騰落率を含みます。



(注) 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標準又は商標は、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】

販売会社が定める額

申込手数料は販売会社にご確認ください。

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】

解約時に信託財産留保額（当該基準価額の0.1％）が差し引かれます。

また、販売会社は、受益者が解約請求を行うときは、当該受益者から販売会社が定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を徴収することができるものとします。

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

（３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、以下の通りです。

- ・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0.0858％（税抜 年0.078％）以内の率を乗じて得た額となります。

1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。

- ・信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

支払先	委託会社	受託会社
配分（税抜）	0.058％	0.020％

上記各支払先への配分には、別途消費税等相当額がかかります。

（有価証券の貸付の指図を行った場合）

有価証券の貸付の指図を行った場合には品貸料がファンドの収益として計上されます。

その収益の一部を委託会社と受託会社が受け取ります。

この場合、ファンドの品貸料およびマザーファンドの品貸料のうちファンドに属するとみなした額の55％（税抜 50％）以内の額が上記の信託報酬に追加されます。

委託会社と受託会社が受け取る品貸料の配分は1：1の割合となります。

上記各支払先への配分には、別途消費税等相当額がかかります。

- ・信託報酬は日々ファンドの基準価額に反映され、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。

各支払先が信託報酬の対価として提供する役務の内容は以下の通りです。

支払先	対価として提供する役務の内容
委託会社	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等
受託会社	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

（４）【その他の手数料等】

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

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

- ・受益権の上場に係る費用（追加上場料（追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額）に対して0.00825%（税抜 0.0075%））、年間上場料（毎年末の純資産総額に対して最大0.00825%（税抜 0.0075%）））は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。
- ・対象指数についての商標（これに類する商標を含みます。）の使用料（信託財産の純資産総額に年0.055%（税抜 年0.05%）（上限）を乗じて得た額）は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。

（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。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、上場証券投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

１．受益権の売却時

売却価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得として課税されます。

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。

２．収益分配金の受取り時

収益分配金は配当所得として課税されます。

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。

３．受益権の解約時および償還時

上記１．と同様の取扱いとなります。

売却時、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、）との損益通算が可能となる仕組みがあります。

上場証券投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に「NISA（少額投資非課税制度）」の適用対象となります。ファンドはNISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象です。販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

NISAをご利用の場合、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託やETFなどから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し（ETFの配当金の受取方法については、非課税口座を開設する金融機関等経由で受領する「株式数比例配分方式」を選択する必要があります。）、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

１．受益権の売却時

通常の株式の売却時と同様に、譲渡益について、他の法人所得と合算して課税されます。

２．収益分配金の受取り時

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。

３．受益権の解約時および償還時

源泉徴収はありません。上記１．と同様の取扱いとなります。

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。

上記は2024年6月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

５【運用状況】

【MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信】

（１）【投資状況】

2024年 6月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	55,581,386,728	99.50
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	276,841,520	0.50
純資産総額		55,858,228,248	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 6月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	6,236,861,358	7.2236	45,052,596,046	7.5476	47,073,334,785	84.27
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックスマザーファンド	1,367,467,458	3.9795	5,441,836,750	4.1569	5,684,425,476	10.18
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスマザーファンド	1,395,830,969	1.9822	2,766,816,147	2.0229	2,823,626,467	5.05

（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 6月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.50
合計	99.50

（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6月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額		基準価額 （1口当たりの純資産価額）		東京証券取引所 取引価格
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）	
第1計算期間末日（2020年 6月 8日）	2,863,735,287	2,875,318,287	9,642	9,681	9,630
第2計算期間末日（2020年12月 8日）	3,332,170,757	3,352,010,757	10,749	10,813	10,790
第3計算期間末日（2021年 6月 8日）	7,443,027,007	7,486,527,007	12,833	12,908	12,900
第4計算期間末日（2021年12月 8日）	10,927,266,575	10,991,126,975	13,860	13,941	14,090
第5計算期間末日（2022年 6月 8日）	15,842,380,162	15,965,789,962	14,249	14,360	14,325
第6計算期間末日（2022年12月 8日）	18,649,825,572	18,799,864,272	13,797	13,908	14,035
第7計算期間末日（2023年 6月 8日）	24,015,021,688	24,248,817,288	15,202	15,350	15,260
第8計算期間末日（2023年12月 8日）	32,165,521,726	32,413,577,926	16,338	16,464	16,500
第9計算期間末日（2024年 6月 8日）	53,165,081,053	53,578,029,853	20,342	20,500	20,385
2023年 6月末日	26,419,069,088	—	16,073	—	16,145
7月末日	28,052,802,814	—	16,341	—	16,500
8月末日	29,483,693,772	—	16,548	—	16,550
9月末日	29,459,920,249	—	16,181	—	16,330
10月末日	30,740,443,256	—	15,654	—	15,735
11月末日	33,093,471,312	—	16,810	—	16,895
12月末日	34,216,922,086	—	16,929	—	17,120
2024年 1月末日	38,575,632,389	—	17,866	—	17,860
2月末日	42,734,805,456	—	18,751	—	18,715
3月末日	45,688,918,780	—	19,504	—	19,565
4月末日	48,742,200,178	—	19,803	—	19,760
5月末日	51,739,811,495	—	20,222	—	20,285
6月末日	55,858,228,248	—	21,222	—	21,280

【分配の推移】

	1口当たりの分配金
第1計算期間	39円00銭
第2計算期間	64円00銭
第3計算期間	75円00銭
第4計算期間	81円00銭
第5計算期間	111円00銭
第6計算期間	111円00銭
第7計算期間	148円00銭
第8計算期間	126円00銭
第9計算期間	158円00銭

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	3.19
第2計算期間	12.14
第3計算期間	20.08
第4計算期間	8.63
第5計算期間	3.60
第6計算期間	2.39
第7計算期間	11.25
第8計算期間	8.30
第9計算期間	25.47

（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1計算期間	297,000	—	297,000
第2計算期間	123,000	110,000	310,000
第3計算期間	270,000	—	580,000
第4計算期間	291,400	83,000	788,400
第5計算期間	393,400	70,000	1,111,800
第6計算期間	264,900	25,000	1,351,700
第7計算期間	344,000	116,000	1,579,700
第8計算期間	417,000	28,000	1,968,700
第9計算期間	662,900	18,000	2,613,600

（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 6月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	アメリカ	4,511,757,966,531	73.42
	イギリス	234,362,393,789	3.81
	カナダ	184,979,815,526	3.01
	フランス	164,134,354,333	2.67
	スイス	155,629,600,403	2.53
	ドイツ	135,856,101,618	2.21
	オーストラリア	110,820,935,904	1.80
	オランダ	105,442,729,661	1.72
	デンマーク	62,938,306,321	1.02
	スウェーデン	50,816,212,884	0.83
	スペイン	40,698,450,046	0.66

	イタリア	32,245,471,692	0.52
	香港	26,081,505,939	0.42
	シンガポール	17,116,587,707	0.28
	フィンランド	15,789,096,046	0.26
	ベルギー	12,498,817,172	0.20
	ノルウェー	9,413,394,719	0.15
	アイルランド	5,528,987,967	0.09
	イスラエル	5,397,097,913	0.09
	オーストリア	2,974,487,168	0.05
	ルクセンブルク	2,871,249,708	0.05
	ニュージーランド	2,713,864,789	0.04
	ポルトガル	2,541,808,656	0.04
	バミューダ	851,256,100	0.01
	小計	5,893,460,492,592	95.91
投資証券	アメリカ	93,976,576,262	1.53
	オーストラリア	7,396,934,733	0.12
	フランス	1,966,178,386	0.03
	イギリス	1,763,701,262	0.03
	シンガポール	1,358,531,152	0.02
	香港	995,933,880	0.02
	ベルギー	432,453,188	0.01
	カナダ	302,575,605	0.00
	小計	108,192,884,468	1.76
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	143,417,864,022	2.33
純資産総額		6,145,071,241,082	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 6月28日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	109,919,853,771	1.79
	買建	カナダ	4,883,352,199	0.08
	買建	ドイツ	15,674,785,246	0.26
	買建	オーストラリア	3,959,157,825	0.06
	買建	イギリス	5,870,845,656	0.10
	買建	スイス	3,756,430,180	0.06

（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 6月28日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア・ サービス	4,201,504	66,881.71	281,003,800,661	72,940.54	306,460,010,486	4.99
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	8,728,915	29,615.40	258,510,373,041	34,485.08	301,017,393,191	4.90
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	14,876,050	14,731.04	219,139,769,367	19,971.06	297,090,625,460	4.83
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	5,571,070	30,134.22	167,879,901,161	31,867.69	177,537,184,653	2.89
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディ ア・娯楽	1,303,990	76,779.56	100,119,784,703	83,685.52	109,125,093,222	1.78
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディ ア・娯楽	3,507,171	27,200.56	95,397,020,966	29,863.98	104,738,115,113	1.70
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディ ア・娯楽	3,036,997	27,461.29	83,399,876,808	30,097.54	91,406,139,295	1.49
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	480,913	123,061.81	59,182,025,501	146,419.07	70,414,835,557	1.15
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・ 半導体製 造装置	262,023	215,615.24	56,496,152,492	255,563.32	66,963,469,421	1.09
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1,708,697	32,005.54	54,687,786,594	32,080.31	54,815,532,703	0.89
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・ 自動車部 品	1,706,316	27,210.24	46,429,272,602	31,798.43	54,258,185,923	0.88
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サー ビス	780,398	66,347.81	51,777,700,837	65,708.50	51,278,787,056	0.83
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネル ギー	2,669,118	18,959.96	50,606,382,323	18,506.94	49,397,214,686	0.80
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	1,943,076	20,476.56	39,787,521,833	23,160.06	45,001,756,745	0.73
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケ ア機器・ サービス	548,652	82,517.90	45,273,614,265	78,350.89	42,987,372,939	0.70
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サー ビス	940,343	45,156.40	42,462,511,616	42,939.65	40,378,000,522	0.66
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・ 半導体製 造装置	237,870	149,298.85	35,513,718,523	165,436.80	39,352,451,616	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用 品・パー ソナル用 品	1,399,438	26,870.28	37,603,302,054	26,837.48	37,557,394,094	0.61
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需 品流通・ 小売り	264,499	127,118.42	33,622,695,367	137,009.36	36,238,839,610	0.59
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サー ビス	495,140	73,530.62	36,407,954,462	71,313.74	35,310,286,461	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	1,432,762	24,122.53	34,561,850,055	23,484.00	33,646,991,405	0.55

アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	590,039	55,745.59	32,892,072,267	55,003.79	32,454,383,785	0.53
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	1,506,810	20,935.91	31,546,445,655	20,910.10	31,507,558,931	0.51
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	2,634,480	9,783.53	25,774,524,640	10,933.43	28,803,906,882	0.47
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,054,544	25,913.05	27,326,458,196	27,219.21	28,703,864,397	0.47
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	257,760	98,562.82	25,405,552,487	110,226.64	28,412,019,706	0.46
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	4,228,403	6,200.14	26,216,727,179	6,321.99	26,731,953,195	0.44
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	1,044,372	26,656.12	27,838,911,493	25,178.46	26,295,681,134	0.43
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	1,591,107	17,050.46	27,129,107,899	16,499.50	26,252,485,539	0.43
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	2,445,044	10,191.34	24,918,296,489	10,293.98	25,169,243,082	0.41

（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 6月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	エネルギー	4.33
	素材	3.53
	資本財	6.62
	商業・専門サービス	1.52
	運輸	1.54
	自動車・自動車部品	1.53
	耐久消費財・アパレル	1.31
	消費者サービス	1.84
	メディア・娯楽	6.69
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.87
	生活必需品流通・小売り	1.71
	食品・飲料・タバコ	3.01
	家庭用品・パーソナル用品	1.54
	ヘルスケア機器・サービス	3.92
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.78
	銀行	5.26
	金融サービス	6.26
	保険	2.88
	ソフトウェア・サービス	9.93

	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.40
	電気通信サービス	1.07
	公益事業	2.47
	半導体・半導体製造装置	9.63
	不動産管理・開発	0.26
	小計	95.91
投資証券	—	1.76
合計		97.67

（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 6月28日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2409	買建	2,461	アメリカドル	682,158,868.1	109,875,328,885	682,435,300	109,919,853,771	1.79
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602409	買建	158	カナダドル	41,017,154.5	4,816,234,281	41,588,760	4,883,352,199	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 2409	買建	1,842	ユーロ	91,210,055.9	15,718,228,932	90,957,960	15,674,785,246	0.26
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2409	買建	191	オーストラリアドル	37,002,000.25	3,959,214,027	37,001,475	3,959,157,825	0.06
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2409	買建	351	イギリスポンド	28,940,893.75	5,888,893,060	28,852,200	5,870,845,656	0.10
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX2409	買建	174	スイスフラン	21,028,561.9	3,765,584,579	20,977,440	3,756,430,180	0.06

（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。

新興国株式インデックスマザーファンド

投資状況

2024年 6月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	インド	169,985,466,012	18.82
	台湾	169,487,172,581	18.76
	香港	168,122,838,129	18.61
	韓国	106,439,422,837	11.78
	ブラジル	37,888,401,340	4.19
	中国	34,523,740,421	3.82
	サウジアラビア	34,476,310,280	3.82
	南アフリカ	25,355,575,933	2.81

	アメリカ	22,458,539,047	2.49
	メキシコ	17,622,028,317	1.95
	インドネシア	13,749,358,500	1.52
	タイ	11,899,081,768	1.32
	マレーシア	11,880,889,436	1.32
	アラブ首長国連邦	9,432,988,395	1.04
	ポーランド	8,235,337,745	0.91
	カタール	6,969,844,969	0.77
	トルコ	6,886,152,980	0.76
	クウェート	6,468,994,548	0.72
	フィリピン	4,522,151,614	0.50
	ギリシャ	4,264,874,037	0.47
	チリ	3,855,302,019	0.43
	ハンガリー	2,151,144,439	0.24
	チェコ	1,204,693,142	0.13
	コロンビア	930,152,441	0.10
小計		878,810,460,930	97.28
投資証券	メキシコ	811,478,276	0.09
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	23,738,748,486	2.63
純資産総額		903,360,687,692	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 6月28日現在
（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	24,922,230,633	2.76

（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 6月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (％)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	17,868,000	3,982.72	71,163,418,675	4,746.81	84,816,108,288	9.39
香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	4,793,200	7,665.58	36,742,684,903	7,723.87	37,022,063,270	4.10
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3,468,031	9,208.07	31,933,877,966	9,498.23	32,940,190,765	3.65
香港	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	11,291,200	1,608.50	18,161,954,694	1,476.07	16,666,674,977	1.84

インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	2,196,685	5,467.39	12,010,136,336	5,938.53	13,045,088,560	1.44
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	396,743	21,079.04	8,362,963,248	27,528.60	10,921,779,350	1.21
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	9,016,272	840.61	7,579,248,351	1,050.72	9,473,644,938	1.05
アメリカ	株式	PDD HOLDINGS INC	一般消費財・サービス流通・小売り	432,799	22,008.07	9,525,074,517	21,251.57	9,197,660,755	1.02
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	3,730,869	2,167.92	8,088,261,027	2,366.60	8,829,496,961	0.98
香港	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	3,672,720	2,446.15	8,984,037,114	2,345.63	8,614,845,886	0.95
香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	69,990,550	116.23	8,135,595,556	118.00	8,259,136,866	0.91
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	1,101,236	5,442.17	5,993,113,669	6,897.71	7,596,014,278	0.84
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	2,406,154	2,768.03	6,660,307,107	3,052.29	7,344,301,448	0.81
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	2,026,133	2,797.04	5,667,188,757	3,290.53	6,667,053,447	0.74
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	653,217	7,543.63	4,927,631,923	7,632.25	4,985,516,101	0.55
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	1,400,532	3,401.00	4,763,222,079	3,506.12	4,910,447,261	0.54
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	1,616,982	2,525.09	4,083,039,626	2,863.05	4,629,503,549	0.51
香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	58,617,000	77.16	4,523,003,794	78.39	4,595,221,098	0.51
ブラジル	株式	VALE SA	素材	2,476,229	1,875.52	4,644,231,576	1,801.32	4,460,494,759	0.49
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	594,381	7,527.10	4,473,967,989	7,426.32	4,414,063,508	0.49
香港	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	1,417,195	3,149.97	4,464,132,418	3,100.68	4,394,280,947	0.49
香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	46,199,350	93.35	4,313,054,526	94.27	4,355,633,139	0.48
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	1,632,942	2,177.68	3,556,030,445	2,500.56	4,083,274,346	0.45
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	128,243	32,885.03	4,217,275,979	31,020.52	3,978,165,572	0.44
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	39,556,500	92.78	3,670,142,701	96.52	3,818,191,162	0.42
香港	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	10,998,800	400.92	4,409,731,044	341.22	3,753,012,736	0.42
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	3,381,000	1,215.53	4,109,729,045	1,103.44	3,730,742,889	0.41
インド	株式	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	自動車・自動車部品	659,935	4,254.51	2,807,704,676	5,604.56	3,698,647,283	0.41
香港	株式	JD.COM INC-CLASS A	一般消費財・サービス流通・小売り	1,680,483	2,614.86	4,394,241,760	2,176.46	3,657,512,433	0.40
香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	4,777,000	850.98	4,065,167,287	741.64	3,542,854,884	0.39

（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 6月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
----	----	---------

株式	エネルギー	5.02
	素材	6.69
	資本財	4.76
	商業・専門サービス	0.04
	運輸	1.96
	自動車・自動車部品	3.97
	耐久消費財・アパレル	1.10
	消費者サービス	2.32
	メディア・娯楽	6.08
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.69
	生活必需品流通・小売り	1.24
	食品・飲料・タバコ	3.05
	家庭用品・パーソナル用品	0.74
	ヘルスケア機器・サービス	0.89
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.25
	銀行	16.16
	金融サービス	2.63
	保険	2.57
	ソフトウェア・サービス	2.31
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	9.05
	電気通信サービス	2.56
	公益事業	2.90
	半導体・半導体製造装置	12.96
	不動産管理・開発	1.36
小計		97.28
投資証券	—	0.09
合計		97.37

（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 6月28日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	ニューヨーク証券取引所	MINI MS 2409	買建	2,849	アメリカドル	155,281,652.9	25,011,215,832	154,729,190	24,922,230,633	2.76

（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。

日本株式インデックスマザーファンド

投資状況

2024年 6月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	日本	198,253,507,660	98.41
投資証券	日本	874,240,000	0.43
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	2,332,323,198	1.16
純資産総額		201,460,070,858	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 6月28日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	2,332,715,000	1.16

（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 6月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (％)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3,492,000	3,480.02	12,152,230,201	3,290.00	11,488,680,000	5.70
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	3,656,400	1,556.72	5,692,026,068	1,729.00	6,321,915,600	3.14
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	411,200	12,758.54	5,246,312,840	13,640.00	5,608,768,000	2.78
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,526,500	2,699.80	4,121,249,660	3,601.00	5,496,926,500	2.73
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	155,300	33,749.63	5,241,317,813	34,900.00	5,419,970,000	2.69
日本	株式	キーエンス	電気機器	64,100	65,204.13	4,179,584,890	70,550.00	4,522,255,000	2.24
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	412,100	8,886.21	3,662,007,736	10,725.00	4,419,772,500	2.19
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	488,900	6,677.06	3,264,417,148	8,607.00	4,207,962,300	2.09
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	618,800	4,882.80	3,021,478,908	6,005.00	3,715,894,000	1.84
日本	株式	信越化学工業	化学	593,200	6,266.12	3,717,065,294	6,238.00	3,700,381,600	1.84
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	338,800	7,744.95	2,623,992,102	10,390.00	3,520,132,000	1.75
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,100,900	3,475.76	3,826,465,922	3,148.00	3,465,633,200	1.72
日本	株式	第一三共	医薬品	609,100	4,839.88	2,947,972,198	5,524.00	3,364,668,400	1.67
日本	株式	三井物産	卸売業	847,300	3,711.02	3,144,347,724	3,651.00	3,093,492,300	1.54
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	391,400	6,949.74	2,720,128,864	7,854.00	3,074,055,600	1.53
日本	株式	任天堂	その他製品	342,100	7,509.34	2,568,946,372	8,556.00	2,927,007,600	1.45
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	794,300	3,009.67	2,390,587,317	3,358.00	2,667,259,400	1.32
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,477,900	1,743.06	2,576,081,775	1,720.00	2,541,988,000	1.26
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	57,600	41,429.81	2,386,357,602	40,560.00	2,336,256,000	1.16
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	521,100	4,093.45	2,133,097,569	4,172.00	2,174,029,200	1.08

日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	115,600	18,329.63	2,118,906,097	18,705.00	2,162,298,000	1.07
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	492,900	4,341.76	2,140,056,025	4,254.00	2,096,796,600	1.04
日本	株式	ダイキン工業	機械	86,900	20,678.53	1,796,964,800	22,370.00	1,943,953,000	0.96
日本	株式	村田製作所	電気機器	567,500	2,842.84	1,613,315,344	3,322.00	1,885,235,000	0.94
日本	株式	ディスコ	機械	30,300	48,255.11	1,462,129,901	61,040.00	1,849,512,000	0.92
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	939,700	1,856.80	1,744,836,240	1,964.50	1,846,040,650	0.92
日本	株式	三菱重工業	機械	1,055,400	1,334.46	1,408,392,566	1,723.00	1,818,454,200	0.90
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	395,100	4,186.94	1,654,263,587	4,348.00	1,717,894,800	0.85
日本	株式	三菱電機	電気機器	636,300	2,427.45	1,544,589,192	2,567.50	1,633,700,250	0.81
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	252,300	5,347.76	1,349,241,017	6,425.00	1,621,027,500	0.80

（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 6月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	鉱業	0.37
	建設業	1.28
	食料品	2.72
	繊維製品	0.17
	化学	5.03
	医薬品	5.10
	石油・石炭製品	0.54
	ゴム製品	0.59
	ガラス・土石製品	0.25
	鉄鋼	0.69
	非鉄金属	0.49
	金属製品	0.13
	機械	5.05
	電気機器	20.95
	輸送用機器	10.08
	精密機器	2.30
	その他製品	2.37
	電気・ガス業	1.14
	陸運業	1.80
	海運業	0.77
	空運業	0.14
	情報・通信業	6.58
	卸売業	6.57
	小売業	3.18
	銀行業	8.17
	証券、商品先物取引業	0.90
	保険業	4.06
	その他金融業	1.11
	不動産業	1.65

	サービス業	4.21
	小計	98.41
投資証券	—	0.43
合計		98.84

（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 6月28日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ ２４年０９月限	買建	83	円	2,285,780,650	2,332,715,000	1.16

（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。

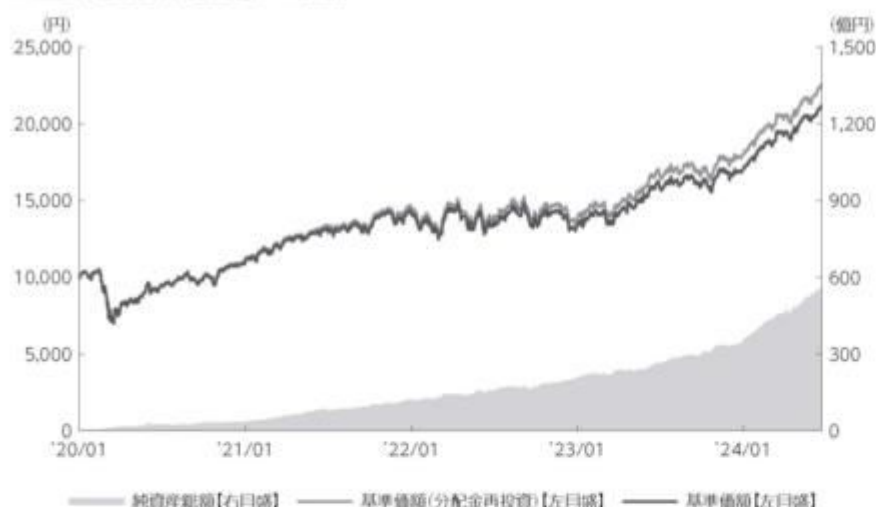
参考情報



運用実績

2024年6月28日現在

■基準価額・純資産の推移 2020年1月8日(設定日)～2024年6月28日



- 基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,000(当初元本1口当たり)を起点として表示
- 基準価額、基準価額(分配金再投資)は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	21,222円
純資産総額	558.5億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024年 6月	158円
2023年 12月	126円
2023年 6月	148円
2022年 12月	111円
2022年 6月	111円
2021年 12月	81円
設定来累計	913円

●分配金は1口当たり、税引前

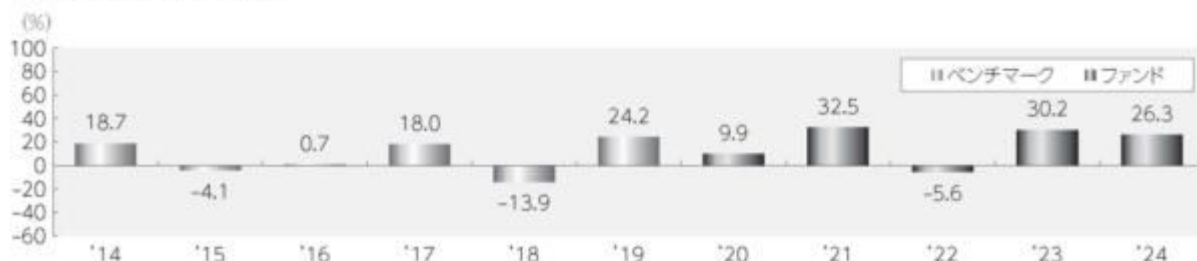
■主要な資産の状況

組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
1 アメリカドル	65.1%	1 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	4.2%
2 ユーロ	7.4%	2 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	4.1%
3 円	5.5%	3 NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	アメリカ	4.1%
4 イギリスポンド	3.3%	4 AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	アメリカ	2.4%
5 カナダドル	2.6%	5 META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	アメリカ	1.5%
6 香港ドル	2.3%	6 ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	アメリカ	1.4%
7 スイスフラン	2.2%	7 ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	アメリカ	1.3%
8 インドルピー	1.9%	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 ニュー台湾ドル	1.9%	9 TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	台湾	1.0%
10 オーストラリアドル	1.7%	10 BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	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）	2.3%

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

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- 2020年は設定日から年末までの、2024年は年初から6月28日までの収益率を表示
- 2019年以前は対象指数(ベンチマーク)の年間収益率を表示

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。
ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

1【申込（販売）手続等】

申込みの受付

原則、取得申込受付日の午後４時までに受け付けた取得申込み（当該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）を当該取得申込受付日の申込みとします。午後４時過ぎに受け付けた取得申込みは翌営業日を取得申込受付日とします。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。

ただし、以下に定める日には取得申込みができません。

- １．ニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドン証券取引所、ロンドンの銀行、香港取引所、香港の銀行のいずれかの休業日
- ２．計算期間終了日の４営業日前から起算して３営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の５営業日前から起算して４営業日以内）
- ３．この信託が終了することとなる場合において、信託終了日の直前５営業日間
- ４．１．から３．のほか、委託会社が、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めたとき

なお、委託会社は、２．から４．に定める日の申込みであっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される期日および期間における申込みについては受け付けることができます。

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

100口の整数倍で販売会社が定める単位

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。

申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認ください。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ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）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

MAXIS専用サイト <https://maxis.am.mufg.jp/>

申込手数料

販売会社が定める額

申込手数料は販売会社にご確認ください。

申込方法

取得申込者は、販売会社取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

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

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、決済機能の停止、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れがあると判断した場合その他やむを得ない事情（投資対象国・地域における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場

の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、取得申込みの受付け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けを取り消すことができます。

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

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

解約の受付

受益者は自己に帰属する受益権につき解約の請求ができます。原則、解約請求受付日の午後4時までに受け付けた解約請求（当該解約請求の受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を当該解約請求受付日の請求とします。午後4時過ぎに受け付けた解約請求は翌営業日を解約請求受付日とします。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。

ただし、以下に定める日には解約請求ができません。

- 1．ニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドン証券取引所、ロンドンの銀行、香港取引所、香港の銀行のいずれかの休業日
- 2．計算期間終了日の4営業日前から起算して3営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して4営業日以内）
- 3．この信託が終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
- 4．1．から3．のほか、委託会社が、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めたとき

なお、委託会社は、2．から4．に定める日の解約請求であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される期日および期間における解約請求については受け付けることができます。

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

100口の整数倍で販売会社が定める単位

解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差引いた価額

信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%をかけた額

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/>

解約手数料

販売会社が定める額

解約手数料は販売会社にご確認ください。

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、決済機能の停止、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れがあると判断した場合その他やむを得ない事情（投資対象国・地域における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことができます。

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。

買取り

販売会社は、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になった場合で、信託終了日の2営業日前までに受益者の請求があるときは、その受益権を買取ります。

受益権の買取価額は、買取請求の受付日の翌営業日の基準価額とします。

販売会社は、受益権の買取りを行うときは、販売会社が定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。

販売会社は、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、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて受益権の買取りを停止することおよびすでに受け付けた受益権の買取りを取り消すことができます。

受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取り停止以前に行った当日の買取り請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取り請求を撤回しない場合には、買取り停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取り請求を受け付けたものとします。

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、当ファンドでは1口当たりの価額で表示されます。

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

（資産の評価方法）

・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

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

・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

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

・公社債等

原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品

取引業者・銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。

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

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

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

・外国為替予約取引

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

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

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.mufig.jp/>

MAXIS専用サイト <https://maxis.am.mufig.jp/>

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限（2020年１月８日設定）

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

（４）【計算期間】

毎年６月９日から12月８日および12月９日から翌年６月８日まで

ただし、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10万口を下回ることとなったとき

・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、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、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合、対象指数が廃止された場合、対象指数の計算方法その他の変更等に伴って委託会社または受託会

社が必要と認めたファンドの信託約款の変更が書面決議により否決された場合は、原則として、ファンドを償還させます。

なお、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合によりファンドを償還するときには、その廃止された日にファンドを償還するための手続きを開始するものとし、

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。

信託約款の変更等

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

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

ファンドの償還等に関する開示方法

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

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

金融商品取引所への上場

委託会社は、ファンドの受益権について、金融商品取引所に上場申請を行うものとし、当該受益権は、当該金融商品取引所の定める諸規則等に基づき当該金融商品取引所の承認を得たうえで、当該金融商品取引所が開設する市場に上場されるものとし、

委託会社は、ファンドの受益権が上場された場合には、上記の金融商品取引所の定める諸規則等を遵守し、当該金融商品取引所が諸規則等に基づいて行う受益権に対する上場廃止または売買取引の停止その他の措置に従うものとし、

反対者の買取請求権

委託会社がファンドの任意償還、重大な約款変更等を行う場合、書面決議において反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

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「上場投資信託の取扱い等に関する契約」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

投資信託及び投資法人に関する法律により、交付運用報告書および運用報告書（全体版）の作成・交付は行いません。運用内容については、販売会社または委託会社の照会先にてご確認い

ただけます。

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

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請求権および名義登録

受益者（計算期間終了日において受益者名簿に名義登録^{（注）}されている受益者（「名義登録受益者」といいます。）とします。）は、収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

- ・収益分配金は、原則として、毎計算期間終了後40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定する預金口座等に当該収益分配金を振り込む方式等により支払われます。
- ・受益者が、収益分配金について支払開始日から５年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。

（注）受託会社は、ファンドに係る受益者名簿を作成し、受益者について、その氏名または名称および住所その他受託会社が定める事項を、受益者名簿に名義登録するものとします。また、計算期間終了日において、社振法等関係法令、諸規則等に基づき振替機関より通知を受けた受益権の帰属者を、振替機関等の振替口座簿に記載または記録された受益権に係る受益者として、その氏名または名称および住所その他受託会社の定める事項を受益者名簿に登録するものとします。なお、受託会社は他の証券代行会社等、受託会社が適当と認める者と委託契約を締結し、受益者名簿の作成および受益者名簿への名義登録を委託することができます。

受益者は、ファンドの受益権が上場されている金融商品取引所の会員（口座管理機関であるものに限ります。）を経由して受益者名簿に名義登録することを請求することができます。この場合、当該会員は、当該会員が定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。ただし、証券金融会社等は登録を受託会社（受託会社が受益者名簿の作成を委託した場合は、その委託をした者）に対して直接に行うことができます。

名義登録は、毎計算期間の末日の翌日から15日間停止するものとします。また、ファンドが終了することとなる場合は、信託終了日の直前５営業日間に於いて名義登録を停止するものとします。

（２）償還金に対する請求権

受益者（信託終了日において受益者名簿に名義登録されている受益者（「名義登録受益者」といいます。）とします。）は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

- ・ 償還金は、原則として信託終了後40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定する預金口座等に当該償還金を振り込む方式により支払われます。
- ・ 受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。

（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12月9日から2024年6月8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】

【MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 [2023年12月 8日現在]	第9期 [2024年 6月 8日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	88,409,440	117,314,999
親投資信託受益証券	32,247,697,306	53,314,870,704
未収入金	98,096,626	175,390,649
未収利息	-	412
流動資産合計	32,434,203,372	53,607,576,764
資産合計	32,434,203,372	53,607,576,764
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	248,056,200	412,948,800
未払受託者報酬	3,211,400	4,684,810
未払委託者報酬	9,313,009	13,585,883
未払利息	22	-
その他未払費用	8,101,015	11,276,218
流動負債合計	268,681,646	442,495,711
負債合計	268,681,646	442,495,711
純資産の部		
元本等		
元本	19,687,000,000	26,136,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	12,478,521,726	27,029,081,053
（分配準備積立金）	1,086,640	346,809
元本等合計	32,165,521,726	53,165,081,053
純資産合計	32,165,521,726	53,165,081,053
負債純資産合計	32,434,203,372	53,607,576,764

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期 自 2023年 6月 9日 至 2023年12月 8日	第9期 自 2023年12月 9日 至 2024年 6月 8日
営業収益		
受取利息	507	31,173
有価証券売買等損益	2,240,872,971	9,388,558,426
営業収益合計	2,240,873,478	9,388,589,599
営業費用		
支払利息	34,402	5,678
受託者報酬	3,211,400	4,684,810
委託者報酬	9,313,009	13,585,883
その他費用	9,916,429	13,461,701
営業費用合計	22,475,240	31,738,072
営業利益又は営業損失（ ）	2,218,398,238	9,356,851,527
経常利益又は経常損失（ ）	2,218,398,238	9,356,851,527
当期純利益又は当期純損失（ ）	2,218,398,238	9,356,851,527
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（ ）	-	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	8,218,021,688	12,478,521,726
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,482,259,000	5,764,116,600
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,482,259,000	5,764,116,600
剰余金減少額又は欠損金増加額	192,101,000	157,460,000
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	192,101,000	157,460,000
分配金	248,056,200	412,948,800
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	12,478,521,726	27,029,081,053

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第8期 [2023年12月 8日現在]	第9期 [2024年 6月 8日現在]
１．期首元本額	15,797,000,000円	19,687,000,000円
期中追加設定元本額	4,170,000,000円	6,629,000,000円
期中一部解約元本額	280,000,000円	180,000,000円
２．受益権の総数	1,968,700口	2,613,600口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第8期 自 2023年 6月 9日 至 2023年12月 8日			第9期 自 2023年12月 9日 至 2024年 6月 8日		
１．その他費用 上場費用および商標使用料等を含んでおります。			１．その他費用 上場費用および商標使用料等を含んでおります。		
２．分配金の計算過程			２．分配金の計算過程		
項目			項目		
当期配当等収益額	A	33,895円	当期配当等収益額	A	25,495円
親ファンドの配当等収益額	B	270,366,308円	親ファンドの配当等収益額	B	443,915,868円
分配準備積立金額	C	1,251,265円	分配準備積立金額	C	1,086,640円
配当等収益合計額	D=A+B+C	271,583,678円	配当等収益合計額	D=A+B+C	445,028,003円
経費	E	22,440,838円	経費	E	31,732,394円
当ファンドの分配対象収益額	F=D-E	249,142,840円	当ファンドの分配対象収益額	F=D-E	413,295,609円
収益分配金金額	G	248,056,200円	収益分配金金額	G	412,948,800円
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	1,086,640円	次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	346,809円
当ファンドの期末残存口数	I	1,968,700口	当ファンドの期末残存口数	I	2,613,600口
1口当たり分配金額	J=G/I	126円	1口当たり分配金額	J=G/I	158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8期 自 2023年 6月 9日 至 2023年12月 8日	第9期 自 2023年12月 9日 至 2024年 6月 8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8期 [2023年12月 8日現在]	第9期 [2024年 6月 8日現在]
１．貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
２．時価の算定方法	（１）有価証券	（１）有価証券

区分	第8期 [2023年12月 8日現在]	第9期 [2024年 6月 8日現在]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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。 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 （２）デリバティブ取引 同左 （３）上記以外の金融商品 同左 同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第8期 [2023年12月 8日現在]	第9期 [2024年 6月 8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	2,017,896,679	9,051,747,733
合計	2,017,896,679	9,051,747,733

（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8期 [2023年12月 8日現在]	第9期 [2024年 6月 8日現在]
1口当たり純資産額	16,338円	20,342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	新興国株式インデックスマザーファンド	1,381,285,274	5,496,548,490	
	日本株式インデックスマザーファンド	1,421,679,947	2,817,200,982	
	外国株式インデックスマザーファンド	6,229,822,279	45,001,121,232	
合計		9,032,787,500	53,314,870,704	

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 6月 8日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	20,019,231,930
コール・ローン	15,139,234,875
株式	5,545,782,585,018
投資証券	103,434,560,102
派生商品評価勘定	1,171,187,156
未収入金	58,738,076
未収配当金	7,316,088,419
未収利息	26,628
差入委託証拠金	87,651,169,706
流動資産合計	5,780,572,821,910
資産合計	
5,780,572,821,910	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	39,200,650
未払金	2,858,318,881
未払解約金	8,582,992,762
流動負債合計	11,480,512,293
負債合計	
11,480,512,293	
純資産の部	
元本等	
元本	798,650,915,696
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,970,441,393,921
元本等合計	5,769,092,309,617
純資産合計	
5,769,092,309,617	
負債純資産合計	
5,780,572,821,910	

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 6月 8日現在]
1. 期首	2023年12月 9日
期首元本額	596,271,672,411円
期中追加設定元本額	234,213,846,411円
期中一部解約元本額	31,834,603,126円
元本の内訳	
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	166,123,315円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	883,373,654円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	880,048,668円
MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信	3,104,554,444円
MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信	6,229,822,279円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	1,242,658,517円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	8,043,919,293円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	9,928,768,855円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）	39,048,208円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）	109,717,637円
ファンド・マネジャー（海外株式）	777,169円
eMAXIS 先進国株式インデックス	14,049,026,199円
eMAXIS バランス（８資産均等型）	934,179,637円
eMAXIS バランス（波乗り型）	35,102,977円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	1,615,318,696円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３０（確定拠出年金）	190,109,914円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４０（確定拠出年金）	265,892,071円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５０（確定拠出年金）	250,354,058円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	105,078,257,241円
海外株式セレクション（ラップ向け）	2,110,230,712円
eMAXIS Slim バランス（８資産均等型）	4,942,225,448円
つみたて先進国株式	35,380,831,730円
つみたて８資産均等バランス	2,467,667,533円
つみたて４資産均等バランス	921,823,231円
eMAXIS マイマネージャー １９７０ｓ	1,874,461円
eMAXIS マイマネージャー １９８０ｓ	3,333,507円
eMAXIS マイマネージャー １９９０ｓ	7,168,851円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３５（確定拠出年金）	163,104,498円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４５（確定拠出年金）	218,045,755円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５５（確定拠出年金）	156,852,544円
三菱ＵＦＪ DC年金バランス（株式１５）	60,003,356円
三菱ＵＦＪ DC年金バランス（株式４０）	496,180,496円
三菱ＵＦＪ DC年金バランス（株式６５）	1,476,337,599円
eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）	62,879,164,810円
eMAXIS Slim 全世界株式（３地域均等型）	726,772,458円
三菱ＵＦＪ DC年金インデックス（先進国株式）	4,913,873,922円
eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）	417,088,185,348円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）	151,781,988円
三菱ＵＦＪ DC年金バランス（株式２５）	40,866,041円
つみたて全世界株式	3,111,378,419円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６５（確定拠出年金）	75,002,545円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	2,796,527,551円
三菱ＵＦＪ DC年金バランス（株式８０）	65,545,821円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	2,766,875,069円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	75,826,053円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	7,027,242円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	12,322,255円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０７０（確定拠出年金）	968,369円
三菱ＵＦＪ DC海外株式インデックスファンド	33,855,358,762円
eMAXIS 全世界株式インデックス	6,712,406,606円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	490,953,430円

	[2024年 6月 8日現在]
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	1,174,197,344円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	195,865,278円
三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）	704,323,044円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	128,378,872円
eMAXIS バランス（４資産均等型）	379,020,393円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	76,390,722円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	113,880,056円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	510,095,543円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	436,196,735円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	915,824,812円
三菱ＵＦＪ 外国株式ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	1,116,139,665円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,257,532円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,693,553,530円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	26,980,893円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	547,176,320円
MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	8,655,549,219円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	56,322円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	433,987,574円
MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	4,161,573,510円
アドバンスト・バランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	6,434,619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
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	1,565,921,702円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	474,962,445円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	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）	52,906,921円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	1,539,083,383円
MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	71,184,448円
MUKAM 外国株式インデックスファンド２（適格機関投資家限定）	2,568,358,990円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション２（適格機関投資家限定）	82,874,954円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	7,112,893,708円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）２（適格機関投資家転売制限付）	14,536,756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	8,958,452,594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）	274,879,483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）	144,732,915円
グローバルバランスオープンＶ（適格機関投資家限定）	1,380,839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）	41,688,131円
MUAM 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	2,954,612,277円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	595,318円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	1,431,221円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	385,286円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	1,610,167円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンドＶＡ	19,753,162円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	661,136円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	5,763,702円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	637,725円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	6,729,824円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>外国株式インデックスファンド	7,189,592,387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）	70,380,146円

	[2024年 6月 8日現在]
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）	305,475,748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）	337,783,641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）	360,446,682円
合計	798,650,915,696円
2. 受益権の総数	798,650,915,696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12月 9日 至 2024年 6月 8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 6月 8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 6月 8日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	96,968,629,626
投資証券	1,888,582,737
合計	98,857,212,363

（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 6月 8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	120,662,965,256	—	121,792,064,495	1,129,099,239
合計		120,662,965,256	—	121,792,064,495	1,129,099,239

（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 6月 8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	7,120,308,099	—	7,121,725,981	1,417,882
	カナダドル	293,501,181	—	293,760,446	259,265
	オーストラリアドル	202,083,978	—	202,205,416	121,438
	イギリスポンド	421,703,303	—	421,511,705	191,598
	スイスフラン	257,073,606	—	257,401,916	328,310
	香港ドル	42,031,412	—	42,032,887	1,475
	シンガポールドル	19,769,823	—	19,800,141	30,318
	スウェーデンクローネ	63,558,388	—	63,557,790	598
	デンマーククローネ	128,415,716	—	128,541,196	125,480
	ユーロ	771,534,761	—	772,330,056	795,295
合計		9,319,980,267	—	9,322,867,534	2,887,267

（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 6月 8日現在]
1口当たり純資産額	7.2235円

	[2024年 6月 8日現在]
(1万口当たり純資産額)	(72,235円)

附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1)株式

(単位：円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	220,657	29.23	6,449,804.11	
	BAKER HUGHES CO	593,714	31.75	18,850,419.50	
	CHENIERE ENERGY INC	135,380	160.59	21,740,674.20	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	58,377	88.31	5,155,272.87	
	CHEVRON CORP	1,025,303	155.93	159,875,496.79	
	CHORD ENERGY CORP	36,000	167.96	6,046,560.00	
	CONOCOPHILLIPS	686,579	112.20	77,034,163.80	
	COTERRA ENERGY INC	444,081	27.66	12,283,280.46	
	DEVON ENERGY CORP	374,397	46.76	17,506,803.72	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	98,666	191.04	18,849,152.64	
	EOG RESOURCES INC	338,412	121.21	41,018,918.52	
	EQT CORP	253,672	40.66	10,314,303.52	
	EXXON MOBIL CORP	2,621,846	113.97	298,811,788.62	
	HALLIBURTON CO	500,674	33.82	16,932,794.68	
	HESS CORP	161,590	147.98	23,912,088.20	
	HF SINCLAIR CORP	99,576	53.99	5,376,108.24	
	KINDER MORGAN INC	1,156,301	19.81	22,906,322.81	
	MARATHON OIL CORP	355,072	27.88	9,899,407.36	
	MARATHON PETROLEUM CORP	214,673	175.73	37,724,486.29	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	393,509	60.08	23,642,020.72	
	ONEOK INC	335,474	78.95	26,485,672.30	
	OVINTIV INC	156,183	48.37	7,554,571.71	
	PHILLIPS 66	252,751	138.37	34,973,155.87	
	SCHLUMBERGER LTD	841,519	43.66	36,740,719.54	
	TARGA RESOURCES CORP	125,671	117.98	14,826,664.58	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	11,740	592.75	6,958,885.00	
	VALERO ENERGY CORP	188,694	155.77	29,392,864.38	
	WILLIAMS COS INC	699,797	41.42	28,985,591.74	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	129,747	269.72	34,995,360.84	
	ALBEMARLE CORP	72,787	118.18	8,601,967.66	
	AMCOR PLC	830,703	10.16	8,439,942.48	
	AVERY DENNISON CORP	47,408	226.92	10,757,823.36	
	BALL CORP	181,633	69.79	12,676,167.07	
	CELANESE CORP	69,532	147.20	10,235,110.40	

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	101,273	77.30	7,828,402.90
CLEVELAND-CLIFFS INC	275,888	16.05	4,428,002.40
CORTEVA INC	413,021	54.92	22,683,113.32
CRH PLC	402,939	77.36	31,171,361.04
CROWN HOLDINGS INC	62,964	82.29	5,181,307.56
DOW INC	405,118	55.68	22,556,970.24
DUPONT DE NEMOURS INC	250,741	80.25	20,121,965.25
EASTMAN CHEMICAL CO	72,970	101.01	7,370,699.70
ECOLAB INC	147,578	240.52	35,495,460.56
FREEMPORT-MCMORAN INC	848,529	51.25	43,487,111.25
INTERNATIONAL PAPER CO	197,342	44.43	8,767,905.06
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	145,984	97.90	14,291,833.60
LINDE PLC	282,000	433.85	122,345,700.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	154,531	95.24	14,717,532.44
MARTIN MARIETTA MATERIALS	36,908	551.28	20,346,642.24
MOSAIC CO/THE	174,017	29.06	5,056,934.02
NEWMONT CORP	675,828	42.50	28,722,690.00
NUCOR CORP	138,599	163.34	22,638,760.66
PACKAGING CORP OF AMERICA	55,207	183.09	10,107,849.63
PPG INDUSTRIES INC	136,514	130.62	17,831,458.68
RELIANCE INC	32,720	289.44	9,470,476.80
RPM INTERNATIONAL INC	77,162	110.19	8,502,480.78
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	139,485	304.06	42,411,809.10
STEEL DYNAMICS INC	87,241	128.35	11,197,382.35
VULCAN MATERIALS CO	74,803	248.58	18,594,529.74
WESTLAKE CORP	25,469	154.28	3,929,357.32
WESTROCK CO	151,038	52.24	7,890,225.12
3M CO	326,811	98.22	32,099,376.42
AECOM	82,034	85.35	7,001,601.90
AERCAP HOLDINGS NV	120,566	91.26	11,002,853.16
ALLEGION PLC	47,118	117.52	5,537,307.36
AMETEK INC	133,706	168.69	22,554,865.14
AXON ENTERPRISE INC	43,457	279.15	12,131,021.55
BOEING CO/THE	336,012	191.42	64,319,417.04
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	71,496	145.64	10,412,677.44
CARLISLE COS INC	28,880	407.50	11,768,600.00
CARRIER GLOBAL CORP	472,964	62.48	29,550,790.72
CATERPILLAR INC	293,156	328.29	96,240,183.24
CNH INDUSTRIAL NV	529,492	10.31	5,459,062.52
CUMMINS INC	78,098	274.22	21,416,033.56
DEERE & CO	155,204	371.27	57,622,589.08
DOVER CORP	81,759	178.03	14,555,554.77

EATON CORP PLC	234,317	313.46	73,449,006.82
EMCOR GROUP INC	27,910	374.25	10,445,317.50
EMERSON ELECTRIC CO	332,410	105.97	35,225,487.70
FASTENAL CO	339,252	64.01	21,715,520.52
FERGUSON PLC	115,069	199.86	22,997,690.34
FORTIVE CORP	205,604	73.25	15,060,493.00
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	73,576	66.67	4,905,311.92
GE VERNOVA INC	162,132	160.31	25,991,380.92
GENERAL DYNAMICS CORP	136,585	298.27	40,739,207.95
GENERAL ELECTRIC CO	640,978	160.62	102,953,886.36
GRACO INC	105,925	78.42	8,306,638.50
HEICO CORP	23,226	224.96	5,224,920.96
HEICO CORP-CLASS A	47,152	178.08	8,396,828.16
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	382,112	208.45	79,651,246.40
HOWMET AEROSPACE INC	219,860	83.27	18,307,742.20
HUBBELL INC	31,805	365.94	11,638,721.70
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	25,628	250.63	6,423,145.64
IDEX CORP	47,065	203.40	9,573,021.00
ILLINOIS TOOL WORKS	175,614	240.97	42,317,705.58
INGERSOLL-RAND INC	235,808	88.38	20,840,711.04
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	84,100	37.94	3,190,754.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	391,990	69.58	27,274,664.20
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	113,719	222.04	25,250,166.76
LENNOX INTERNATIONAL INC	19,484	491.55	9,577,360.20
LOCKHEED MARTIN CORP	127,414	468.62	59,708,748.68
MASCO CORP	135,869	67.12	9,119,527.28
NORDSON CORP	34,650	226.51	7,848,571.50
NORTHROP GRUMMAN CORP	82,268	444.78	36,591,161.04
OTIS WORLDWIDE CORP	231,793	99.41	23,042,542.13
OWENS CORNING	53,631	176.56	9,469,089.36
PACCAR INC	304,771	109.10	33,250,516.10
PARKER HANNIFIN CORP	75,859	515.22	39,084,073.98
PENTAIR PLC	90,296	78.35	7,074,691.60
QUANTA SERVICES INC	83,333	267.28	22,273,244.24
ROCKWELL AUTOMATION INC	66,320	255.26	16,928,843.20
RTX CORP	780,790	108.18	84,465,862.20
SMITH (A.O.) CORP	75,351	80.88	6,094,388.88
SNAP-ON INC	31,639	267.04	8,448,878.56
STANLEY BLACK & DECKER INC	85,688	83.49	7,154,091.12
TEXTRON INC	113,409	85.80	9,730,492.20
TORO CO	66,459	91.11	6,055,079.49
TRANE TECHNOLOGIES PLC	132,934	318.46	42,334,161.64

TRANSDIGM GROUP INC	32,879	1,334.65	43,881,957.35
UNITED RENTALS INC	38,553	630.52	24,308,437.56
VERTIV HOLDINGS CO-A	215,191	88.00	18,936,808.00
WABTEC CORP	102,624	164.00	16,830,336.00
WATSCO INC	20,130	459.34	9,246,514.20
WW GRAINGER INC	25,293	879.03	22,233,305.79
XYLEM INC	135,895	136.87	18,599,948.65
AUTOMATIC DATA PROCESSING	237,929	247.97	58,999,254.13
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	75,179	152.28	11,448,258.12
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	66,371	197.70	13,121,546.70
CINTAS CORP	53,313	682.15	36,367,462.95
COPART INC	498,707	53.47	26,665,863.29
DAYFORCE INC	81,226	51.66	4,196,135.16
EQUIFAX INC	72,867	239.02	17,416,670.34
JACOBS SOLUTIONS INC	74,200	138.30	10,261,860.00
LEIDOS HOLDINGS INC	76,768	144.24	11,073,016.32
PAYCHEX INC	187,642	121.83	22,860,424.86
PAYCOM SOFTWARE INC	35,074	145.25	5,094,498.50
PAYLOCITY HOLDING CORP	24,837	140.54	3,490,591.98
REPUBLIC SERVICES INC	130,386	187.07	24,391,309.02
ROLLINS INC	176,448	47.41	8,365,399.68
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	132,756	62.07	8,240,164.92
TRANSUNION	106,627	73.26	7,811,494.02
VERALTO CORP	147,431	99.31	14,641,372.61
VERISK ANALYTICS INC	81,461	260.00	21,179,860.00
WASTE CONNECTIONS INC	153,566	168.98	25,949,582.68
WASTE MANAGEMENT INC	235,635	202.50	47,716,087.50
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	75,471	87.83	6,628,617.93
CSX CORP	1,131,742	32.99	37,336,168.58
DELTA AIR LINES INC	96,256	50.43	4,854,190.08
EXPEDITORS INTL WASH INC	85,680	125.52	10,754,553.60
FEDEX CORP	135,703	250.27	33,962,389.81
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	1,217,326	3.68	4,479,759.68
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	51,842	159.00	8,242,878.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	86,238	48.14	4,151,497.32
NORFOLK SOUTHERN CORP	130,488	224.70	29,320,653.60
OLD DOMINION FREIGHT LINE	112,027	169.84	19,026,665.68
SOUTHWEST AIRLINES CO	70,510	27.85	1,963,703.50
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	55,698	61.47	3,423,756.06
UBER TECHNOLOGIES INC	1,099,402	68.90	75,748,797.80
UNION PACIFIC CORP	356,791	228.31	81,458,953.21
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	423,126	137.56	58,205,212.56

APTIV PLC	162,072	81.30	13,176,453.60
FORD MOTOR CO	2,234,596	12.07	26,971,573.72
GENERAL MOTORS CO	673,776	45.61	30,730,923.36
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	458,916	11.74	5,387,673.84
TESLA INC	1,678,261	177.94	298,629,762.34
DECKERS OUTDOOR CORP	15,095	1,065.43	16,082,665.85
DR HORTON INC	169,800	143.70	24,400,260.00
GARMIN LTD	86,203	163.91	14,129,533.73
LENNAR CORP-A	142,731	156.12	22,283,163.72
LULULEMON ATHLETICA INC	65,392	323.03	21,123,577.76
NIKE INC -CL B	711,820	95.72	68,135,410.40
NVR INC	1,822	7,590.42	13,829,745.24
PULTEGROUP INC	124,567	114.49	14,261,675.83
AIRBNB INC-CLASS A	256,755	147.00	37,742,985.00
BOOKING HOLDINGS INC	19,965	3,810.06	76,067,847.90
CAESARS ENTERTAINMENT INC	115,054	36.67	4,219,030.18
CARNIVAL CORP	615,701	16.62	10,232,950.62
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	16,250	3,211.66	52,189,475.00
DARDEN RESTAURANTS INC	69,659	150.11	10,456,512.49
DOMINO'S PIZZA INC	20,479	513.69	10,519,857.51
DOORDASH INC - A	167,406	114.07	19,096,002.42
DRAFTKINGS INC-CL A	239,128	37.56	8,981,647.68
EXPEDIA GROUP INC	79,073	120.31	9,513,272.63
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	143,911	201.17	28,950,575.87
HYATT HOTELS CORP - CL A	24,388	145.68	3,552,843.84
LAS VEGAS SANDS CORP	225,905	43.66	9,863,012.30
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	145,398	232.03	33,736,697.94
MCDONALD'S CORP	422,610	260.72	110,182,879.20
MGM RESORTS INTERNATIONAL	154,928	40.09	6,211,063.52
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	138,908	154.55	21,468,231.40
STARBUCKS CORP	658,353	81.47	53,636,018.91
WYNN RESORTS LTD	54,362	92.48	5,027,397.76
YUM! BRANDS INC	168,884	140.83	23,783,933.72
ALPHABET INC-CL A	3,447,171	176.73	609,218,530.83
ALPHABET INC-CL C	2,984,997	178.35	532,374,214.95
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	53,480	279.36	14,940,172.80
COMCAST CORP-CLASS A	2,326,221	39.07	90,885,454.47
ELECTRONIC ARTS INC	146,773	137.40	20,166,610.20
FOX CORP - CLASS A	120,205	34.35	4,129,041.75
FOX CORP - CLASS B	88,642	31.98	2,834,771.16
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	239,094	30.75	7,352,140.50
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	109,976	71.41	7,853,386.16

LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	96,075	92.25	8,862,918.75	
MATCH GROUP INC	170,281	32.70	5,568,188.70	
META PLATFORMS INC-CLASS A	1,281,938	493.76	632,969,706.88	
NETFLIX INC	253,579	648.52	164,451,053.08	
NEWS CORP - CLASS A	205,514	27.71	5,694,792.94	
OMNICOM GROUP	113,234	90.96	10,299,764.64	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	317,208	11.97	3,796,979.76	
PINTEREST INC- CLASS A	357,685	42.73	15,283,880.05	
ROBLOX CORP -CLASS A	286,836	35.64	10,222,835.04	
ROKU INC	78,724	57.97	4,563,630.28	
SEA LTD-ADR	212,887	72.00	15,327,864.00	
SNAP INC - A	613,729	15.20	9,328,680.80	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	95,193	165.67	15,770,624.31	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	255,033	97.19	24,786,657.27	
WALT DISNEY CO/THE	1,076,015	101.21	108,903,478.15	
WARNER BROS DISCOVERY INC	1,344,492	8.34	11,213,063.28	
AMAZON.COM INC	5,476,523	185.00	1,013,156,755.00	
AUTOZONE INC	10,211	2,764.69	28,230,249.59	
BATH & BODY WORKS INC	130,365	46.37	6,045,025.05	
BEST BUY CO INC	118,391	88.16	10,437,350.56	
BURLINGTON STORES INC	37,211	233.90	8,703,652.90	
CARMAX INC	84,559	70.07	5,925,049.13	
DICK'S SPORTING GOODS INC	33,562	212.28	7,124,541.36	
EBAY INC	298,311	53.39	15,926,824.29	
ETSY INC	60,720	66.22	4,020,878.40	
GENUINE PARTS CO	83,745	144.61	12,110,364.45	
GLOBAL-E ONLINE LTD	65,600	30.15	1,977,840.00	
HOME DEPOT INC	580,288	331.10	192,133,356.80	
LKQ CORP	157,065	42.14	6,618,719.10	
LOWE'S COS INC	335,625	218.45	73,317,281.25	
MERCADOLIBRE INC	26,855	1,621.09	43,534,371.95	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	34,821	982.42	34,208,846.82	
POOL CORP	21,752	346.98	7,547,508.96	
ROSS STORES INC	195,243	144.15	28,144,278.45	
TJX COMPANIES INC	657,218	106.93	70,276,320.74	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	63,516	269.76	17,134,076.16	
ULTA BEAUTY INC	29,313	384.88	11,281,987.44	
WILLIAMS-SONOMA INC	36,901	296.51	10,941,515.51	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	183,466	20.28	3,720,690.48	
COSTCO WHOLESALE CORP	259,499	842.64	218,664,237.36	
DOLLAR GENERAL CORP	126,974	129.53	16,446,942.22	
DOLLAR TREE INC	115,976	112.37	13,032,223.12	

KROGER CO	387,622	51.95	20,136,962.90
SYSCO CORP	280,521	72.66	20,382,655.86
TARGET CORP	271,942	145.13	39,466,942.46
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	463,168	15.86	7,345,844.48
WALMART INC	2,589,153	67.15	173,861,623.95
ALTRIA GROUP INC	1,008,320	46.69	47,078,460.80
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	296,589	61.17	18,142,349.13
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	123,147	43.92	5,408,616.24
BUNGE GLOBAL SA	83,582	105.12	8,786,139.84
CAMPBELL SOUP CO	120,360	43.53	5,239,270.80
CELSIUS HOLDINGS INC	80,388	74.07	5,954,339.16
COCA-COLA CO/THE	2,395,044	64.15	153,642,072.60
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	116,740	74.70	8,720,478.00
CONAGRA BRANDS INC	284,657	29.54	8,408,767.78
CONSTELLATION BRANDS INC-A	97,400	250.11	24,360,714.00
GENERAL MILLS INC	334,850	67.39	22,565,541.50
HERSHEY CO/THE	89,177	197.32	17,596,405.64
HORMEL FOODS CORP	189,173	30.88	5,841,662.24
JM SMUCKER CO/THE	67,667	115.37	7,806,741.79
KELLANOVA	155,222	60.09	9,327,289.98
KEURIG DR PEPPER INC	625,118	34.51	21,572,822.18
KRAFT HEINZ CO/THE	539,608	34.57	18,654,248.56
LAMB WESTON HOLDINGS INC	79,379	86.05	6,830,562.95
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	148,517	69.22	10,280,346.74
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	99,682	52.86	5,269,190.52
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	789,777	68.19	53,854,893.63
MONSTER BEVERAGE CORP	448,501	52.45	23,523,877.45
PEPSICO INC	803,200	173.20	139,114,240.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	907,294	104.24	94,576,326.56
TYSON FOODS INC-CL A	165,986	56.38	9,358,290.68
CHURCH & DWIGHT CO INC	138,870	107.91	14,985,461.70
CLOROX COMPANY	70,270	132.44	9,306,558.80
COLGATE-PALMOLIVE CO	458,373	93.98	43,077,894.54
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	140,245	123.51	17,321,659.95
KENVUE INC	1,087,491	18.63	20,259,957.33
KIMBERLY-CLARK CORP	197,469	137.00	27,053,253.00
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,375,220	168.47	231,683,313.40
ABBOTT LABORATORIES	1,018,545	104.27	106,203,687.15
ALIGN TECHNOLOGY INC	39,533	257.46	10,178,166.18
BAXTER INTERNATIONAL INC	311,132	33.32	10,366,918.24
BECTON DICKINSON AND CO	170,891	240.17	41,042,891.47
BOSTON SCIENTIFIC CORP	850,868	76.12	64,768,072.16

CARDINAL HEALTH INC	136,795	98.80	13,515,346.00
CENCORA INC	104,281	236.67	24,680,184.27
CENTENE CORP	318,203	70.44	22,414,219.32
COOPER COS INC/THE	119,122	95.25	11,346,370.50
CVS HEALTH CORP	741,928	60.94	45,213,092.32
DAVITA INC	29,535	143.84	4,248,314.40
DEXCOM INC	222,118	115.30	25,610,205.40
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	349,812	87.68	30,671,516.16
ELEVANCE HEALTH INC	136,153	541.04	73,664,219.12
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	254,562	77.00	19,601,274.00
HCA HEALTHCARE INC	115,217	336.82	38,807,389.94
HENRY SCHEIN INC	70,861	68.60	4,861,064.60
HOLOGIC INC	144,223	74.78	10,784,995.94
HUMANA INC	71,884	355.43	25,549,730.12
IDEXX LABORATORIES INC	48,033	497.84	23,912,748.72
INSULET CORP	41,321	192.42	7,950,986.82
INTUITIVE SURGICAL INC	208,704	418.15	87,269,577.60
LABCORP HOLDINGS INC	50,788	198.41	10,076,847.08
MCKESSON CORP	76,498	586.11	44,836,242.78
MEDTRONIC PLC	783,285	82.34	64,495,686.90
MOLINA HEALTHCARE INC	35,487	313.40	11,121,625.80
QUEST DIAGNOSTICS INC	68,501	142.64	9,770,982.64
RESMED INC	88,892	211.56	18,805,991.52
SOLVENTUM CORP	73,943	55.05	4,070,562.15
STERIS PLC	56,061	230.48	12,920,939.28
STRYKER CORP	201,343	349.63	70,395,553.09
TELEFLEX INC	25,117	216.40	5,435,318.80
THE CIGNA GROUP	164,305	337.91	55,520,302.55
UNITEDHEALTH GROUP INC	539,403	501.92	270,737,153.76
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	31,888	189.34	6,037,673.92
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	88,545	185.01	16,381,710.45
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	117,535	113.37	13,324,942.95
ABBVIE INC	1,035,887	168.57	174,619,471.59
AGILENT TECHNOLOGIES INC	168,056	132.82	22,321,197.92
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	73,985	149.30	11,045,960.50
AMGEN INC	313,861	305.69	95,944,169.09
AVANTOR INC	389,080	24.07	9,365,155.60
BIO-RAD LABORATORIES-A	11,720	289.00	3,387,080.00
BIO-TECHNE CORP	84,689	78.83	6,676,033.87
BIOGEN INC	86,956	231.99	20,172,922.44
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	118,650	80.85	9,592,852.50
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,184,660	40.88	48,428,900.80

CATALENT INC	93,028	56.21	5,229,103.88
CHARLES RIVER LABORATORIES	29,813	221.62	6,607,157.06
DANAHER CORP	413,404	267.98	110,784,003.92
ELI LILLY & CO	473,007	837.29	396,044,031.03
EXACT SCIENCES CORP	103,405	44.67	4,619,101.35
GILEAD SCIENCES INC	732,478	63.85	46,768,720.30
ILLUMINA INC	91,078	114.71	10,448,012.77
INCYTE CORP	115,210	58.41	6,729,416.10
IQVIA HOLDINGS INC	107,104	220.49	23,615,360.96
JOHNSON & JOHNSON	1,410,431	146.42	206,515,307.02
MERCK & CO. INC.	1,483,602	130.52	193,639,733.04
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	12,144	1,438.03	17,463,436.32
MODERNA INC	190,577	154.69	29,480,356.13
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	60,837	133.07	8,095,579.59
PFIZER INC	3,320,022	28.80	95,616,633.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	63,255	1,000.79	63,304,971.45
REPLIGEN CORP	27,634	148.54	4,104,754.36
REVVITY INC	76,788	111.02	8,525,003.76
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	208,355	27.09	5,644,336.95
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	671,525	16.61	11,154,030.25
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	224,267	579.84	130,038,977.28
UNITED THERAPEUTICS CORP	24,588	276.40	6,796,123.20
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	149,543	485.53	72,607,612.79
VIATRIS INC	629,398	10.42	6,558,327.16
WATERS CORP	35,175	300.55	10,571,846.25
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	43,055	315.20	13,570,936.00
ZOETIS INC	270,463	176.78	47,812,449.14
BANK OF AMERICA CORP	4,154,190	39.70	164,921,343.00
CITIGROUP INC	1,125,722	61.94	69,727,220.68
CITIZENS FINANCIAL GROUP	256,640	34.06	8,741,158.40
FIFTH THIRD BANCORP	394,016	36.11	14,227,917.76
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	6,156	1,695.63	10,438,298.28
HUNTINGTON BANCSHARES INC	909,206	13.38	12,165,176.28
JPMORGAN CHASE & CO	1,678,744	196.91	330,561,481.04
KEYCORP	488,764	13.93	6,808,482.52
M & T BANK CORP	100,291	145.31	14,573,285.21
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	229,345	154.97	35,541,594.65
REGIONS FINANCIAL CORP	526,791	18.64	9,819,384.24
TRUIST FINANCIAL CORP	769,144	36.42	28,012,224.48
US BANCORP	918,645	39.02	35,845,527.90
WELLS FARGO & CO	2,069,911	57.73	119,495,962.03
ALLY FINANCIAL INC	150,075	38.46	5,771,884.50

AMERICAN EXPRESS CO	338,254	233.35	78,931,570.90
AMERIPRISE FINANCIAL INC	59,388	425.51	25,270,187.88
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	269,558	19.91	5,366,899.78
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	230,296	112.97	26,016,539.12
ARES MANAGEMENT CORP - A	108,433	134.00	14,530,022.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	428,435	59.91	25,667,540.85
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	766,398	411.08	315,050,889.84
BLACKROCK INC	87,219	778.53	67,902,608.07
BLACKSTONE INC	421,522	119.17	50,232,776.74
BLOCK INC	320,741	66.40	21,297,202.40
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	223,321	136.37	30,454,284.77
CARLYLE GROUP INC/THE	126,277	41.33	5,219,028.41
CBOE GLOBAL MARKETS INC	62,382	174.00	10,854,468.00
CME GROUP INC	208,275	201.49	41,965,329.75
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	108,214	257.08	27,819,655.12
COREBRIDGE FINANCIAL INC	135,682	28.92	3,923,923.44
CORPAY INC	40,935	261.50	10,704,502.50
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	147,039	122.76	18,050,507.64
EQUITABLE HOLDINGS INC	194,443	40.30	7,836,052.90
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	21,946	410.10	9,000,054.60
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	336,456	76.37	25,695,144.72
FISERV INC	347,559	150.56	52,328,483.04
FRANKLIN RESOURCES INC	152,703	23.22	3,545,763.66
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	37,000	76.48	2,829,760.00
GLOBAL PAYMENTS INC	151,430	97.76	14,803,796.80
GOLDMAN SACHS GROUP INC	189,996	458.10	87,037,167.60
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	332,309	134.86	44,815,191.74
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	46,021	164.55	7,572,755.55
KKR & CO INC	361,768	99.49	35,992,298.32
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	42,069	280.18	11,786,892.42
MARKETAXESS HOLDINGS INC	23,552	205.97	4,851,005.44
MASTERCARD INC - A	487,323	448.68	218,652,083.64
MOODY'S CORP	96,730	406.82	39,351,698.60
MORGAN STANLEY	718,436	96.85	69,580,526.60
MSCI INC	45,899	493.09	22,632,337.91
NASDAQ INC	240,048	59.26	14,225,244.48
NORTHERN TRUST CORP	120,683	82.76	9,987,725.08
PAYPAL HOLDINGS INC	587,337	67.02	39,363,325.74
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	111,311	120.23	13,382,921.53
ROBINHOOD MARKETS INC - A	320,415	22.97	7,359,932.55
S&P GLOBAL INC	188,243	434.66	81,821,702.38
SCHWAB (CHARLES) CORP	883,955	74.25	65,633,658.75

SEI INVESTMENTS COMPANY	60,138	66.42	3,994,365.96
STATE STREET CORP	173,980	74.50	12,961,510.00
SYNCHRONY FINANCIAL	229,216	43.06	9,870,040.96
T ROWE PRICE GROUP INC	135,044	116.23	15,696,164.12
TOAST INC-CLASS A	172,934	22.62	3,911,767.08
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	69,891	106.18	7,421,026.38
VISA INC-CLASS A SHARES	925,136	277.04	256,299,677.44
AFLAC INC	319,652	88.35	28,241,254.20
ALLSTATE CORP	150,417	163.12	24,536,021.04
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	45,623	128.64	5,868,942.72
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	406,176	75.62	30,715,029.12
AON PLC-CLASS A	114,614	285.71	32,746,365.94
ARCH CAPITAL GROUP LTD	214,039	100.08	21,421,023.12
ARTHUR J GALLAGHER & CO	128,171	251.64	32,252,950.44
ASSURANT INC	28,492	172.52	4,915,439.84
BROWN & BROWN INC	142,201	89.53	12,731,255.53
CHUBB LTD	237,510	263.75	62,643,262.50
CINCINNATI FINANCIAL CORP	89,731	114.91	10,310,989.21
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	12,973	362.20	4,698,820.60
EVEREST GROUP LTD	26,294	379.66	9,982,780.04
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	152,029	49.71	7,557,361.59
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	167,347	99.76	16,694,536.72
LOEWS CORP	113,501	75.00	8,512,575.00
MARKEL GROUP INC	7,277	1,599.84	11,642,035.68
MARSH & MCLENNAN COS	288,387	208.26	60,059,476.62
METLIFE INC	363,442	70.04	25,455,477.68
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	142,164	79.38	11,284,978.32
PROGRESSIVE CORP	342,584	213.19	73,035,482.96
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	211,962	117.21	24,844,066.02
TRAVELERS COS INC/THE	135,279	209.71	28,369,359.09
WILLIS TOWERS WATSON PLC	57,587	254.52	14,657,043.24
WR BERKLEY CORP	123,178	79.61	9,806,200.58
ACCENTURE PLC-CL A	368,292	291.74	107,445,508.08
ADOBE INC	262,419	458.13	120,222,016.47
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	90,523	90.02	8,148,880.46
ANSYS INC	50,694	324.73	16,461,862.62
APPROVIN CORP-CLASS A	102,190	83.23	8,505,273.70
ASPEN TECHNOLOGY INC	16,366	206.49	3,379,415.34
ATLASSIAN CORP-CL A	89,690	163.46	14,660,727.40
AUTODESK INC	124,555	215.87	26,887,687.85
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	115,702	50.38	5,829,066.76
CADENCE DESIGN SYS INC	160,465	295.74	47,455,919.10

CHECK POINT SOFTWARE TECH	53,285	154.82	8,249,583.70
CLOUDFLARE INC - CLASS A	166,624	71.25	11,871,960.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	288,979	66.31	19,162,197.49
CONFLUENT INC-CLASS A	134,592	25.94	3,491,316.48
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	135,382	340.49	46,096,217.18
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	21,827	237.84	5,191,333.68
DATADOG INC - CLASS A	163,948	109.62	17,971,979.76
DOCUSIGN INC	117,791	54.60	6,431,388.60
DYNATRACE INC	144,110	47.02	6,776,052.20
EPAM SYSTEMS INC	36,092	175.21	6,323,679.32
FAIR ISAAC CORP	14,348	1,329.88	19,081,118.24
FORTINET INC	376,625	59.75	22,503,343.75
GARTNER INC	46,386	432.20	20,048,029.20
GEN DIGITAL INC	348,898	25.44	8,875,965.12
GODADDY INC - CLASS A	83,207	138.66	11,537,482.62
HUBSPOT INC	27,985	598.51	16,749,302.35
INTL BUSINESS MACHINES CORP	536,561	168.20	90,249,560.20
INTUIT INC	164,388	572.65	94,136,788.20
MANHATTAN ASSOCIATES INC	38,101	219.82	8,375,361.82
MICROSOFT CORP	4,128,504	424.52	1,752,632,518.08
MICROSTRATEGY INC-CL A	9,234	1,656.63	15,297,321.42
MONDAY.COM LTD	23,133	223.59	5,172,307.47
MONGODB INC	40,846	229.88	9,389,678.48
OKTA INC	92,998	87.69	8,154,994.62
ORACLE CORP	965,143	123.50	119,195,160.50
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	1,112,329	23.79	26,462,306.91
PALO ALTO NETWORKS INC	186,999	295.93	55,338,614.07
PTC INC	73,716	174.60	12,870,813.60
ROPER TECHNOLOGIES INC	61,345	550.36	33,761,834.20
SALESFORCE INC	568,415	242.76	137,988,425.40
SAMSARA INC-CL A	124,341	34.86	4,334,527.26
SERVICENOW INC	120,389	703.16	84,652,729.24
SNOWFLAKE INC-CLASS A	176,268	132.04	23,274,426.72
SYNOPSYS INC	89,748	573.85	51,501,889.80
TWILIO INC - A	101,280	57.38	5,811,446.40
TYLER TECHNOLOGIES INC	24,361	481.42	11,727,872.62
UIPATH INC - CLASS A	282,330	12.25	3,458,542.50
UNITY SOFTWARE INC	132,776	18.03	2,393,951.28
VERISIGN INC	55,384	180.30	9,985,735.20
WIX.COM LTD	30,341	176.01	5,340,319.41
WORKDAY INC-CLASS A	119,233	214.95	25,629,133.35
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	140,544	63.11	8,869,731.84

ZSCALER INC	53,450	178.93	9,563,808.50
AMPHENOL CORP-CL A	355,221	130.86	46,484,220.06
APPLE INC	8,580,409	194.48	1,668,717,942.32
ARISTA NETWORKS INC	156,449	296.57	46,398,079.93
CDW CORP/DE	81,099	221.81	17,988,569.19
CISCO SYSTEMS INC	2,369,633	46.23	109,548,133.59
CORNING INC	475,112	37.40	17,769,188.80
DELL TECHNOLOGIES -C	153,369	133.96	20,545,311.24
F5 INC	35,964	165.77	5,961,752.28
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	730,353	19.59	14,307,615.27
HP INC	575,014	36.18	20,804,006.52
JABIL INC	66,575	114.32	7,610,854.00
JUNIPER NETWORKS INC	170,230	35.46	6,036,355.80
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	102,332	136.00	13,917,152.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	97,175	370.47	36,000,422.25
NETAPP INC	121,738	121.47	14,787,514.86
PURE STORAGE INC - CLASS A	183,656	64.04	11,761,330.24
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	116,599	96.00	11,193,504.00
SUPER MICRO COMPUTER INC	30,557	777.92	23,770,901.44
TE CONNECTIVITY LTD	178,510	149.33	26,656,898.30
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	27,598	393.00	10,846,014.00
TRIMBLE INC	130,417	55.57	7,247,272.69
WESTERN DIGITAL CORP	188,209	75.25	14,162,727.25
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	30,509	307.49	9,381,212.41
AT&T INC	4,174,800	18.28	76,315,344.00
T-MOBILE US INC	312,956	179.77	56,260,100.12
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,455,154	41.33	101,471,514.82
AES CORP	433,324	20.36	8,822,476.64
ALLIANT ENERGY CORP	149,496	50.55	7,557,022.80
AMEREN CORPORATION	162,603	72.10	11,723,676.30
AMERICAN ELECTRIC POWER	308,886	88.70	27,398,188.20
AMERICAN WATER WORKS CO INC	108,003	130.62	14,107,351.86
ATMOS ENERGY CORP	91,064	115.45	10,513,338.80
CENTERPOINT ENERGY INC	354,590	30.25	10,726,347.50
CMS ENERGY CORP	173,174	61.36	10,625,956.64
CONSOLIDATED EDISON INC	202,194	91.89	18,579,606.66
CONSTELLATION ENERGY	182,753	202.60	37,025,757.80
DOMINION ENERGY INC	493,643	52.27	25,802,719.61
DTE ENERGY COMPANY	117,670	113.54	13,360,251.80
DUKE ENERGY CORP	450,877	102.86	46,377,208.22
EDISON INTERNATIONAL	229,651	74.50	17,108,999.50
ENTERGY CORP	127,518	109.85	14,007,852.30

ESSENTIAL UTILITIES INC	146,859	37.69	5,535,115.71
EVERGY INC	138,949	53.41	7,421,266.09
EVERSOURCE ENERGY	211,633	58.83	12,450,369.39
EXELON CORP	590,677	36.52	21,571,524.04
FIRSTENERGY CORP	313,958	39.10	12,275,757.80
NEXTERA ENERGY INC	1,200,245	76.70	92,058,791.50
NISOURCE INC	260,713	28.54	7,440,749.02
NRG ENERGY INC	127,510	77.83	9,924,103.30
P G & E CORP	1,158,371	18.21	21,093,935.91
PPL CORP	421,673	28.70	12,102,015.10
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	292,361	74.44	21,763,352.84
SEMPRA	364,613	75.99	27,706,941.87
SOUTHERN CO/THE	642,671	78.65	50,546,074.15
VISTRA CORP	205,590	86.26	17,734,193.40
WEC ENERGY GROUP INC	178,536	80.35	14,345,367.60
XCEL ENERGY INC	322,605	54.82	17,685,206.10
ADVANCED MICRO DEVICES	947,026	166.78	157,944,996.28
ANALOG DEVICES INC	291,701	237.41	69,252,734.41
APPLIED MATERIALS INC	486,996	221.75	107,991,363.00
BROADCOM INC	257,573	1,401.27	360,929,317.71
ENPHASE ENERGY INC	80,001	132.30	10,584,132.30
ENTEGRIS INC	85,564	130.83	11,194,338.12
FIRST SOLAR INC	59,428	273.45	16,250,586.60
INTEL CORP	2,496,129	30.42	75,932,244.18
KLA CORP	79,483	779.26	61,937,922.58
LAM RESEARCH CORP	76,991	962.19	74,079,970.29
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	71,939	61.57	4,429,284.23
MARVELL TECHNOLOGY INC	510,365	68.10	34,755,856.50
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	309,713	93.36	28,914,805.68
MICRON TECHNOLOGY INC	648,877	130.07	84,399,431.39
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	28,696	758.61	21,769,072.56
NVIDIA CORP	1,462,305	1,209.98	1,769,359,803.90
NXP SEMICONDUCTORS NV	150,918	272.01	41,051,205.18
ON SEMICONDUCTOR	247,439	72.45	17,926,955.55
QORVO INC	59,269	99.98	5,925,714.62
QUALCOMM INC	653,284	209.44	136,823,800.96
SKYWORKS SOLUTIONS INC	96,505	91.72	8,851,438.60
TERADYNE INC	85,879	143.23	12,300,449.17
TEXAS INSTRUMENTS INC	532,678	196.24	104,532,730.72
CBRE GROUP INC - A	184,948	86.00	15,905,528.00
COSTAR GROUP INC	232,892	77.05	17,944,328.60
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	487,100	3.47	1,690,237.00

	ZILLOW GROUP INC - C	82,122	42.68	3,504,966.96	
	アメリカドル 小計	198,319,058		26,866,689,899.73 (4,186,098,953,276)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	376,000	25.39	9,546,640.00	
	CAMECO CORP	253,500	75.81	19,217,835.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	631,300	98.42	62,132,546.00	
	CENOVUS ENERGY INC	801,500	26.07	20,895,105.00	
	ENBRIDGE INC	1,250,200	49.48	61,859,896.00	
	IMPERIAL OIL LTD	106,800	89.87	9,598,116.00	
	KEYERA CORP	124,900	36.72	4,586,328.00	
	MEG ENERGY CORP	137,000	28.74	3,937,380.00	
	PARKLAND CORP	59,200	39.33	2,328,336.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	351,932	51.06	17,969,647.92	
	SUNCOR ENERGY INC	744,500	52.47	39,063,915.00	
	TC ENERGY CORP	616,300	54.89	33,828,707.00	
	TOURMALINE OIL CORP	200,400	67.09	13,444,836.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	281,040	93.92	26,395,276.80	
	BARRICK GOLD CORP	993,700	23.68	23,530,816.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	82,500	72.08	5,946,600.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	400,400	17.27	6,914,908.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	116,100	169.89	19,724,229.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	418,900	18.59	7,787,351.00	
	KINROSS GOLD CORP	677,600	10.93	7,406,168.00	
	LUNDIN MINING CORP	362,100	15.74	5,699,454.00	
	NUTRIEN LTD	298,559	76.37	22,800,950.83	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	243,300	29.53	7,184,649.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	260,900	69.79	18,208,211.00	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	26,600	108.72	2,891,952.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	278,000	76.00	21,128,000.00	
	CAE INC	166,100	25.78	4,282,058.00	
	STANTEC INC	65,700	113.51	7,457,607.00	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	49,100	120.43	5,913,113.00	
	WSP GLOBAL INC	68,400	209.14	14,305,176.00	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	211,400	24.90	5,263,860.00	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	120,300	52.73	6,343,419.00	
	RB GLOBAL INC	111,800	100.50	11,235,900.00	
	THOMSON REUTERS CORP	88,932	235.46	20,939,928.72	
	AIR CANADA	62,200	18.02	1,120,844.00	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	320,800	173.10	55,530,480.00	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	551,700	107.27	59,180,859.00	
	TFI INTERNATIONAL INC	42,800	191.30	8,187,640.00	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	162,200	60.38	9,793,636.00	

BRP INC/CA- SUB VOTING	15,700	86.69	1,361,033.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	74,300	52.23	3,880,689.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	168,710	97.11	16,383,428.10
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	25,300	140.04	3,543,012.00
DOLLARAMA INC	168,100	126.72	21,301,632.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	443,800	80.01	35,508,438.00
EMPIRE CO LTD 'A'	108,000	33.02	3,566,160.00
LOBLAW COMPANIES LTD	92,800	161.86	15,020,608.00
METRO INC/CN	149,700	75.57	11,312,829.00
WESTON (GEORGE) LTD	36,011	196.79	7,086,604.69
SAPUTO INC	150,300	27.95	4,200,885.00
BANK OF MONTREAL	432,200	118.28	51,120,616.00
BANK OF NOVA SCOTIA	723,800	64.71	46,837,098.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	539,100	67.29	36,276,039.00
NATIONAL BANK OF CANADA	191,700	118.03	22,626,351.00
ROYAL BANK OF CANADA	824,600	147.12	121,315,152.00
TORONTO-DOMINION BANK	1,037,400	76.60	79,464,840.00
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	221,588	53.24	11,797,345.12
BROOKFIELD CORP	791,450	57.86	45,793,297.00
IGM FINANCIAL INC	39,400	37.31	1,470,014.00
ONEX CORPORATION	41,700	98.61	4,112,037.00
TMX GROUP LTD	176,300	37.83	6,669,429.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	12,000	1,556.34	18,676,080.00
GREAT-WEST LIFE CO INC	176,800	39.56	6,994,208.00
IA FINANCIAL CORP INC	58,800	87.41	5,139,708.00
INTACT FINANCIAL CORP	104,300	229.36	23,922,248.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,033,600	35.38	36,568,768.00
POWER CORP OF CANADA	361,500	39.23	14,181,645.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	355,700	67.32	23,945,724.00
CGI INC	125,700	139.07	17,481,099.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	11,600	3,807.95	44,172,220.00
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	50,600	127.11	6,431,766.00
OPEN TEXT CORP	144,900	38.50	5,578,650.00
SHOPIFY INC - CLASS A	703,300	84.01	59,084,233.00
BCE INC	57,900	47.16	2,730,564.00
QUEBECOR INC -CL B	98,000	29.05	2,846,900.00
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	217,400	54.09	11,759,166.00
TELUS CORP	231,200	22.85	5,282,920.00
ALTAGAS LTD	172,600	30.80	5,316,080.00
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	94,950	42.91	4,074,304.50
CANADIAN UTILITIES LTD-A	58,500	31.66	1,852,110.00
EMERA INC	160,600	47.52	7,631,712.00

	FORTIS INC	276,200	55.61	15,359,482.00	
	HYDRO ONE LTD	169,900	40.83	6,937,017.00	
	NORTHLAND POWER INC	148,200	24.24	3,592,368.00	
	FIRSTSERVICE CORP	24,100	204.38	4,925,558.00	
	カナダドル 小計	23,414,972		1,568,714,441.68 (178,833,446,351)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	168,058	34.54	5,804,723.32	
	SANTOS LTD	1,889,577	7.52	14,209,619.04	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	1,140,450	27.11	30,917,599.50	
	BHP GROUP LTD	2,982,353	44.05	131,372,649.65	
	BLUESCOPE STEEL LTD	246,529	21.09	5,199,296.61	
	FORTESCUE LTD	1,019,659	24.06	24,532,995.54	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	263,533	46.24	12,185,765.92	
	MINERAL RESOURCES LTD	95,706	69.35	6,637,211.10	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	728,362	14.54	10,590,383.48	
	ORICA LTD	225,412	18.26	4,116,023.12	
	PILBARA MINERALS LTD	1,540,998	3.76	5,794,152.48	
	RIO TINTO LTD	207,976	124.51	25,895,091.76	
	SOUTH32 LTD	2,464,507	3.87	9,537,642.09	
	REECE LTD	130,639	25.97	3,392,694.83	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	92,198	39.64	3,654,728.72	
	BRAMBLES LTD	859,720	14.65	12,594,898.00	
	COMPUTERSHARE LTD	288,146	26.91	7,754,008.86	
	AURIZON HOLDINGS LTD	1,366,902	3.73	5,098,544.46	
	QANTAS AIRWAYS LTD	658,092	6.22	4,093,332.24	
	TRANSURBAN GROUP	1,818,456	12.84	23,348,975.04	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	316,075	46.31	14,637,433.25	
	LOTTERY CORP LTD/THE	1,165,622	5.16	6,014,609.52	
	CAR GROUP LTD	236,772	35.95	8,511,953.40	
	REA GROUP LTD	32,440	187.76	6,090,934.40	
	SEEK LTD	199,466	23.12	4,611,653.92	
	WESFARMERS LTD	678,072	66.27	44,935,831.44	
	COLES GROUP LTD	725,274	16.79	12,177,350.46	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	801,622	5.05	4,048,191.10	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	700,223	32.20	22,547,180.60	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	476,918	12.07	5,756,400.26	
	COCHLEAR LTD	38,183	329.41	12,577,862.03	
	PRO MEDICUS LTD	38,535	122.53	4,721,693.55	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	129,562	49.20	6,374,450.40	
	SONIC HEALTHCARE LTD	252,714	24.72	6,247,090.08	
	CSL LTD	285,352	289.50	82,609,404.00	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	1,764,829	29.06	51,285,930.74	

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	984,140	124.85	122,869,879.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,797,896	35.00	62,926,360.00	
	WESTPAC BANKING CORP	2,015,943	26.97	54,369,982.71	
	ASX LTD	113,672	63.70	7,240,906.40	
	MACQUARIE GROUP LTD	213,218	195.22	41,624,417.96	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	138,803	31.64	4,391,726.92	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,221,541	6.48	7,915,585.68	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	1,517,475	3.78	5,736,055.50	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	816,152	18.41	15,025,358.32	
	SUNCORP GROUP LTD	676,331	16.39	11,085,065.09	
	WISETECH GLOBAL LTD	104,309	100.22	10,453,847.98	
	XERO LTD	89,163	128.20	11,430,696.60	
	TELSTRA GROUP LTD	2,180,806	3.55	7,741,861.30	
	APA GROUP	737,148	8.54	6,295,243.92	
	ORIGIN ENERGY LTD	1,048,250	10.29	10,786,492.50	
	オーストラリアドル 小計	39,683,779		1,019,771,784.79 (105,964,486,157)	
イギリスポンド	BP PLC	9,862,351	4.63	45,677,478.65	
	SHELL PLC	3,754,208	27.36	102,733,901.92	
	ANGLO AMERICAN PLC	757,736	24.12	18,276,592.32	
	ANTOFAGASTA PLC	229,746	22.14	5,086,576.44	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	81,986	43.52	3,568,030.72	
	ENDEAVOUR MINING PLC	106,898	17.57	1,878,197.86	
	GLENCORE PLC	6,068,192	4.77	28,957,412.22	
	MONDI PLC	239,805	15.14	3,631,846.72	
	RIO TINTO PLC	658,287	54.09	35,606,743.83	
	ASHTAD GROUP PLC	247,826	55.56	13,769,212.56	
	BAE SYSTEMS PLC	1,759,744	13.94	24,530,831.36	
	BUNZL PLC	205,485	29.72	6,107,014.20	
	DCC PLC	56,482	57.20	3,230,770.40	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	818,590	6.30	5,163,665.72	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	4,779,549	4.58	21,899,893.51	
	SMITHS GROUP PLC	180,764	17.38	3,141,678.32	
	SPIRAX GROUP PLC	46,237	88.70	4,101,221.90	
	EXPERIAN PLC	539,897	37.43	20,208,344.71	
	INTERTEK GROUP PLC	105,981	49.32	5,226,982.92	
	RELX PLC	1,109,011	35.40	39,258,989.40	
	RENTOKIL INITIAL PLC	1,426,851	4.31	6,156,862.06	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	519,922	5.09	2,649,522.51	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	65,065	52.60	3,422,419.00	
	BURBERRY GROUP PLC	223,981	10.42	2,335,001.92	
	PERSIMMON PLC	218,440	14.91	3,256,940.40	

TAYLOR WIMPEY PLC	2,505,525	1.52	3,812,156.28
COMPASS GROUP PLC	995,178	22.02	21,913,819.56
ENTAIN PLC	318,737	7.22	2,301,281.14
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	102,844	149.50	15,375,178.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	88,617	79.88	7,078,725.96
PEARSON PLC	322,789	9.46	3,054,875.09
WHITBREAD PLC	109,945	29.93	3,290,653.85
AUTO TRADER GROUP PLC	520,853	8.29	4,320,996.48
INFORMA PLC	861,202	8.43	7,259,932.86
WPP PLC	695,292	7.78	5,414,934.09
JD SPORTS FASHION PLC	1,458,356	1.28	1,868,883.21
KINGFISHER PLC	1,064,697	2.68	2,858,711.44
NEXT PLC	73,640	92.82	6,835,264.80
SAINSBURY (J) PLC	864,017	2.67	2,312,109.49
TESCO PLC	4,028,188	3.09	12,471,270.04
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	178,973	25.84	4,624,662.32
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,159,112	24.34	28,212,786.08
COCA-COLA HBC AG-DI	139,727	27.16	3,794,985.32
DIAGEO PLC	1,282,603	27.12	34,790,606.37
IMPERIAL BRANDS PLC	475,337	19.84	9,430,686.08
HALEON PLC	4,003,569	3.31	13,263,824.09
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	416,618	45.26	18,856,130.68
UNILEVER PLC	1,472,472	43.89	64,626,796.08
SMITH & NEPHEW PLC	543,981	10.34	5,627,483.44
ASTRAZENECA PLC	910,057	125.90	114,576,176.30
GSK PLC	2,403,789	16.40	39,422,139.60
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	72,292	19.73	1,426,321.16
BARCLAYS PLC	8,918,202	2.16	19,276,693.62
HSBC HOLDINGS PLC	11,052,340	6.92	76,504,297.48
LLOYDS BANKING GROUP PLC	37,636,137	0.55	20,940,746.62
NATWEST GROUP PLC	3,865,885	3.18	12,324,441.38
STANDARD CHARTERED PLC	1,327,549	7.44	9,882,274.75
3I GROUP PLC	579,549	29.52	17,108,286.48
HARGREAVES LANSDOWN PLC	208,222	10.65	2,218,605.41
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	266,746	94.26	25,143,477.96
M&G PLC	1,211,540	2.01	2,437,618.48
SCHRODERS PLC	465,209	3.89	1,812,454.26
WISE PLC - A	304,193	8.49	2,584,119.53
ADMIRAL GROUP PLC	145,253	27.67	4,019,150.51
AVIVA PLC	1,466,553	4.80	7,051,186.82
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,328,554	2.53	8,437,884.39
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	427,896	4.99	2,135,201.04

	PRUDENTIAL PLC	1,563,873	7.62	11,919,840.00	
	SAGE GROUP PLC/THE	595,993	10.63	6,338,385.55	
	HALMA PLC	207,364	23.17	4,804,623.88	
	BT GROUP PLC	3,495,838	1.33	4,654,708.29	
	VODAFONE GROUP PLC	13,899,367	0.72	10,035,342.97	
	CENTRICA PLC	2,862,357	1.34	3,861,319.59	
	NATIONAL GRID PLC	2,728,846	8.64	23,577,229.44	
	SEVERN TRENT PLC	147,941	24.04	3,556,501.64	
	SSE PLC	627,105	17.84	11,190,688.72	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	366,180	10.11	3,702,079.80	
	イギリスポンド 小計	158,830,136		1,144,214,679.99 (228,041,985,722)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	99,007	13.77	1,363,326.39	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	4,820	733.00	3,533,060.00	
	GIVAUDAN-REG	5,281	4,324.00	22,835,044.00	
	HOLCIM LTD	309,438	79.68	24,656,019.84	
	SIG GROUP AG	180,750	17.33	3,132,397.50	
	SIKA AG-REG	91,127	273.50	24,923,234.50	
	ABB LTD-REG	939,353	50.62	47,550,048.86	
	GEBERIT AG-REG	20,321	556.00	11,298,476.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	15,651	230.50	3,607,555.50	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	22,674	235.00	5,328,390.00	
	VAT GROUP AG	16,784	489.80	8,220,803.20	
	ADECCO GROUP AG-REG	89,253	33.44	2,984,620.32	
	SGS SA-REG	92,854	83.94	7,794,164.76	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	28,395	269.10	7,641,094.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	317,275	149.20	47,337,430.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	15,105	190.20	2,872,971.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	26,795	37.15	995,434.25	
	AVOLTA AG	58,100	36.88	2,142,728.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	1,816	1,550.00	2,814,800.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	516	10,670.00	5,505,720.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	69	108,800.00	7,507,200.00	
	NESTLE SA-REG	1,563,664	98.34	153,770,717.76	
	ALCON INC	284,677	81.94	23,326,433.38	
	SONOVA HOLDING AG-REG	30,986	289.30	8,964,249.80	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	65,136	118.00	7,686,048.00	
	BACHEM HOLDING AG	12,632	79.05	998,559.60	
	LONZA GROUP AG-REG	42,468	506.40	21,505,795.20	
	NOVARTIS AG-REG	1,157,033	94.99	109,906,564.67	
	ROCHE HOLDING AG-BR	17,136	265.40	4,547,894.40	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	413,786	238.10	98,522,446.60	

	SANDOZ GROUP AG	237,909	31.65	7,529,819.85	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	14,828	95.80	1,420,522.40	
	JULIUS BAER GROUP LTD	123,773	51.50	6,374,309.50	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	13,341	1,184.00	15,795,744.00	
	UBS GROUP AG-REG	1,930,590	28.38	54,790,144.20	
	BALOISE HOLDING AG - REG	24,788	154.90	3,839,661.20	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	20,883	120.40	2,514,313.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	17,162	640.60	10,993,977.20	
	SWISS RE AG	175,000	113.10	19,792,500.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	86,172	478.90	41,267,770.80	
	TEMENOS AG - REG	34,525	58.40	2,016,260.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	89,920	90.74	8,159,340.80	
	SWISSCOM AG-REG	15,056	507.50	7,640,920.00	
	BKW AG	9,300	144.80	1,346,640.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	41,126	84.60	3,479,259.60	
	スイスフラン 小計	8,757,275		860,234,410.78 (150,549,624,230)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,515,868	38.85	58,891,471.80	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	787,000	99.80	78,542,600.00	
	MTR CORP	1,006,500	26.15	26,319,975.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	622,000	21.10	13,124,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,163,000	40.45	47,043,350.00	
	SANDS CHINA LTD	1,265,600	18.60	23,540,160.00	
	WH GROUP LTD	3,953,000	5.37	21,227,610.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,992,000	24.75	49,302,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	496,100	109.50	54,322,950.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	726,800	273.00	198,416,400.00	
	AIA GROUP LTD	6,675,200	59.05	394,170,560.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	2,189,000	8.69	19,022,410.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	453,000	44.80	20,294,400.00	
	CLP HOLDINGS LTD	855,000	64.80	55,404,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	5,821,348	5.90	34,345,953.20	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	675,500	43.85	29,620,675.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	1,381,368	30.60	42,269,860.80	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	965,641	22.95	22,161,460.95	
	SINO LAND CO	1,773,400	8.37	14,843,358.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	935,500	75.00	70,162,500.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	221,500	68.75	15,228,125.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	500,800	14.04	7,031,232.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	527,000	23.20	12,226,400.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,110,000	22.50	24,975,000.00	
		37,612,125		1,332,486,651.75	

香港ドル 小計				(26,583,108,702)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	801,600	6.65	5,330,640.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	754,200	4.09	3,084,678.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	860,940	6.81	5,863,001.40	
	GENTING SINGAPORE LTD	2,772,500	0.88	2,453,662.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	897,000	3.10	2,780,700.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,171,530	35.50	41,589,315.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,943,900	14.30	27,797,770.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	738,300	30.77	22,717,491.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	666,800	9.73	6,487,964.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	5,128,060	2.53	12,973,991.80	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	748,700	5.06	3,788,422.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	1,432,100	2.63	3,766,423.00	
シンガポールドル 小計		17,915,630		138,634,058.70 (16,057,983,019)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	743,217	7.80	5,797,092.60	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	313,297	30.50	9,555,558.50	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	1,073,324	4.05	4,346,962.20	
	MERCURY NZ LTD	288,052	6.80	1,958,753.60	
	MERIDIAN ENERGY LTD	765,945	6.47	4,959,493.87	
ニュージーランドドル 小計		3,183,835		26,617,860.77 (2,569,688,278)	
スウェーデンクローネ	BOLIDEN AB	178,730	355.00	63,449,150.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	33,017	430.00	14,197,310.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	384,247	156.80	60,249,929.60	
	ALFA LAVAL AB	159,289	480.00	76,458,720.00	
	ASSA ABLOY AB-B	600,345	306.60	184,065,777.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	1,580,116	201.80	318,867,408.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	859,982	173.90	149,550,869.80	
	BEIJER REF AB	222,900	163.60	36,466,440.00	
	EPIROC AB-A	411,012	217.30	89,312,907.60	
	EPIROC AB-B	210,487	197.70	41,613,279.90	
	HUSQVARNA AB-B SHS	159,232	84.46	13,448,734.72	
	INDUTRADE AB	150,700	272.20	41,020,540.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	143,545	294.10	42,216,584.50	
	LIFCO AB-B SHS	130,200	284.00	36,976,800.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	964,700	51.60	49,778,520.00	
	SAAB AB-B	160,400	248.90	39,923,560.00	
	SANDVIK AB	641,798	224.20	143,891,111.60	
	SKANSKA AB-B SHS	209,707	185.90	38,984,531.30	
	SKF AB-B SHARES	208,393	225.80	47,055,139.40	
	TRELLEBORG AB-B SHS	143,031	414.60	59,300,652.60	

	VOLVO AB-A SHS	129,112	291.60	37,649,059.20	
	VOLVO AB-B SHS	920,911	285.90	263,288,454.90	
	SECURITAS AB-B SHS	235,929	110.30	26,022,968.70	
	VOLVO CAR AB-B	442,279	35.32	15,621,294.28	
	EVOLUTION AB	104,162	1,133.00	118,015,546.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	375,134	184.30	69,137,196.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	363,596	280.80	102,097,756.80	
	GETINGE AB-B SHS	131,116	186.70	24,479,357.20	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	93,763	288.60	27,060,001.80	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	907,944	149.60	135,828,422.40	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	803,955	98.56	79,237,804.80	
	SWEDBANK AB - A SHARES	487,581	214.80	104,732,398.80	
	EQT AB	212,742	324.80	69,098,601.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	91,454	370.60	33,892,852.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	89,196	367.80	32,806,288.80	
	INVESTOR AB-B SHS	1,013,030	287.20	290,942,216.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	43,685	536.50	23,437,002.50	
	ERICSSON LM-B SHS	1,531,407	65.80	100,766,580.60	
	HEXAGON AB-B SHS	1,187,146	117.10	139,014,796.60	
	TELE2 AB-B SHS	367,709	104.00	38,241,736.00	
	TELIA CO AB	1,284,253	27.35	35,124,319.55	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	459,633	73.40	33,737,062.20	
	SAGAX AB-B	105,140	281.40	29,586,396.00	
	スウェーデンクローネ 小計	18,932,708		3,376,646,080.15 (50,683,457,663)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	166,028	256.40	42,569,579.20	
	EQUINOR ASA	542,080	294.30	159,534,144.00	
	NORSK HYDRO ASA	701,222	68.76	48,216,024.72	
	YARA INTERNATIONAL ASA	83,488	312.10	26,056,604.80	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	46,700	905.00	42,263,500.00	
	MOWI ASA	251,136	187.40	47,062,886.40	
	ORKLA ASA	493,828	87.15	43,037,110.20	
	SALMAR ASA	40,591	626.50	25,430,261.50	
	DNB BANK ASA	533,264	203.80	108,679,203.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	114,704	185.60	21,289,062.40	
	TELENOR ASA	333,379	126.00	42,005,754.00	
	ノルウェークローネ 小計	3,306,420		606,144,130.42 (8,940,625,923)	
デンマークク ローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	211,746	419.90	88,912,145.40	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	6,061	2,872.00	17,407,192.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	591,405	191.10	113,017,495.50	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1,724	11,780.00	20,308,720.00	

	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	2,834	12,010.00	34,036,340.00	
	DSV A/S	100,380	1,103.00	110,719,140.00	
	PANDORA A/S	44,829	1,094.50	49,065,340.50	
	CARLSBERG AS-B	58,566	970.60	56,844,159.60	
	COLOPLAST-B	70,770	829.60	58,710,792.00	
	DEMANT A/S	60,610	332.20	20,134,642.00	
	GENMAB A/S	39,585	1,940.50	76,814,692.50	
	NOVO NORDISK A/S-B	1,911,267	973.30	1,860,236,171.10	
	DANSKE BANK A/S	406,811	209.70	85,308,266.70	
	TRYG A/S	186,282	144.80	26,973,633.60	
	ORSTED A/S	116,437	398.80	46,435,075.60	
	デンマーククローネ 小計	3,809,307		2,664,923,806.50 (60,627,016,597)	
イスラエルシェケル	ICL GROUP LTD	547,223	17.09	9,352,041.07	
	ELBIT SYSTEMS LTD	14,469	687.70	9,950,331.30	
	BANK HAPOLIM BM	758,702	33.15	25,150,971.30	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	900,703	30.60	27,561,511.80	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	759,946	18.66	14,180,592.36	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	107,140	131.00	14,035,340.00	
	NICE LTD	32,481	624.30	20,277,888.30	
	AZRIELI GROUP LTD	14,806	224.50	3,323,947.00	
	イスラエルシェケル 小計	3,135,470		123,832,623.13 (5,165,417,825)	
ユーロ	ENI SPA	1,279,529	14.07	18,002,973.03	
	GALP ENERGIA SGPS SA	244,234	19.15	4,677,081.10	
	NESTE OYJ	240,492	18.82	4,527,261.90	
	OMV AG	76,362	41.12	3,140,005.44	
	REPSOL SA	739,311	14.56	10,768,064.71	
	TENARIS SA	260,856	14.82	3,865,885.92	
	TOTALENERGIES SE	1,255,578	64.97	81,574,902.66	
	AIR LIQUIDE SA	309,298	185.50	57,374,779.00	
	AKZO NOBEL N.V.	91,917	62.32	5,728,267.44	
	ARCELORMITTAL	310,796	23.55	7,319,245.80	
	ARKEMA	35,633	90.45	3,223,004.85	
	BASF SE	523,118	46.98	24,576,083.64	
	COVESTRO AG	104,095	47.20	4,913,284.00	
	DSM-FIRMENICH AG	109,408	101.70	11,126,793.60	
	EVONIK INDUSTRIES AG	123,314	18.58	2,291,174.12	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	73,831	95.12	7,022,804.72	
	OCI NV	80,550	24.92	2,007,306.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	162,088	44.14	7,154,564.32	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	298,391	12.89	3,847,751.94	

SYENSQO SA	37,756	91.26	3,445,612.56
SYMRISE AG	82,005	109.70	8,995,948.50
UMICORE	118,677	16.74	1,986,652.98
UPM-KYMMENE OYJ	311,739	34.23	10,670,825.97
VOESTALPINE AG	62,408	26.38	1,646,323.04
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	129,451	40.94	5,299,723.94
AIRBUS SE	345,747	153.52	53,079,079.44
ALSTOM	192,488	17.98	3,460,934.24
BOUYGUES SA	103,648	35.45	3,674,321.60
BRENTAG SE	71,852	64.76	4,653,135.52
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	271,506	80.56	21,872,523.36
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	297,944	40.08	11,941,595.52
DASSAULT AVIATION SA	9,266	193.20	1,790,191.20
EIFFAGE	38,587	101.85	3,930,085.95
FERROVIAL SE	303,733	36.54	11,098,403.82
GEA GROUP AG	88,362	37.22	3,288,833.64
IMCD NV	29,880	140.25	4,190,670.00
KINGSPAN GROUP PLC	92,479	86.55	8,004,057.45
KNORR-BREMSE AG	40,814	71.25	2,907,997.50
KONE OYJ-B	208,302	46.95	9,779,778.90
LEGRAND SA	149,051	98.70	14,711,333.70
LEONARDO SPA	240,845	23.74	5,717,660.30
METSO CORP	358,750	10.82	3,883,468.75
MTU AERO ENGINES AG	33,898	228.70	7,752,472.60
PRYSMIAN SPA	162,614	59.04	9,600,730.56
RATIONAL AG	3,372	818.00	2,758,296.00
REXEL SA	122,383	27.08	3,314,131.64
RHEINMETALL AG	26,370	523.80	13,812,606.00
SAFRAN SA	198,070	210.90	41,772,963.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	319,991	228.75	73,197,941.25
SIEMENS AG-REG	446,573	175.68	78,453,944.64
SIEMENS ENERGY AG	366,520	23.22	8,510,594.40
THALES SA	52,989	171.50	9,087,613.50
VINCI SA	289,310	113.70	32,894,547.00
WARTSILA OYJ ABP	296,181	19.25	5,701,484.25
BUREAU VERITAS SA	201,388	28.32	5,703,308.16
RANDSTAD NV	52,875	48.01	2,538,528.75
TELEPERFORMANCE	29,501	103.65	3,057,778.65
WOLTERS KLUWER	142,806	150.35	21,470,882.10
ADP	17,115	132.40	2,266,026.00
AENA SME SA	46,423	182.60	8,476,839.80
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	338,250	6.34	2,145,858.00

DHL GROUP	568,735	39.72	22,590,154.20
GETLINK SE	172,576	16.63	2,869,938.88
INPOST SA	141,398	16.66	2,355,690.68
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	176,648	91.50	16,163,292.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	40,076	86.80	3,478,596.80
CONTINENTAL AG	69,435	61.50	4,270,252.50
DR ING HC F PORSCHE AG	58,770	75.82	4,455,941.40
FERRARI NV	72,165	388.20	28,014,453.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	477,813	65.78	31,430,539.14
MICHELIN (CGDE)	413,033	37.61	15,534,171.13
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	83,301	50.08	4,171,714.08
RENAULT SA	114,124	51.92	5,925,318.08
STELLANTIS NV	1,314,822	20.31	26,704,034.82
VOLKSWAGEN AG	19,218	125.90	2,419,546.20
VOLKSWAGEN AG-PREF	117,861	113.45	13,371,330.45
ADIDAS AG	95,351	231.20	22,045,151.20
HERMES INTERNATIONAL	18,560	2,210.00	41,017,600.00
KERING	45,475	325.95	14,822,576.25
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	161,892	762.70	123,475,028.40
MONCLER SPA	121,056	62.00	7,505,472.00
PUMA SE	70,653	47.56	3,360,256.68
SEB SA	9,694	111.70	1,082,819.80
ACCOR SA	103,418	39.12	4,045,712.16
AMADEUS IT GROUP SA	254,821	67.66	17,241,188.86
DELIVERY HERO SE	104,269	28.66	2,988,349.54
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	68,879	33.32	2,295,048.28
SODEXO SA	58,085	89.00	5,169,565.00
BOLLORE SE	416,392	6.32	2,631,597.44
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	42,374	80.45	3,408,988.30
PUBLICIS GROUPE	129,210	102.60	13,256,946.00
SCOUT24 SE	41,543	71.75	2,980,710.25
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	492,346	28.64	14,100,789.44
VIVENDI SE	404,329	10.08	4,077,657.96
D'IETEREN GROUP	13,308	200.20	2,664,261.60
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	619,831	45.99	28,506,027.69
PROSUS NV	841,775	34.19	28,780,287.25
ZALANDO SE	125,157	24.15	3,022,541.55
CARREFOUR SA	330,839	14.93	4,941,080.46
JERONIMO MARTINS	169,984	20.18	3,430,277.12
KESKO OYJ-B SHS	133,348	16.30	2,174,239.14
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	548,403	28.15	15,437,544.45
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	525,247	58.30	30,621,900.10

DANONE	383,632	59.86	22,964,211.52
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	367,895	9.69	3,565,638.34
HEINEKEN HOLDING NV	79,993	76.90	6,151,461.70
HEINEKEN NV	170,653	94.66	16,154,012.98
JDE PEET'S NV	53,600	20.76	1,112,736.00
KERRY GROUP PLC-A	86,856	77.75	6,753,054.00
LOTUS BAKERIES	279	10,080.00	2,812,320.00
PERNOD RICARD SA	121,189	139.45	16,899,806.05
REMY COINTREAU	9,646	83.35	803,994.10
BEIERSDORF AG	56,324	142.95	8,051,515.80
HENKEL AG & CO KGAA	57,972	74.35	4,310,218.20
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	102,673	84.06	8,630,692.38
L'OREAL	139,896	456.15	63,813,560.40
AMPLIFON SPA	68,691	33.69	2,314,199.79
BIOMERIEUX	22,555	95.50	2,154,002.50
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	22,646	85.45	1,935,100.70
DIASORIN SPA	9,103	100.70	916,672.10
ESSILORLUXOTTICA	174,801	207.80	36,323,647.80
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	102,446	39.39	4,035,347.94
FRESENIUS SE & CO KGAA	246,854	30.36	7,494,487.44
KONINKLIJKE PHILIPS NV	460,335	24.20	11,140,107.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	167,713	55.06	9,234,277.78
ARGENX SE	34,568	352.80	12,195,590.40
BAYER AG-REG	595,741	28.38	16,910,108.28
EUROFINS SCIENTIFIC	69,815	54.80	3,825,862.00
GRIFOLS SA	126,564	9.35	1,184,132.78
IPSEN	21,710	122.80	2,665,988.00
MERCK KGAA	78,124	171.90	13,429,515.60
ORION OYJ-CLASS B	50,154	38.84	1,947,981.36
QIAGEN N.V.	131,652	41.11	5,412,871.98
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	58,531	49.24	2,882,066.44
SANOFI	671,454	91.01	61,109,028.54
SARTORIUS AG-VORZUG	12,941	249.90	3,233,955.90
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	13,983	186.35	2,605,732.05
UCB SA	76,947	129.90	9,995,415.30
ABN AMRO BANK NV-CVA	290,262	15.80	4,586,139.60
AIB GROUP PLC	865,126	5.11	4,425,119.49
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,438,230	9.79	33,687,777.54
BANCO BPM SPA	723,370	6.49	4,694,671.30
BANCO DE SABADELL SA	3,266,886	1.89	6,198,916.18
BANCO SANTANDER SA	9,292,565	4.74	44,079,282.07
BANK OF IRELAND GROUP PLC	639,461	10.05	6,426,583.05

BNP PARIBAS	608,318	66.85	40,666,058.30
CAIXABANK SA	2,212,480	5.21	11,527,020.80
COMMERZBANK AG	626,119	15.28	9,570,228.91
CREDIT AGRICOLE SA	617,427	14.60	9,017,521.33
ERSTE GROUP BANK AG	202,525	45.17	9,148,054.25
FINECOBANK SPA	326,073	14.86	4,845,444.78
ING GROEP NV	1,908,807	16.34	31,189,906.38
INTESA SANPAOLO	8,401,099	3.60	30,252,357.49
KBC GROUP NV	152,074	66.12	10,055,132.88
MEDIOBANCA SPA	298,281	14.37	4,287,789.37
NORDEA BANK ABP	1,857,374	11.39	21,164,776.73
SOCIETE GENERALE SA	437,480	26.01	11,378,854.80
UNICREDIT SPA	885,372	36.50	32,316,078.00
ADYEN NV	12,973	1,231.80	15,980,141.40
AMUNDI SA	42,569	66.70	2,839,352.30
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	1,095,593	15.26	16,723,131.55
DEUTSCHE BOERSE AG	108,813	188.50	20,511,250.50
EDENRED	146,617	46.22	6,776,637.74
EURAZEO SE	19,619	79.05	1,550,881.95
EURONEXT NV	49,351	93.15	4,597,045.65
EXOR NV	61,120	100.70	6,154,784.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	58,617	69.95	4,100,259.15
NEXI SPA	338,814	6.19	2,099,291.54
SOFINA	9,693	221.00	2,142,153.00
AEGON LTD	856,692	5.94	5,092,177.24
AGEAS	85,112	43.86	3,733,012.32
ALLIANZ SE-REG	230,351	263.90	60,789,628.90
ASR NEDERLAND NV	95,241	45.67	4,349,656.47
ASSICURAZIONI GENERALI	617,515	23.94	14,783,309.10
AXA SA	1,072,568	33.41	35,834,496.88
HANNOVER RUECK SE	33,983	234.80	7,979,208.40
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	78,575	462.70	36,356,652.50
NN GROUP NV	160,370	42.69	6,846,195.30
POSTE ITALIANE SPA	269,406	12.79	3,445,702.74
SAMPO OYJ-A SHS	268,909	40.35	10,850,478.15
TALANX AG	40,850	75.50	3,084,175.00
BECHTLE AG	39,938	46.30	1,849,129.40
CAPGEMINI SE	93,378	193.50	18,068,643.00
DASSAULT SYSTEMES SE	392,835	37.66	14,794,166.10
NEMETSCHEK SE	32,589	96.90	3,157,874.10
SAP SE	612,522	177.72	108,857,409.84
NOKIA OYJ	3,149,790	3.62	11,425,863.22

CELLNEX TELECOM SA	275,682	34.48	9,505,515.36
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,899,005	22.63	42,974,483.15
ELISA OYJ	88,430	43.60	3,855,548.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	180,053	10.03	1,805,931.59
KONINKLIJKE KPN NV	2,412,828	3.50	8,464,200.62
ORANGE	1,094,314	10.49	11,479,353.86
TELECOM ITALIA SPA	3,630,827	0.23	868,856.90
TELEFONICA SA	2,783,952	4.41	12,293,932.03
ACCIONA SA	13,178	119.00	1,568,182.00
E.ON SE	1,354,815	12.57	17,030,024.55
EDP RENOVAVEIS SA	231,965	14.67	3,402,926.55
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,709,490	3.77	6,444,777.30
ELIA GROUP SA/NV	17,969	95.45	1,715,141.05
ENDESA SA	199,107	18.70	3,724,296.43
ENEL SPA	4,780,882	6.79	32,500,435.83
ENGIE	1,087,360	15.44	16,794,275.20
FORTUM OYJ	254,538	13.95	3,552,077.79
IBERDROLA SA	3,424,842	12.33	42,228,301.86
REDEIA CORP SA	220,809	16.98	3,749,336.82
RWE AG	362,247	34.87	12,631,552.89
SNAM SPA	1,319,110	4.46	5,891,145.26
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	888,343	7.79	6,925,522.02
VEOLIA ENVIRONNEMENT	396,328	31.51	12,488,295.28
VERBUND AG	48,497	76.50	3,710,020.50
ASM INTERNATIONAL NV	26,424	675.20	17,841,484.80
ASML HOLDING NV	233,926	957.50	223,984,145.00
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	46,282	143.65	6,648,409.30
INFINEON TECHNOLOGIES AG	747,933	36.66	27,419,223.78
STMICROELECTRONICS NV	406,101	41.22	16,739,483.22
LEG IMMOBILIEN SE	41,849	80.52	3,369,681.48
VONOVIA SE	431,666	28.76	12,414,714.16
ユーロ 小計	105,417,354		3,097,806,537.07 (525,666,791,275)
合 計	622,318,069		5,545,782,585,018 (5,545,782,585,018)

(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	11,560,327.87	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	170,912	6,113,522.24	

		AMERICAN TOWER CORP	275,177	54,895,059.73	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	80,057	15,872,901.39	
		BOSTON PROPERTIES INC	93,232	5,671,302.56	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	68,399	7,317,325.02	
		CROWN CASTLE INC	250,133	25,423,518.12	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	185,074	27,228,086.88	
		EQUINIX INC	56,079	42,778,743.57	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	94,973	6,059,277.40	
		EQUITY RESIDENTIAL	205,240	13,396,014.80	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	37,480	10,056,633.60	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	122,615	18,205,875.20	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	175,988	7,891,301.92	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	437,815	8,550,526.95	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	453,144	8,147,529.12	
		INVITATION HOMES INC	353,860	12,335,559.60	
		IRON MOUNTAIN INC	164,114	13,923,431.76	
		KIMCO REALTY CORP	388,713	7,389,434.13	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	74,228	10,175,916.52	
		PROLOGIS INC	546,942	60,169,089.42	
		PUBLIC STORAGE	91,236	25,193,909.04	
		REALTY INCOME CORP	516,514	28,026,049.64	
		REGENCY CENTERS CORP	92,410	5,681,366.80	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	60,761	11,870,876.57	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	194,193	29,862,999.54	
		SUN COMMUNITIES INC	75,315	8,942,903.10	
		UDR INC	183,019	7,247,552.40	
		VENTAS INC	240,064	11,964,789.76	
		VICI PROPERTIES INC	591,962	16,835,399.28	
		WELLTOWER INC	330,877	34,626,278.05	
		WEYERHAEUSER CO	413,253	12,298,409.28	
WP CAREY INC	115,948	6,701,794.40			
アメリカドル合計			7,239,034	572,413,705.66 (89,187,779,478)	
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	36,100	1,633,525.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	58,600	1,032,532.00	
カナダドル合計			94,700	2,666,057.00 (303,930,498)	
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS/AU	603,939	4,209,454.83	
		GOODMAN GROUP	965,604	33,873,388.32	
		GPT GROUP	1,535,318	6,647,926.94	
		MIRVAC GROUP	2,214,980	4,418,885.10	
		SCENTRE GROUP	3,534,724	11,381,811.28	

有価証券報告書（内国投資信託）

		STOCKLAND	1,319,965	6,058,639.35	
		VICINITY CENTRES	1,843,215	3,548,188.87	
オーストラリアドル合計			12,017,745	70,138,294.69 (7,288,070,201)	
イギリス ポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	352,124	2,320,497.16	
		SEGRO PLC	726,973	6,739,039.71	
イギリスポンド合計			1,079,097	9,059,536.87 (1,805,565,698)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	1,336,000	45,557,600.00	
香港ドル合計			1,336,000	45,557,600.00 (908,874,120)	
シンガ ポールド ル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	2,228,300	5,927,278.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	2,977,171	5,924,570.29	
シンガポールドル合計			5,205,471	11,851,848.29 (1,372,799,587)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	26,523	1,311,827.58	
		GECINA SA	24,517	2,483,572.10	
		KLEPIERRE	129,417	3,494,259.00	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE	64,908	5,203,025.28	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	98,953	2,638,086.98	
ユーロ合計			344,318	15,130,770.94 (2,567,540,520)	
合計				103,434,560,102 (103,434,560,102)	

(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 581銘柄	97.91%	—	74.10%
	投資証券 33銘柄	—	2.09%	1.58%
カナダドル	株式 85銘柄	99.83%	—	3.17%
	投資証券 2銘柄	—	0.17%	0.01%
オーストラリアドル	株式 51銘柄	93.56%	—	1.88%
	投資証券 7銘柄	—	6.44%	0.13%
イギリスポンド	株式 77銘柄	99.21%	—	4.04%
	投資証券 2銘柄	—	0.79%	0.03%
スイスフラン	株式 45銘柄	100.00%	—	2.66%
香港ドル	株式 24銘柄	96.69%	—	0.47%
	投資証券 1銘柄	—	3.31%	0.02%
シンガポールドル	株式 12銘柄	92.12%	—	0.28%
	投資証券 2銘柄	—	7.88%	0.02%

ニュージーランドドル	株式	5銘柄	100.00%	—	0.05%
スウェーデンクローネ	株式	43銘柄	100.00%	—	0.90%
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%	—	1.07%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.00%	—	0.09%
ユーロ	株式	218銘柄	99.51%	—	9.31%
	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。

新興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 6月 8日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	22,059,337,672
コール・ローン	1,627,499,858
株式	826,744,306,024
投資証券	899,852,519
派生商品評価勘定	172,558,458
未収入金	8,403,409
未収配当金	1,373,621,989
未収利息	2,862
差入委託証拠金	5,761,831,175
流動資産合計	858,647,413,966
資産合計	858,647,413,966
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	177,035,536
未払金	12,251,464,883
未払解約金	122,805,570
流動負債合計	12,551,305,989
負債合計	12,551,305,989
純資産の部	
元本等	
元本	212,623,260,084
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	633,472,847,893
元本等合計	846,096,107,977
純資産合計	846,096,107,977
負債純資産合計	858,647,413,966

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。なお、ロシア株式（ＤＲ（預託証券））を含みます。以下、同じ。）の評価については、「重要な会計上の見積りに関する注記」に記載しております。 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）

1. ロシア株式（以下、「当該株式」）の時価の算定

（1）当期の財務諸表に計上した金額

当該株式の評価額0円（2022年3月11日評価額1,506,109,929円（保有割合0.55%））

（2）会計上の見積りの内容について財務諸表利用者の理解に資するその他の情報

当期の財務諸表に計上した金額の算出方法及び算出に用いた主要な仮定

2022年2月24日以降、ロシアのウクライナ侵攻を受けた米欧の経済制裁やそれに対抗措置をロシアが設けたことにより、取引の規制、決済機構やS W I F Tからの除外による取引後の受渡が行えない状況となり、市場でのロシア関連資産の取引が成立しない状況となりました。このため、組入株式の時価については金融商品取引所等における最終相場で評価していますが、当該株式の取引停止等に伴い、取引停止日以降の最終相場の価格が入手できない状況となりました。当該株式のロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引についても、実現が困難な状況となっております。

時価の算定に関する会計基準に基づきますと、組入有価証券に係る時価は秩序ある取引が行われると想定した場合の出口価格である必要があり、上記状況を総合的に勘案した結果、当ファンドが組み入れている当該株式において、2022年3月14日付けで評価額をゼロとすることとし、期末日時点においても当該取り扱いを継続しております。

なお、2022年3月24日にモスクワ証券取引所は一部取引を再開しておりますが、ロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引について、実現が困難な状況に変わりありません。

翌期の財務諸表への影響

今後、当該株式のロシア国外の投資家による取引の再開、市場の流動性の回復、最終相場価格の提供再開、ならびに当該株式に係る証券決済や為替取引の実現等の変化があれば、状況を総合的に判断の上、その評価額をゼロから回復させる可能性もあります。

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 6月 8日現在]
1. 期首	2023年12月 9日
期首元本額	165,349,936,764円
期中追加設定元本額	51,166,063,677円
期中一部解約元本額	3,892,740,357円
元本の内訳	
MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信	1,381,285,274円
eMAXIS 新興国株式インデックス	10,226,032,007円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,657,896,166円
eMAXIS バランス（波乗り型）	372,197,767円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	582,879,515円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	8,916,090,032円
eMAXIS Slim 新興国株式インデックス	41,035,720,871円
つみたて新興国株式	9,032,989,036円
つみたて8資産均等バランス	4,445,552,833円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	569,045円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,394,287円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	7,136,743円
eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）	13,710,936,153円
eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）	1,326,177,058円
eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）	89,840,969,046円
新興国株式インデックス・オープン（ラップ向け）	3,412,519,456円
つみたて全世界株式	670,618,033円
ラップ向けインデックスf 新興国株式	1,043,654,684円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）	47,918,887円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）	1,536,855,499円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）	1,392,770,516円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	17,188,809,800円
新興国株式インデックスオープン	422,776,436円
eMAXIS 全世界株式インデックス	1,472,570,459円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	309,966,469円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	33,776,300円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	211,657,285円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	230,648,311円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	906,868,043円

	[2024年 6月 8日現在]
MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	900,688,271円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	19,091,244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）	32,115,223円
グローバルバランスオープンV（適格機関投資家限定）	307,204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）	8,997,101円
MUKAM バランスファンド2019-12（適格機関投資家限定）	52,048,803円
MUKAM バランスファンド2020-07（適格機関投資家限定）	51,685,373円
MUKAM バランスファンド2020-10（適格機関投資家限定）	51,436,075円
MUKAM バランスファンド2021-03（適格機関投資家限定）	45,518,639円
MUKAM バランスファンド2021-06（適格機関投資家限定）	42,136,140円
合計	212,623,260,084円
2. 受益権の総数	212,623,260,084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12月 9日 至 2024年 6月 8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。 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 6月 8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 6月 8日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

株式	3,529,876,589
投資証券	6,425,985
合計	3,523,450,604

(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 6月 8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	20,250,410,682	—	20,234,518,841	15,891,841
合計		20,250,410,682	—	20,234,518,841	15,891,841

（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ではありません。

通貨関連

[2024年 6月 8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	1,584,383,505	—	1,584,316,879	66,626
	韓国ウォン	1,016,370,000	—	1,030,500,000	14,130,000
	クウェートディナール	492,899,958	—	491,124,615	1,775,343
	南アフリカランド	442,161,498	—	441,151,825	1,009,673
	売建				
	アメリカドル	492,899,958	—	492,768,332	131,626
	オフショア元	10,052,283	—	10,047,504	4,779
合計		4,038,767,202	—	4,049,909,155	11,414,763

（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ではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[2024年 6月 8日現在]
1口当たり純資産額	3.9793円
(1万口当たり純資産額)	(39,793円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM PJSC	3,587,358	—	—	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	535,200	1.79	962,824.80	
	LUKOIL PJSC	122,600	—	—	
	NOVATEK PJSC	282,700	—	—	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	384,962	—	—	
	SURGUTNEFTEGAS PJSC	2,405,300	—	—	
	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	2,315,000	—	—	
	TATNEFT PJSC	455,759	—	—	
	ALROSA PJSC	745,960	—	—	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	130,323	17.63	2,297,594.49	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC	1,948,300	—	—	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC	439,080	—	—	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	53,979	—	—	
	POLYUS PJSC	10,871	—	—	
	SEVERSTAL PJSC	62,882	—	—	
	SOUTHERN COPPER CORP	55,180	113.86	6,282,794.80	
	UNITED CO RUSAL INTERNATIONAL	1,071,810	—	—	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	299,915	23.85	7,152,972.75	
	NIO INC - ADR	1,146,896	4.91	5,631,259.36	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	163,551	36.07	5,899,284.57	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	267,204	11.07	2,957,948.28	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	295,191	35.60	10,508,799.60	
	AUTOHOME INC-ADR	38,791	28.65	1,111,362.15	
	IQIYI INC-ADR	241,668	4.28	1,034,339.04	
	KANZHUN LTD - ADR	211,779	21.93	4,644,313.47	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	551,027	14.55	8,017,442.85	
	YANDEX NV-A	92,564	—	—	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	20,405	—	—	
	PDD HOLDINGS INC	427,523	143.83	61,490,633.09	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	292,796	16.30	4,772,574.80	
	MAGNIT PJSC	23,556	—	—	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	34,286	—	—	

	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	48,700	46.56	2,267,472.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	3,442,213	1.59	5,500,656.37	
	CREDICORP LTD	48,599	163.07	7,925,038.93	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	796,628	—	—	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	38,258	—	—	
	VTB BANK PJSC	1,305,990,000	—	—	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	425,170	—	—	
	QIFU TECHNOLOGY INC	102,000	20.16	2,056,320.00	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	580,572	2.09	1,216,298.34	
	VK IPJSC	34,689	—	—	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	172,850	—	—	
	INTER RAO UES PJSC	12,239,000	—	—	
	KE HOLDINGS INC-ADR	468,562	16.22	7,600,075.64	
	アメリカドル 小計	1,343,101,657		149,330,005.33 (23,267,108,130)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	1,149,000	9.70	11,145,300.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	1,104,000	7.75	8,556,000.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	17,774,000	4.91	87,270,340.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	2,292,500	39.25	89,980,625.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	628,000	11.36	7,134,080.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	15,705,000	7.81	122,656,050.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	1,821,000	18.02	32,814,420.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	3,426,000	5.69	19,493,940.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	911,500	17.98	16,388,770.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	2,329,500	12.88	30,003,960.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	4,674,000	3.04	14,208,960.00	
	CMOC GROUP LTD-H	2,154,000	7.19	15,487,260.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H	185,120	21.10	3,906,032.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	679,000	16.36	11,108,440.00	
	MMG LTD	3,120,000	3.29	10,264,800.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	465,250	17.18	7,992,995.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	1,549,500	14.64	22,684,680.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	3,998,000	17.04	68,125,920.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	1,247,000	3.67	4,576,490.00	
	BOC AVIATION LTD	97,300	57.70	5,614,210.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	1,132,000	4.06	4,595,920.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	2,285,000	4.39	10,031,150.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	570,000	10.82	6,167,400.00	
	CITIC LTD	4,375,000	8.07	35,306,250.00	
	CRRC CORP LTD - H	2,519,000	4.96	12,494,240.00	
	FOSUN INTERNATIONAL LTD	1,324,500	4.72	6,251,640.00	
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	339,000	24.15	8,186,850.00	

SINOTRUK HONG KONG LTD	744,000	18.78	13,972,320.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	1,303,800	14.34	18,696,492.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	268,300	29.85	8,008,755.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	788,000	12.52	9,865,760.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	2,116,600	14.60	30,902,360.00
JD LOGISTICS INC	2,120,200	8.59	18,212,518.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	806,000	8.42	6,786,520.00
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	68,000	139.70	9,499,600.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	1,034,000	5.30	5,480,200.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1,694,000	6.66	11,282,040.00
BYD CO LTD-H	697,000	229.20	159,752,400.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	508,400	45.30	23,030,520.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	3,979,000	9.81	39,033,990.00
GREAT WALL MOTOR CO LTD-H	1,278,000	12.14	15,514,920.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	1,458,945	3.18	4,639,445.10
LI AUTO INC-CLASS A	936,444	78.95	73,932,253.80
XPENG INC - CLASS A SHARES	986,124	32.75	32,295,561.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	944,000	12.56	11,856,640.00
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	289,400	27.40	7,929,560.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	890,800	87.10	77,588,680.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	2,144,000	4.63	9,926,720.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	1,487,000	30.10	44,758,700.00
HISENSE HOME APPLIANCES GR-H	349,000	34.00	11,866,000.00
LI NING CO LTD	1,506,500	20.60	31,033,900.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	601,700	81.90	49,279,230.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	1,297,000	17.68	22,930,960.00
MEITUAN-CLASS B	3,595,820	112.70	405,248,914.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	1,000,780	59.00	59,046,020.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	982,800	17.78	17,474,184.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	548,000	10.68	5,852,640.00
TRIP.COM GROUP LTD	398,329	407.40	162,279,234.60
BAIDU INC-CLASS A	1,605,324	94.65	151,943,916.60
BILIBILI INC-CLASS Z	204,835	118.40	24,252,464.00
CHINA LITERATURE LTD	220,600	26.70	5,890,020.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	2,556,000	1.97	5,035,320.00
KINGSOFT CORP LTD	568,000	26.00	14,768,000.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	1,625,800	54.05	87,874,490.00
NETEASE INC	1,417,195	147.50	209,036,262.50
TENCENT HOLDINGS LTD	4,724,000	381.60	1,802,678,400.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	11,158,200	77.10	860,297,220.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	62,300	63.10	3,931,130.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	1,480,400	9.61	14,226,644.00

JD.COM INC-CLASS A	1,680,483	117.40	197,288,704.20
MINISO GROUP HOLDING LTD	187,832	42.00	7,888,944.00
POP MART INTERNATIONAL GROUP	231,000	38.80	8,962,800.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	970,000	5.10	4,947,000.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	638,500	14.22	9,079,470.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	5,342,000	3.78	20,192,760.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	702,550	26.55	18,652,702.50
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	66,063	123.80	8,178,599.40
CHINA FEIHE LTD	2,716,000	4.00	10,864,000.00
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS	372,000	—	—
CHINA MENGNIU DAIRY CO	2,601,000	14.68	38,182,680.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	1,322,000	31.15	41,180,300.00
NONGFU SPRING CO LTD-H	1,413,600	41.80	59,088,480.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	1,128,000	8.53	9,621,840.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	1,138,000	9.94	11,311,720.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	456,000	56.75	25,878,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	3,443,000	4.69	16,147,670.00
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	286,400	51.80	14,835,520.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	483,000	26.60	12,847,800.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	324,200	34.75	11,265,950.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	2,087,200	4.50	9,392,400.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	265,300	12.08	3,204,824.00
SINOPHARM GROUP CO-H	958,400	22.10	21,180,640.00
AKESO INC	274,000	41.40	11,343,600.00
BEIGENE LTD	538,623	94.90	51,115,322.70
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	847,500	5.82	4,932,450.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	7,053,840	6.95	49,024,188.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	628,000	9.15	5,746,200.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	696,000	17.86	12,430,560.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	744,000	35.75	26,598,000.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	6,275,500	2.84	17,822,420.00
WUXI APPTec CO LTD-H	196,040	34.25	6,714,370.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2,742,000	11.56	31,697,520.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	17,552,000	3.30	57,921,600.00
BANK OF CHINA LTD-H	58,617,000	3.76	220,399,920.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	5,861,900	5.93	34,761,067.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	6,040,000	4.77	28,810,800.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	68,390,550	5.59	382,303,174.50
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	1,464,000	2.53	3,703,920.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	2,886,050	35.40	102,166,170.00
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	3,850,820	2.94	11,321,410.80
IND & COMM BK OF CHINA-H	45,147,350	4.37	197,293,919.50

POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	5,586,000	4.49	25,081,140.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	4,440,500	4.27	18,960,935.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	1,246,000	9.40	11,712,400.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	1,676,500	12.48	20,922,720.00
FAR EAST HORIZON LTD	1,246,000	6.23	7,762,580.00
GF SECURITIES CO LTD-H	442,400	7.03	3,110,072.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	1,531,200	3.83	5,864,496.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	1,048,600	9.04	9,479,344.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	5,376,000	11.32	60,856,320.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	1,814,800	21.00	38,110,800.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	723,200	8.62	6,233,984.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	445,900	16.14	7,196,826.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	8,844,000	2.70	23,878,800.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	4,994,000	9.97	49,790,180.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	4,777,000	40.55	193,707,350.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	2,354,000	8.27	19,467,580.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	383,500	25.95	9,951,825.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	439,000	37.55	16,484,450.00
LENOVO GROUP LTD	5,696,000	11.42	65,048,320.00
SUNNY OPTICAL TECH	478,400	48.95	23,417,680.00
XIAOMI CORP-CLASS B	10,998,800	17.96	197,538,448.00
ZTE CORP-H	409,531	16.88	6,912,883.28
CHINA TOWER CORP LTD-H	36,848,000	0.95	35,005,600.00
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	288,500	29.15	8,409,775.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	1,930,000	2.67	5,153,100.00
CGN POWER CO LTD-H	7,115,000	3.06	21,771,900.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,904,200	7.43	14,148,206.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	1,903,000	7.65	14,557,950.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	2,292,000	3.84	8,801,280.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	617,000	28.20	17,399,400.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	1,684,000	23.65	39,826,600.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	520,600	72.40	37,691,440.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD	2,154,000	4.46	9,606,840.00
HUANENG POWER INTL INC-H	2,348,000	5.32	12,491,360.00
KUNLUN ENERGY CO LTD	2,588,000	7.80	20,186,400.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	146,000	15.22	2,222,120.00
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	14,212,000	1.42	20,181,040.00
HANERGY THIN FILM POWER GROU	960,000	3.91	3,753,600.00
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	382,000	22.55	8,614,100.00
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	3,406,000	4.71	16,042,260.00
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	434,000	15.60	6,770,400.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	2,791,000	15.08	42,088,280.00

	CHINA RESOURCES LAND LTD	2,250,000	28.90	65,025,000.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	423,800	27.60	11,696,880.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	2,723,851	5.58	15,199,088.58	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	1,759,000	12.42	21,846,780.00	
	香港ドル 小計	555,547,749		8,346,635,576.06 (166,515,379,742)	
マレーシアリンギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	149,300	18.30	2,732,190.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	1,815,500	6.74	12,236,470.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	2,265,100	5.80	13,137,580.00	
	GAMUDA BHD	2,080,800	6.05	12,588,840.00	
	SIME DARBY BERHAD	1,697,300	2.73	4,633,629.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	554,900	9.93	5,510,157.00	
	MISC BHD	744,800	8.50	6,330,800.00	
	GENTING BHD	1,154,400	4.71	5,437,224.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	1,757,300	2.64	4,639,272.00	
	MR DIY GROUP M BHD	1,949,000	1.89	3,683,610.00	
	IOI CORP BHD	1,440,600	3.88	5,589,528.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	337,100	21.04	7,092,584.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	39,900	124.80	4,979,520.00	
	PPB GROUP BERHAD	371,240	14.66	5,442,378.40	
	QL RESOURCES BHD	521,250	6.42	3,346,425.00	
	SD GUTHRIE BHD	1,374,500	4.33	5,951,585.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	1,220,300	6.24	7,614,672.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	1,376,300	4.24	5,835,512.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	5,347,200	6.95	37,163,040.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	366,400	19.42	7,115,488.00	
	MALAYAN BANKING BHD	3,914,700	9.98	39,068,706.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	11,042,600	4.13	45,605,938.00	
	RHB BANK BHD	1,098,049	5.50	6,039,269.50	
	AXIATA GROUP BERHAD	2,339,000	2.75	6,432,250.00	
	CELCOMDIGI BHD	2,553,800	3.87	9,883,206.00	
	MAXIS BHD	1,803,400	3.65	6,582,410.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	653,000	6.29	4,107,370.00	
	PETRONAS GAS BHD	854,500	18.28	15,620,260.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	2,050,300	13.70	28,089,110.00	
	YTL CORP BHD	2,972,300	3.62	10,759,726.00	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	2,094,100	5.07	10,617,087.00	
	INARI AMERTRON BHD	1,618,200	3.40	5,501,880.00	
	マレーシアリンギット 小計	59,557,139		349,367,716.90 (11,586,046,658)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	1,163,100	151.50	176,209,650.00	
	PTT PCL-NVDR	7,550,400	32.00	241,612,800.00	

	THAI OIL PCL-NVDR	757,900	50.75	38,463,425.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	787,000	21.20	16,684,400.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	2,231,461	33.75	75,311,808.75	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	561,600	33.75	18,954,000.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	581,150	234.00	135,989,100.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	3,107,700	61.75	191,900,475.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	3,539,400	7.70	27,253,380.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	3,667,900	3.64	13,351,156.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,806,900	30.75	55,562,175.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	955,517	31.00	29,621,027.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	9,757,701	9.40	91,722,389.40	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	1,787,200	17.40	31,097,280.00	
	CP ALL PCL-NVDR	4,605,100	58.00	267,095,800.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	1,119,100	28.75	32,174,125.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,996,400	22.40	44,719,360.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	8,114,700	27.50	223,154,250.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	498,600	244.00	121,658,400.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	304,300	128.00	38,950,400.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	1,770,600	17.20	30,454,320.00	
	SCB X PCL-NVDR	472,000	105.00	49,560,000.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	12,000,000	1.66	19,920,000.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	493,000	45.50	22,431,500.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	2,223,500	75.50	167,874,250.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	955,100	208.00	198,660,800.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	513,100	67.00	34,377,700.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	5,276,828	8.50	44,853,038.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	943,600	21.40	20,193,040.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	372,600	43.75	16,301,250.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	2,930,800	39.75	116,499,300.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	1,146,200	57.25	65,619,950.00	
	タイバーツ 小計	83,990,457		2,658,230,549.15 (11,377,226,750)	
フィリピンペソ	AYALA CORPORATION	175,105	598.00	104,712,790.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	1,671,849	30.55	51,074,986.95	
	SM INVESTMENTS CORP	251,905	851.00	214,371,155.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	848,160	353.80	300,079,008.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	261,310	228.80	59,787,728.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	536,200	109.50	58,713,900.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	1,250,397	120.00	150,047,640.00	
	BDO UNIBANK INC	1,549,316	138.00	213,805,608.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	1,349,456	68.60	92,572,681.60	
	PLDT INC	50,855	1,434.00	72,926,070.00	

	MANILA ELECTRIC COMPANY	169,260	359.20	60,798,192.00	
	AYALA LAND INC	4,129,620	28.00	115,629,360.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	6,766,900	27.10	183,382,990.00	
	フィリピンペソ 小計	19,010,333		1,677,902,109.55 (4,460,367,177)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	9,845,800	2,850.00	28,060,530,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	1,584,200	22,575.00	35,763,315,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	3,732,100	12,150.00	45,345,015,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	3,302,400	1,315.00	4,342,656,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	13,337,270	975.00	13,003,838,250.00	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK PT	6,000,000	8,700.00	52,200,000,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	1,329,300	9,300.00	12,362,490,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	4,827,300	2,460.00	11,875,158,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	15,172,000	4,560.00	69,184,320,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	789,277,300	60.00	47,356,638,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	19,029,200	2,780.00	52,901,176,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	4,136,800	5,225.00	21,614,780,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	1,153,300	10,600.00	12,224,980,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	2,112,200	6,200.00	13,095,640,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	4,456,700	3,080.00	13,726,636,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	11,171,100	1,575.00	17,594,482,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	38,541,100	9,475.00	365,176,922,500.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	24,996,600	6,175.00	154,354,005,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	13,768,700	4,770.00	65,676,699,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	51,182,900	4,500.00	230,323,050,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	34,619,300	3,050.00	105,588,865,000.00	
	インドネシアルピア 小計	1,053,575,570		1,371,771,196,250.00 (13,169,003,484)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	10,804,968	12.41	134,089,652.88	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	2,154,870	98.99	213,310,581.30	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	102,805	258.20	26,544,251.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	673,098	26.80	18,039,026.40	
	ALFA S.A.B. -A	1,531,900	11.66	17,861,954.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	370,100	140.24	51,902,824.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	303,460	297.86	90,388,595.60	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	175,290	578.92	101,478,886.80	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	183,300	165.48	30,332,484.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	106,465	182.17	19,394,729.05	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	3,672,100	63.40	232,811,140.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	363,866	179.38	65,270,283.08	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	420,000	165.58	69,543,600.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	1,426,100	200.88	286,474,968.00	

	GRUMA S.A.B.-B	108,475	347.66	37,712,418.50	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	1,153,900	69.56	80,265,284.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	819,500	35.07	28,739,865.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	469,600	56.78	26,663,888.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	1,887,800	149.03	281,338,834.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	1,393,300	46.55	64,858,115.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER B	13,096,700	15.89	208,106,563.00	
	メキシコペソ 小計	41,217,597		2,085,127,943.61 (18,102,246,755)	
ブラジルリアル	COSAN SA	1,214,700	13.05	15,851,835.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	2,587,800	39.94	103,356,732.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	3,381,000	38.38	129,762,780.00	
	PRIO SA	598,100	40.17	24,025,677.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	593,700	22.92	13,607,604.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	421,200	12.68	5,340,816.00	
	GERDAU SA-PREF	968,520	17.28	16,736,025.60	
	KLABIN SA - UNIT	579,920	20.07	11,638,994.40	
	SUZANO SA	564,122	48.35	27,275,298.70	
	VALE SA	2,476,229	61.21	151,569,977.09	
	WEG SA	1,152,588	37.81	43,579,352.28	
	CCR SA	527,800	12.05	6,359,990.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	637,113	43.70	27,841,838.10	
	RUMO SA	1,023,000	20.50	20,971,500.00	
	LOJAS RENNER S.A.	700,422	13.38	9,371,646.36	
	VIBRA ENERGIA SA	777,600	21.04	16,360,704.00	
	ATACADAO SA	343,900	9.85	3,387,415.00	
	RAIA DROGASIL SA	971,012	25.13	24,401,531.56	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	832,500	12.28	10,223,100.00	
	AMBEV SA	3,832,900	11.82	45,304,878.00	
	BRF SA	493,000	18.44	9,090,920.00	
	JBS SA	518,300	29.17	15,118,811.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	525,900	15.33	8,062,047.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	2,830,971	4.01	11,352,193.71	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	340,500	27.37	9,319,485.00	
	HYPERA SA	379,200	29.06	11,019,552.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	1,346,737	11.57	15,581,747.09	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	3,805,586	13.05	49,662,897.30	
	BANCO DO BRASIL S.A.	1,208,800	27.65	33,423,320.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	3,387,430	31.90	108,059,017.00	
	ITAUSA SA	4,450,862	9.94	44,241,568.28	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	3,789,225	11.08	41,984,613.00	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	747,800	33.30	24,901,740.00	

	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	457,300	32.95	15,068,035.00	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	480,900	14.75	7,093,275.00	
	TOTVS SA	313,600	28.96	9,081,856.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	312,475	45.55	14,233,236.25	
	TIM SA	494,977	16.43	8,132,472.11	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	142,400	40.68	5,792,832.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	855,300	36.54	31,252,662.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	1,566,487	10.44	16,354,124.28	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	241,400	77.32	18,665,048.00	
	COMPANHIA PARANAENSE -PREF B	616,900	9.47	5,842,043.00	
	CPFL ENERGIA SA	104,700	34.25	3,585,975.00	
	ENERGISA SA-UNITS	179,600	46.91	8,425,036.00	
	ENEVA SA	483,000	12.81	6,187,230.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	96,550	44.01	4,249,165.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	811,400	29.91	24,268,974.00	
	ブラジルリアル 小計	55,165,426		1,267,017,570.61 (37,540,083,494)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	231,184	7,660.00	1,770,869,440.00	
	EMPRESAS CMPC SA	876,729	1,939.40	1,700,328,222.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	95,019	42,776.00	4,064,532,744.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	11,707,800	60.50	708,321,900.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	103,210,400	12.95	1,336,574,680.00	
	FALABELLA SA	906,636	2,900.10	2,629,335,063.00	
	CENCOSUD SA	686,091	1,789.00	1,227,416,799.00	
	BANCO DE CHILE	29,371,536	107.50	3,157,440,120.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	51,686	26,670.00	1,378,465,620.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	56,988,550	44.10	2,513,195,055.00	
	ENEL AMERICAS SA	14,141,398	90.69	1,282,483,384.00	
	ENEL CHILE SA	13,798,839	54.50	752,036,725.00	
	チリペソ 小計	232,065,868		22,520,999,752.00 (3,859,266,080)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	23,432	67,000.00	1,569,944,000.00	
	S-OIL CORP	32,311	67,400.00	2,177,761,400.00	
	SK INNOVATION CO LTD	39,280	103,600.00	4,069,408,000.00	
	ENCHEM CO LTD	9,000	294,500.00	2,650,500,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	65,451	29,450.00	1,927,531,950.00	
	HYUNDAI STEEL CO	47,819	29,800.00	1,425,006,200.00	
	KOREA ZINC CO LTD	5,353	489,000.00	2,617,617,000.00	
	KUM YANG CO LTD	18,000	85,400.00	1,537,200,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	8,081	148,100.00	1,196,796,100.00	
	LG CHEM LTD	36,326	374,500.00	13,604,087,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	4,322	254,000.00	1,097,788,000.00	

LOTTE CHEMICAL CORP	9,469	114,200.00	1,081,359,800.00	
POSCO HOLDINGS INC	52,955	381,000.00	20,175,855,000.00	
SKC CO LTD	19,823	148,000.00	2,933,804,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	32,378	54,300.00	1,758,125,400.00	
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	276,499	19,120.00	5,286,660,880.00	
ECOPRO BM CO LTD	34,249	203,000.00	6,952,547,000.00	
ECOPRO CO LTD	69,095	100,600.00	6,950,957,000.00	
ECOPRO MATERIALS CO LTD	11,600	95,500.00	1,107,800,000.00	
GS HOLDINGS	27,669	42,650.00	1,180,082,850.00	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	23,194	206,500.00	4,789,561,000.00	
HANWHA OCEAN CO LTD	37,899	28,950.00	1,097,176,050.00	
HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD	22,000	277,000.00	6,094,000,000.00	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	12,400	128,300.00	1,590,920,000.00	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	28,548	130,800.00	3,734,078,400.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	43,467	33,100.00	1,438,757,700.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	41,812	51,000.00	2,132,412,000.00	
L&F CO LTD	16,089	157,300.00	2,530,799,700.00	
LG CORP	69,138	79,600.00	5,503,384,800.00	
LG ENERGY SOLUTION	34,775	351,500.00	12,223,412,500.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	20,214	275,500.00	5,568,957,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	26,266	47,600.00	1,250,261,600.00	
SAMSUNG C&T CORP	66,756	135,100.00	9,018,735,600.00	
SAMSUNG E&A CO LTD	148,240	23,250.00	3,446,580,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	499,833	9,270.00	4,633,451,910.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	17,800	43,350.00	771,630,000.00	
SK INC	34,469	164,000.00	5,652,916,000.00	
SK SQUARE CO LTD	63,840	76,800.00	4,902,912,000.00	
HANJIN KAL CORP	24,797	66,800.00	1,656,439,600.00	
HMM CO LTD	170,430	19,090.00	3,253,508,700.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	11,173	183,600.00	2,051,362,800.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	187,559	21,800.00	4,088,786,200.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	43,655	43,550.00	1,901,175,250.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	44,441	222,000.00	9,865,902,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	92,825	264,000.00	24,505,800,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	25,562	157,600.00	4,028,571,200.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	22,291	155,600.00	3,468,479,600.00	
KIA CORP	193,532	119,500.00	23,127,074,000.00	
COWAY CO LTD	30,042	56,500.00	1,697,373,000.00	
LG ELECTRONICS INC	82,783	100,700.00	8,336,248,100.00	
HYBE CO LTD	11,933	198,500.00	2,368,700,500.00	
KAKAO CORP	216,569	44,550.00	9,648,148,950.00	
KRAFTON INC	18,966	246,000.00	4,665,636,000.00	

NAVER CORP	96,716	177,100.00	17,128,403,600.00	
NCSOFT CORP	7,497	194,900.00	1,461,165,300.00	
NETMARBLE CORP	12,296	61,200.00	752,515,200.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	8,844	339,000.00	2,998,116,000.00	
KT&G CORP	67,130	85,500.00	5,739,615,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	12,195	92,600.00	1,129,257,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	26,035	177,800.00	4,629,023,000.00	
LG H&H	5,202	410,500.00	2,135,421,000.00	
HLB INC	81,350	59,600.00	4,848,460,000.00	
ALTEOGEN INC	30,000	238,000.00	7,140,000,000.00	
CELLTRION INC	107,596	190,300.00	20,475,518,800.00	
CELLTRION PHARM INC	10,459	93,400.00	976,870,600.00	
HANMI PHARM CO LTD	3,690	294,000.00	1,084,860,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	12,838	760,000.00	9,756,880,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	17,376	85,200.00	1,480,435,200.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	14,700	52,800.00	776,160,000.00	
YUHAN CORP	48,021	79,600.00	3,822,471,600.00	
HANA FINANCIAL GROUP	199,187	59,700.00	11,891,463,900.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	195,743	13,440.00	2,630,785,920.00	
KAKAOBANK CORP	103,900	22,200.00	2,306,580,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	283,889	77,400.00	21,973,008,600.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	296,204	45,550.00	13,492,092,200.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	440,704	14,080.00	6,205,112,320.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	50,546	65,100.00	3,290,544,600.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	67,490	75,500.00	5,095,495,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	119,622	7,100.00	849,316,200.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	60,045	11,930.00	716,336,850.00	
DB INSURANCE CO LTD	26,050	104,200.00	2,714,410,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	20,215	343,500.00	6,943,852,500.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	71,405	81,200.00	5,798,086,000.00	
POSCO DX CO LTD	30,200	37,550.00	1,134,010,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	34,892	157,900.00	5,509,446,800.00	
COSMOAM&T CO LTD	12,657	164,700.00	2,084,607,900.00	
LG DISPLAY CO LTD	345,973	10,120.00	3,501,246,760.00	
LG INNOTEK CO LTD	13,661	244,000.00	3,333,284,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	44,201	151,700.00	6,705,291,700.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	3,410,955	77,400.00	264,007,917,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	594,381	62,600.00	37,208,250,600.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	39,370	391,500.00	15,413,355,000.00	
KT CORP	30,000	36,750.00	1,102,500,000.00	
LG UPLUS CORP	107,515	9,700.00	1,042,895,500.00	
SK TELECOM	31,200	51,500.00	1,606,800,000.00	

	KOREA ELECTRIC POWER CORP	145,027	20,150.00	2,922,294,050.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	32,816	155,800.00	5,112,732,800.00	
	SK HYNIX INC	385,254	193,700.00	74,623,699,800.00	
	韓国ウォン 小計	10,961,457		857,894,572,040.00 (98,228,928,498)	
ニュー台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	597,150	65.80	39,292,470.00	
	ASIA CEMENT CORP	1,312,281	40.60	53,278,608.60	
	CHINA STEEL CORP	8,401,947	23.50	197,445,754.50	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	2,277,430	50.90	115,921,187.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	2,802,600	62.40	174,882,240.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	3,598,557	50.40	181,367,272.80	
	TAIWAN CEMENT	5,570,696	32.70	182,161,759.20	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	93,000	1,000.00	93,000,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	1,512,138	33.95	51,337,085.10	
	FORTUNE ELECTRIC CO LTD	95,000	687.00	65,265,000.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	38,000	1,685.00	64,030,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	1,629,000	36.45	59,377,050.00	
	CHINA AIRLINES LTD	1,582,000	23.00	36,386,000.00	
	EVA AIRWAYS CORP	2,569,000	36.65	94,153,850.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	726,353	222.00	161,250,366.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	1,077,000	30.00	32,310,000.00	
	WAN HAI LINES LTD	322,845	96.80	31,251,396.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	1,065,000	83.70	89,140,500.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,145,413	51.80	59,332,393.40	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	100,728	524.00	52,781,472.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	344,098	150.00	51,614,700.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	132,000	364.00	48,048,000.00	
	POU CHEN	2,287,500	37.00	84,637,500.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	251,880	622.00	156,669,360.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	369,000	270.50	99,814,500.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	3,268,624	80.30	262,470,507.20	
	PHARMAESSENTIA CORP	136,000	456.00	62,016,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	2,858,387	18.25	52,165,562.75	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	11,933,955	36.85	439,766,241.75	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	9,977,067	28.85	287,838,382.95	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	8,334,648	27.50	229,202,820.00	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	7,146,109	24.85	177,580,808.65	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	7,646,703	39.30	300,515,427.90	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	8,103,405	23.35	189,214,506.75	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	8,862,716	18.60	164,846,517.60	
	TAIWAN BUSINESS BANK	6,279,448	17.10	107,378,560.80	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	8,067,572	25.60	206,529,843.20	

THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	2,848,000	45.95	130,865,600.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	1,099,275	154.00	169,288,350.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	7,102,117	31.70	225,137,108.90
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	6,383,366	57.50	367,043,545.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	12,983,255	15.10	196,047,150.50
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	5,158,556	75.20	387,923,411.20
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	12,499,852	9.38	117,248,611.76
ACCTON TECHNOLOGY CORP	319,000	544.00	173,536,000.00
ACER INC	1,664,168	50.60	84,206,900.80
ADVANTECH CO LTD	288,020	360.00	103,687,200.00
ASIA VITAL COMPONENTS	225,000	660.00	148,500,000.00
ASUSTEK COMPUTER INC	495,774	493.00	244,416,582.00
AUO CORP	4,165,800	17.45	72,693,210.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	526,000	225.00	118,350,000.00
COMPAL ELECTRONICS	2,830,775	36.35	102,898,671.25
DELTA ELECTRONICS INC	1,393,220	345.00	480,660,900.00
E INK HOLDINGS INC	689,000	215.00	148,135,000.00
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	335,000	317.50	106,362,500.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	8,804,272	177.50	1,562,758,280.00
INNOLUX CORP	5,345,461	13.40	71,629,177.40
INVENTEC CORP	2,419,429	53.70	129,923,337.30
LARGAN PRECISION CO LTD	73,820	2,390.00	176,429,800.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,320,160	106.50	140,597,040.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	432,000	186.50	80,568,000.00
PEGATRON CORP	1,231,976	111.50	137,365,324.00
QUANTA COMPUTER INC	2,015,150	279.50	563,234,425.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	874,193	83.20	72,732,857.60
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	1,082,000	187.50	202,875,000.00
WISTRON CORP	1,814,000	112.00	203,168,000.00
WIWYNN CORP	74,000	2,620.00	193,880,000.00
WPG HOLDINGS LTD	1,540,168	86.90	133,840,599.20
YAGEO CORPORATION	218,738	674.00	147,429,412.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	691,000	113.50	78,428,500.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	2,600,000	127.50	331,500,000.00
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	1,419,000	83.80	118,912,200.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,356,400	106.50	144,456,600.00
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	55,000	2,895.00	159,225,000.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	2,492,294	160.00	398,767,040.00
EMEMORY TECHNOLOGY INC	42,000	2,360.00	99,120,000.00
GLOBAL UNICHIP CORP	57,000	1,545.00	88,065,000.00
GLOBALWAFERS CO LTD	221,000	533.00	117,793,000.00
MEDIATEK INC	1,084,236	1,290.00	1,398,664,440.00

	NANYA TECHNOLOGY CORP	706,000	63.40	44,760,400.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS CORP	410,000	606.00	248,460,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	316,703	536.00	169,752,808.00	
	SILERGY CORP	288,000	457.50	131,760,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	17,577,000	894.00	15,713,838,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	7,810,000	54.20	423,302,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	473,000	105.50	49,901,500.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	1,887,000	23.90	45,099,300.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	865,141	45.05	38,974,602.05	
	ニュー台湾ドル 小計	251,117,569		31,748,486,028.11 (153,145,172,053)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	556,703	584.15	325,198,057.45	
	COAL INDIA LTD	991,773	472.95	469,059,040.35	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	358,066	515.55	184,600,926.30	
	INDIAN OIL CORP LTD	1,830,107	163.60	299,405,505.20	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	2,466,178	252.30	622,216,709.40	
	PETRONET LNG LTD	548,841	302.40	165,969,518.40	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	2,141,633	2,863.20	6,131,923,605.60	
	AMBUJA CEMENTS LTD	355,073	610.05	216,612,283.65	
	APL APOLLO TUBES LTD	93,400	1,572.10	146,834,140.00	
	ASIAN PAINTS LTD	276,360	2,904.80	802,770,528.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	191,879	2,334.75	447,989,495.25	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	940,910	677.50	637,466,525.00	
	JINDAL STAINLESS LTD	400,000	794.45	317,780,000.00	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	301,599	1,029.55	310,511,250.45	
	JSW STEEL LTD	411,469	888.10	365,425,618.90	
	NMDC LTD	859,046	252.20	216,651,401.20	
	PI INDUSTRIES LTD	56,131	3,651.60	204,967,959.60	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	112,587	3,089.20	347,803,760.40	
	SHREE CEMENT LTD	4,903	25,636.25	125,694,533.75	
	SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	30,000	9,131.70	273,951,000.00	
	SRF LTD	114,600	2,296.55	263,184,630.00	
	SUPREME INDUSTRIES LTD	38,100	5,729.50	218,293,950.00	
	TATA STEEL LTD	5,027,330	172.05	864,952,126.50	
	ULTRATECH CEMENT LTD	75,858	10,054.95	762,748,397.10	
	UPL LTD	331,172	537.40	177,971,832.80	
	VEDANTA LTD	813,891	449.90	366,169,560.90	
	ABB INDIA LTD	32,000	7,987.50	255,600,000.00	
	ADANI ENTERPRISES LTD	130,891	3,185.65	416,972,914.15	
	ASHOK LEYLAND LTD	810,688	225.70	182,972,281.60	
	ASTRAL LTD	72,159	2,149.30	155,091,338.70	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	2,768,047	273.65	757,476,061.55	

BHARAT HEAVY ELECTRICALS	827,457	277.95	229,991,673.15
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	524,622	656.20	344,256,956.40
CUMMINS INDIA LTD	91,700	3,505.30	321,436,010.00
HAVELLS INDIA LTD	221,032	1,839.70	406,632,570.40
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	145,654	4,666.60	679,708,956.40
LARSEN & TOUBRO LTD	488,801	3,482.55	1,702,273,922.55
POLYCAB INDIA LTD	40,000	6,858.75	274,350,000.00
SIEMENS LTD	69,275	6,793.95	470,650,886.25
SUZLON ENERGY LTD	7,327,491	49.80	364,909,051.80
THERMAX LTD	33,000	5,262.20	173,652,600.00
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	128,900	973.30	125,458,370.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	391,873	1,352.95	530,184,575.35
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	181,594	1,052.75	191,173,083.50
GMR AIRPORTS INFRASTRUCTURE	1,925,807	84.30	162,345,530.10
INTERGLOBE AVIATION LTD	108,908	4,301.00	468,413,308.00
BAJAJ AUTO LTD	49,126	9,701.45	476,593,432.70
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	38,519	3,108.50	119,736,311.50
BHARAT FORGE LTD	214,903	1,557.05	334,614,716.15
BOSCH LTD	6,006	30,651.70	184,094,110.20
EICHER MOTORS LTD	107,134	4,719.75	505,645,696.50
HERO MOTOCORP LTD	87,235	5,534.25	482,780,298.75
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	659,935	2,699.85	1,781,725,509.75
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	96,126	12,673.50	1,218,252,861.00
MRF LTD	2,162	126,132.05	272,697,492.10
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	2,003,422	152.45	305,421,683.90
SONA BLW PRECISION FORGINGS	329,920	657.00	216,757,440.00
TATA MOTORS LTD	1,083,589	938.25	1,016,677,379.25
TATA MOTORS LTD-A-DVR	420,777	626.15	263,469,518.55
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	65,000	3,861.50	250,997,500.00
TVS MOTOR CO LTD	141,207	2,398.20	338,642,627.40
PAGE INDUSTRIES LTD	4,006	38,793.40	155,406,360.40
TITAN CO LTD	233,390	3,321.65	775,239,893.50
INDIAN HOTELS CO LTD	546,100	583.50	318,649,350.00
JUBILANT FOODWORKS LTD	240,560	521.80	125,524,208.00
ZOMATO LTD	4,741,700	183.65	870,813,205.00
INFO EDGE INDIA LTD	55,197	6,125.20	338,092,664.40
TRENT LTD	128,201	4,878.45	625,422,168.45
AVENUE SUPERMARTS LTD	110,279	4,687.05	516,883,186.95
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	75,853	5,440.45	412,674,453.85
ITC LTD	2,078,689	435.40	905,061,190.60
MARICO LTD	303,092	637.85	193,327,232.20
NESTLE INDIA LTD	227,565	2,471.40	562,404,141.00

TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	451,186	1,139.90	514,306,921.40
UNITED SPIRITS LTD	167,525	1,305.45	218,695,511.25
VARUN BEVERAGES LTD	343,322	1,499.40	514,777,006.80
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	93,686	2,951.90	276,551,703.40
DABUR INDIA LTD	591,016	597.20	352,954,755.20
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	267,674	1,402.15	375,319,099.10
HINDUSTAN UNILEVER LTD	599,604	2,549.60	1,528,750,358.40
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	74,763	5,962.00	445,737,006.00
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	583,340	830.10	484,230,534.00
AUROBINDO PHARMA LTD	141,068	1,251.30	176,518,388.40
CIPLA LTD	344,661	1,477.00	509,064,297.00
DIVI'S LABORATORIES LTD	72,484	4,448.90	322,474,067.60
DR. REDDY'S LABORATORIES	84,374	5,890.95	497,043,015.30
LUPIN LTD	175,501	1,607.25	282,073,982.25
MANKIND PHARMA LTD	78,800	2,156.30	169,916,440.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	676,997	1,472.70	997,013,481.90
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	94,112	2,782.00	261,819,584.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	306,300	660.55	202,326,465.00
AXIS BANK LTD	1,582,415	1,170.95	1,852,928,844.25
BANDHAN BANK LTD	404,531	191.55	77,487,913.05
BANK OF BARODA	683,608	268.90	183,822,191.20
CANARA BANK	1,357,997	118.00	160,243,646.00
HDFC BANK LIMITED	1,980,459	1,559.70	3,088,921,902.30
ICICI BANK LTD	3,638,810	1,110.40	4,040,534,624.00
IDFC FIRST BANK LTD	2,839,763	77.25	219,371,691.75
INDUSIND BANK LTD	161,100	1,481.10	238,605,210.00
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	811,904	1,734.70	1,408,409,868.80
PUNJAB NATIONAL BANK	1,670,300	123.90	206,950,170.00
STATE BANK OF INDIA	1,236,623	816.95	1,010,259,159.85
UNION BANK OF INDIA	1,145,700	144.55	165,610,935.00
YES BANK LTD	11,298,904	22.90	258,744,901.60
BAJAJ FINANCE LTD	187,862	6,925.80	1,301,094,639.60
BAJAJ FINSERV LTD	288,169	1,526.45	439,875,570.05
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	16,100	8,130.30	130,897,830.00
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	351,404	1,335.70	469,370,322.80
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	72,853	3,760.50	273,963,706.50
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	1,900,623	349.40	664,077,676.20
MUTHOOT FINANCE LTD	70,100	1,753.25	122,902,825.00
POWER FINANCE CORPORATION	1,073,612	472.30	507,066,947.60
REC LTD	967,835	490.10	474,335,933.50
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	152,600	703.70	107,384,620.00
SHRIRAM FINANCE LTD	213,658	2,474.80	528,760,818.40

	SUNDARAM FINANCE LTD	60,000	4,479.75	268,785,000.00	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	619,035	555.25	343,719,183.75	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	138,845	1,644.80	228,372,256.00	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	194,605	563.60	109,679,378.00	
	PB FINTECH LTD	220,000	1,289.35	283,657,000.00	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	318,541	1,442.85	459,606,881.85	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	656,037	1,397.50	916,811,707.50	
	INFOSYS LTD	2,345,481	1,472.25	3,453,134,402.25	
	LTIMINDTREE LTD	57,510	4,800.25	276,062,377.50	
	MPHASIS LTD	43,391	2,436.30	105,713,493.30	
	PERSISTENT SYSTEMS LTD	74,600	3,694.35	275,598,510.00	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	643,531	3,830.40	2,464,981,142.40	
	TATA ELXSI LTD	19,600	6,932.20	135,871,120.00	
	TECH MAHINDRA LTD	378,412	1,317.45	498,538,889.40	
	WIPRO LTD	960,487	461.00	442,784,507.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	1,616,982	1,370.60	2,216,235,529.20	
	INDUS TOWERS LTD	820,000	339.35	278,267,000.00	
	TATA COMMUNICATIONS LTD	66,300	1,791.10	118,749,930.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	200,688	1,865.20	374,323,257.60	
	ADANI POWER LTD	465,107	749.35	348,527,930.45	
	GAIL INDIA LTD	1,369,662	207.90	284,752,729.80	
	JSW ENERGY LTD	267,500	625.10	167,214,250.00	
	NHPC LTD	2,200,000	102.60	225,720,000.00	
	NTPC LTD	3,197,593	349.75	1,118,358,151.75	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	3,381,807	300.45	1,016,063,913.15	
	TATA POWER CO LTD	1,226,910	431.55	529,473,010.50	
	TORRENT POWER LTD	128,400	1,461.95	187,714,380.00	
	DLF LTD	493,476	829.15	409,165,625.40	
	GODREJ PROPERTIES LTD	108,093	2,796.40	302,271,265.20	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	214,200	1,389.25	297,577,350.00	
	PHOENIX MILLS LTD	100,000	3,207.70	320,770,000.00	
	インドルビー 小計	111,537,337		81,567,001,814.65 (153,345,963,411)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	39,958	775.00	30,967,450.00	
	MONETA MONEY BANK AS	174,521	98.50	17,190,318.50	
	CEZ AS	144,745	955.50	138,303,847.50	
	チェココルナ 小計	359,224		186,461,616.00 (1,288,561,643)	
クウェートディ ナール	BOUBAYAN BANK K.S.C	828,963	0.57	479,969.57	
	GULF BANK	1,353,213	0.26	354,541.80	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	7,439,952	0.72	5,371,645.34	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	5,826,189	0.86	5,010,522.54	

	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	1,875,031	0.45	843,763.95	
	MABANEE CO KPSC	365,799	0.85	311,660.74	
クウェートディナール 小計		17,689,147		12,372,103.94 (6,285,276,243)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	210,054	36,240.00	7,612,356,960.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	363,860	34,760.00	12,647,773,600.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	241,634	19,060.00	4,605,544,040.00	
コロンビアペソ 小計		815,548		24,865,674,600.00 (983,462,296)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	298,686	2,828.00	844,684,008.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	136,757	9,355.00	1,279,361,735.00	
	OTP BANK PLC	141,641	17,480.00	2,475,884,680.00	
ハンガリーフォリント 小計		577,084		4,599,930,423.00 (1,999,465,556)	
アラブディルハム	MULTIPLY GROUP	2,382,334	1.88	4,478,787.92	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	1,481,824	3.04	4,504,744.96	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	2,712,209	3.35	9,085,900.15	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	2,767,696	7.85	21,726,413.60	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	1,263,450	10.80	13,645,260.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	2,117,807	5.51	11,669,116.57	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	3,572,750	11.72	41,872,630.00	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	2,520,489	16.00	40,327,824.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	2,874,678	5.70	16,385,664.60	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	5,129,227	7.40	37,956,279.80	
アラブディルハム 小計		26,822,464		201,652,621.60 (8,548,054,629)	
ポーランドズロチ	ORLEN SA	419,209	63.68	26,695,229.12	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	113,232	146.65	16,605,472.80	
	BUDIMEX	7,879	726.00	5,720,154.00	
	LPP SA	672	17,800.00	11,961,600.00	
	CD PROJEKT SA	39,305	132.50	5,207,912.50	
	ALLEGRO.EU SA	457,302	37.67	17,228,852.85	
	DINO POLSKA SA	32,029	390.80	12,516,933.20	
	BANK PEKAO SA	135,898	160.00	21,743,680.00	
	MBANK SA	8,679	617.00	5,354,943.00	
	PKO BANK POLSKI SA	622,161	57.72	35,911,132.92	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	23,502	499.30	11,734,548.60	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	457,338	48.63	22,240,346.94	
	PGE SA	422,950	6.93	2,933,581.20	
ポーランドズロチ 小計		2,740,156		195,854,387.13 (7,758,810,717)	
	EXXARO RESOURCES LTD	127,751	175.30	22,394,750.30	

南アフリカランド	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	49,359	595.86	29,411,053.74	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	297,797	449.93	133,987,804.21	
	GOLD FIELDS LTD	643,674	297.41	191,435,084.34	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	325,035	170.84	55,528,979.40	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	590,056	90.28	53,270,255.68	
	KUMBA IRON ORE LTD	35,041	480.79	16,847,362.39	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	346,869	114.29	39,643,658.01	
	SASOL LTD	464,362	120.01	55,728,083.62	
	SIBANYE STILLWATER LTD	1,896,239	21.56	40,882,912.84	
	BIDVEST GROUP LTD	248,683	244.11	60,706,007.13	
	NASPERS LTD-N SHS	128,243	3,911.27	501,592,998.61	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	1,021,247	17.03	17,391,836.41	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	810,593	54.25	43,974,670.25	
	BID CORP LTD	268,876	429.03	115,355,870.28	
	CLICKS GROUP LTD	148,332	300.05	44,507,016.60	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	340,054	251.36	85,475,973.44	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	223,949	232.53	52,074,860.97	
	ABSA GROUP LTD	636,000	148.04	94,153,440.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	66,817	2,173.14	145,202,695.38	
	NEDBANK GROUP LTD	332,898	219.91	73,207,599.18	
	STANDARD BANK GROUP LTD	902,914	179.63	162,190,441.82	
	FIRSTRAND LTD	3,864,096	62.69	242,240,178.24	
	REINET INVESTMENTS SCA	84,585	485.37	41,055,021.45	
	REMGRO LTD	429,903	122.29	52,572,837.87	
	DISCOVERY LTD	299,449	109.33	32,738,759.17	
	OLD MUTUAL LTD	3,429,466	10.28	35,254,910.48	
	OUTSURANCE GROUP LTD	394,727	41.81	16,503,535.87	
	SANLAM LTD	1,266,679	70.85	89,744,207.15	
	MTN GROUP LTD	1,220,409	82.14	100,244,395.26	
	VODACOM GROUP LTD	430,847	93.36	40,223,875.92	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	424,179	133.96	56,823,018.84	
南アフリカランド 小計		21,749,129		2,742,364,094.85	(22,542,232,859)
オフショア元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	176,500	8.99	1,586,735.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	1,126,325	6.33	7,129,637.25	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	454,728	44.16	20,080,788.48	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	124,900	17.91	2,236,959.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	235,000	7.62	1,790,700.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	42,000	6.08	255,360.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	685,100	9.99	6,844,149.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	409,600	26.66	10,919,936.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	222,000	10.91	2,422,020.00	

SHANXI COKING COAL ENERGY-A	142,970	10.92	1,561,232.40
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	100,900	22.04	2,223,836.00
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	150,082	23.83	3,576,454.06
YANTAI JEREH OILFIELD-A	9,100	34.56	314,496.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	650,300	7.94	5,163,382.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	173,900	24.27	4,220,553.00
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	681,496	7.04	4,797,731.84
CHINA JUSHI CO LTD -A	110,447	11.57	1,277,871.79
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	123,100	18.12	2,230,572.00
CHINA RARE EARTH RESOURCES-A	32,500	25.26	820,950.00
CMOC GROUP LTD-A	1,953,601	8.27	16,156,280.27
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	76,053	34.63	2,633,715.39
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	102,531	33.05	3,388,649.55
GEM CO LTD-A	131,700	6.57	865,269.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	84,280	19.44	1,638,403.20
HENAN SHENHUO COAL & POWER-A	125,100	23.27	2,911,077.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	257,100	14.36	3,691,956.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	537,748	7.05	3,791,123.40
HESTEEL CO LTD-A	1,596,100	2.04	3,256,044.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	27,200	50.01	1,360,272.00
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	106,636	7.59	809,367.24
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO-A	131,200	18.70	2,453,440.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	185,200	5.05	935,260.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	2,282,300	1.42	3,240,866.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	482,916	3.96	1,912,347.36
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	290,586	8.55	2,484,510.30
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	30,160	59.51	1,794,821.60
JIANGXI COPPER CO LTD-A	99,100	24.85	2,462,635.00
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	181,400	11.28	2,046,192.00
LB GROUP CO LTD-A	59,600	21.46	1,279,016.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	338,100	9.38	3,171,378.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	319,800	16.65	5,324,670.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	697,700	2.73	1,904,721.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	211,600	17.11	3,620,476.00
RONGSHENG PETROCHEMICAL CO-A	325,971	9.84	3,207,554.64
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	84,740	18.38	1,557,521.20
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	90,424	29.11	2,632,242.64
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	199,150	28.70	5,715,605.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	336,100	3.83	1,287,263.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	233,900	15.04	3,517,856.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	101,726	17.00	1,729,342.00
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	145,500	5.17	752,235.00

SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	1,174,400	3.59	4,216,096.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	20,880	31.17	650,829.60
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	47,100	14.57	686,247.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	59,200	35.80	2,119,360.00
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	100,000	8.08	808,000.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	60,900	14.93	909,237.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	510,800	3.81	1,946,148.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	206,800	88.80	18,363,840.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	7,840	25.51	199,998.40
WESTERN MINING CO -A	163,200	18.47	3,014,304.00
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	23,240	41.64	967,713.60
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	13,400	18.61	249,374.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	199,060	18.55	3,692,563.00
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	14,560	44.14	642,678.40
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	122,042	14.92	1,820,866.64
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A	34,651	38.13	1,321,242.63
YUNNAN YUNTIANHUA CO-A	40,000	21.45	858,000.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	34,400	25.61	880,984.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	55,015	26.91	1,480,453.65
ZHEJIANG JUHUA CO-A	107,700	23.59	2,540,643.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	204,800	8.60	1,761,280.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	85,176	19.03	1,620,899.28
ZHONGJIN GOLD CORP-A	349,900	14.47	5,063,053.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	673,600	17.59	11,848,624.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	78,931	20.74	1,637,028.94
AECC AVIATION POWER CO-A	79,200	37.36	2,958,912.00
AVICOPTER PLC-A	37,400	41.70	1,559,580.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	66,800	32.42	2,165,656.00
CHINA BAOAN GROUP-A	49,260	9.14	450,236.40
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	73,000	38.18	2,787,140.00
CHINA ENERGY ENGINEERING C-A	1,252,100	2.15	2,692,015.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	98,000	8.46	829,080.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	1,045,600	6.68	6,984,608.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	2,487,580	5.57	13,855,820.60
CHINA XD ELECTRIC CO LTD-A	391,100	7.25	2,835,475.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	208,174	204.79	42,631,953.46
CRRC CORP LTD-A	1,139,000	7.11	8,098,290.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	144,760	18.75	2,714,250.00
EVE ENERGY CO LTD-A	67,288	42.54	2,862,431.52
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	73,700	8.19	603,603.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	9,750	53.24	519,090.00
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	129,800	7.69	998,162.00

GONEO GROUP CO LTD-A	49,880	81.93	4,086,668.40
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	231,800	19.70	4,566,460.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	62,532	51.58	3,225,400.56
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	103,700	14.43	1,496,391.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	47,400	17.57	832,818.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	527,534	3.20	1,688,108.80
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	272,409	23.95	6,524,195.55
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	37,380	68.59	2,563,894.20
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	24,000	48.13	1,155,120.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	512,700	5.34	2,737,818.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	340,616	16.16	5,504,354.56
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	84,500	2.26	190,970.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	407,700	3.83	1,561,491.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	49,851	55.53	2,768,226.03
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	185,640	8.10	1,503,684.00
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	60,100	75.60	4,543,560.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	63,100	99.90	6,303,690.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	37,600	15.05	565,880.00
TBEA CO LTD-A	217,100	14.59	3,167,489.00
WEICHAJ POWER CO LTD-A	285,251	16.00	4,564,016.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	363,600	7.38	2,683,368.00
XIAMEN C & D INC-A	26,900	9.35	251,515.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	36,000	20.79	748,440.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	4,620	62.02	286,532.40
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	113,500	23.91	2,713,785.00
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	221,000	16.68	3,686,280.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-A	45,200	47.73	2,157,396.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	143,900	7.99	1,149,761.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	74,300	35.66	2,649,538.00
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	58,110	21.40	1,243,554.00
AIR CHINA LTD-A	287,800	7.44	2,141,232.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	3,698,000	5.16	19,081,680.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	547,400	3.95	2,162,230.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	444,100	5.85	2,597,985.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	469,130	16.85	7,904,840.50
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	1,793,200	7.12	12,767,584.00
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	2,330,900	1.26	2,936,934.00
LIAONING PORT CO LTD-A	2,697,000	1.30	3,506,100.00
S F HOLDING CO LTD-A	389,600	37.33	14,543,768.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	38,100	34.10	1,299,210.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	139,900	5.73	801,627.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	54,200	57.50	3,116,500.00

YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	75,200	16.24	1,221,248.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	78,060	8.76	683,805.60
ANHUI JIANGHUAI AUTO GROUP-A	109,000	15.39	1,677,510.00
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	288,700	6.83	1,971,821.00
BYD CO LTD -A	124,500	238.50	29,693,250.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	20,100	124.52	2,502,852.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	274,190	13.19	3,616,566.10
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	46,838	47.70	2,234,172.60
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	92,554	25.48	2,358,275.92
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	348,900	8.63	3,011,007.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	68,200	16.19	1,104,158.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	12,000	102.00	1,224,000.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	12,360	15.51	191,703.60
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	51,300	57.28	2,938,464.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	917,591	14.14	12,974,736.74
SAILUN GROUP CO LTD-A	107,100	14.89	1,594,719.00
SERES GROUP CO L-A	55,300	87.70	4,849,810.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	37,400	19.93	745,382.00
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	8,700	96.99	843,813.00
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	5,900	424.00	2,501,600.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	11,400	50.83	579,462.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	77,853	41.51	3,231,678.03
HAIER SMART HOME CO LTD-A	525,629	30.99	16,289,242.71
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	9,000	23.88	214,920.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	16,120	36.91	594,989.20
MIDEA GROUP CO LTD-A	195,800	65.76	12,875,808.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	12,917	65.17	841,800.89
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	5,200	53.59	278,668.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	27,000	27.11	731,970.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	24,843	9.84	244,455.12
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	75,300	13.62	1,025,586.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	27,900	8.87	247,473.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	626,202	6.54	4,095,361.08
KUNLUN TECH CO LTD-A	56,000	34.24	1,917,440.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	80,780	22.26	1,798,162.80
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	241,100	6.30	1,518,930.00
PEOPLE.CN CO LTD-A	55,400	21.03	1,165,062.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	126,520	3.74	473,184.80
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	159,499	72.41	11,549,322.59
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	1,907,100	5.63	10,736,973.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	48,200	4.68	225,576.00
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	344,500	8.19	2,821,455.00

DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	19,704	19.69	387,971.76
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	84,971	44.00	3,738,724.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	7,800	30.07	234,546.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	10,200	247.56	2,525,112.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	46,625	41.75	1,946,593.75
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	21,800	65.95	1,437,710.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	5,900	85.11	502,149.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	234,000	9.38	2,194,920.00
CHONGQING BREWERY CO-A	16,080	70.81	1,138,624.80
EASTROC BEVERAGE GROUP CO -A	17,500	228.67	4,001,725.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	289,213	35.74	10,336,472.62
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	49,519	49.50	2,451,190.50
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	118,600	12.97	1,538,242.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	87,500	24.92	2,180,500.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	293,000	27.47	8,048,710.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	32,590	52.43	1,708,693.70
JIANGSU YANGHE DISTILLERY-A	105,181	92.17	9,694,532.77
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	7,600	27.00	205,200.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	52,753	1,639.81	86,504,896.93
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	80,555	168.98	13,612,183.90
MUYUAN FOODS CO LTD-A	190,980	47.61	9,092,557.80
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	209,700	9.69	2,031,993.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	44,360	241.83	10,727,578.80
SHEDE SPIRITS CO LTD-A	22,300	70.62	1,574,826.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	12,600	43.92	553,392.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	18,161	79.88	1,450,700.68
WENS FOODSTUFFS GROUP CO L-A	261,140	21.63	5,648,458.20
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	208,900	144.90	30,269,610.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	23,700	29.50	699,150.00
BY-HEALTH CO LTD-A	133,500	14.86	1,983,810.00
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A	9,700	52.91	513,227.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	276,792	11.69	3,235,698.48
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	128,900	31.50	4,060,350.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	302,100	31.45	9,501,045.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	57,140	31.94	1,825,051.60
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	64,300	40.00	2,572,000.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	37,130	7.35	272,905.50
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	95,160	16.15	1,536,834.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	183,900	18.44	3,391,116.00
SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A	31,700	121.21	3,842,357.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	59,100	304.68	18,006,588.00
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	49,300	74.20	3,658,060.00

ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	19,040	74.53	1,419,051.20
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	281,500	31.31	8,813,765.00
BEIJING TONGRENTANG CO-A	29,900	44.75	1,338,025.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	13,804	66.29	915,067.16
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	34,200	57.17	1,955,214.00
CHANGCHUN HIGH-TECH INDUST-A	8,700	104.41	908,367.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	36,000	64.64	2,327,040.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	90,296	31.05	2,803,690.80
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	109,500	69.80	7,643,100.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	7,089	56.91	403,434.99
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	54,190	18.03	977,045.70
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	29,900	19.13	571,987.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	11,340	200.55	2,274,237.00
JIANGSU HENGRUI PHARMACEUT-A	374,183	42.91	16,056,192.53
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	18,400	12.52	230,368.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	5,800	39.89	231,362.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	28,125	19.70	554,062.50
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	112,400	23.62	2,654,888.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	240,500	7.32	1,760,460.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	129,825	17.45	2,265,446.25
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	89,800	27.75	2,491,950.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	76,100	17.75	1,350,775.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	106,800	32.68	3,490,224.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	180,580	12.33	2,226,551.40
WUXI APPTTEC CO LTD-A	290,811	42.58	12,382,732.38
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	80,260	53.88	4,324,408.80
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	19,300	230.99	4,458,107.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	13,860	17.50	242,550.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	4,863,500	4.43	21,545,305.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	751,100	5.70	4,281,270.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	137,793	15.37	2,117,878.41
BANK OF CHINA LTD-A	1,412,300	4.45	6,284,735.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	2,389,433	7.18	17,156,128.94
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	151,000	13.12	1,981,120.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	576,750	7.84	4,521,720.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	321,500	10.15	3,263,225.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	236,111	23.62	5,576,941.82
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	543,311	7.62	4,140,029.82
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	257,100	7.09	1,822,839.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	1,913,010	3.18	6,083,371.80
CHINA MERCHANTS BANK-A	894,899	34.00	30,426,566.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	1,426,128	3.81	5,433,547.68

CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	1,093,500	2.90	3,171,150.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	650,600	5.01	3,259,506.00
CNPC CAPITAL CO LTD-A	361,100	5.52	1,993,272.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	679,150	6.73	4,570,679.50
IND & COMM BK OF CHINA-A	3,675,728	5.46	20,069,474.88
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	740,574	17.57	13,011,885.18
PING AN BANK CO LTD-A	679,061	10.90	7,401,764.90
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	874,400	4.99	4,363,256.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	2,012,153	8.25	16,600,262.25
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	749,400	7.14	5,350,716.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	461,900	2.35	1,085,465.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	452,855	7.04	3,188,099.20
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	322,834	5.25	1,694,878.50
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	223,500	11.37	2,541,195.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	58,000	7.01	406,580.00
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	96,092	31.14	2,992,304.88
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	699,900	14.20	9,938,580.00
CITIC SECURITIES CO-A	397,445	18.49	7,348,758.05
CSC FINANCIAL CO LTD-A	192,700	20.79	4,006,233.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	26,200	8.17	214,054.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	522,334	12.26	6,403,814.84
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	101,600	15.61	1,585,976.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	97,100	5.27	511,717.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	299,965	8.20	2,459,713.00
GF SECURITIES CO LTD-A	281,900	12.52	3,529,388.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	110,261	5.40	595,409.40
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	51,600	10.54	543,864.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	229,500	9.23	2,118,285.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	745,625	13.68	10,200,150.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	31,900	6.29	200,651.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,293,479	8.10	10,477,179.90
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	13,530	111.95	1,514,683.50
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	313,740	13.05	4,094,307.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	180,700	5.22	943,254.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	226,900	7.79	1,767,551.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	341,800	7.89	2,696,802.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	343,400	5.97	2,050,098.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	634,714	4.47	2,837,171.58
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	210,300	7.95	1,671,885.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	246,100	6.35	1,562,735.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	53,700	3.74	200,838.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	567,600	2.63	1,492,788.00

WESTERN SECURITIES CO LTD-A	247,600	6.49	1,606,924.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	74,000	10.72	793,280.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	132,200	6.10	806,420.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	85,400	31.21	2,665,334.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	212,000	28.35	6,010,200.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	135,086	31.90	4,309,243.40
PICC HOLDING CO-A	647,000	5.27	3,409,690.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	412,422	42.45	17,507,313.90
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	319,600	7.81	2,496,076.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	17,500	266.04	4,655,700.00
EMPYREAN TECHNOLOGY CO LTD-A	17,600	80.00	1,408,000.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	50,398	19.39	977,217.22
IFLYTEK CO LTD - A	82,885	41.98	3,479,512.30
RANGE INTELLIGENT COMPUTI-A	79,700	26.74	2,131,178.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	8,500	52.88	449,480.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	42,276	41.30	1,745,998.80
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	12,400	56.50	700,600.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	87,015	10.62	924,099.30
ANKER INNOVATIONS TECHNOLO-A	26,130	72.11	1,884,234.30
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	36,700	31.90	1,170,730.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	1,238,900	4.09	5,067,101.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	48,197	29.98	1,444,946.06
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	164,000	9.00	1,476,000.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	296,998	5.86	1,740,408.28
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	13,700	44.51	609,787.00
EVERDISPLAY OPTRONICS SHAN-A	696,400	1.97	1,371,908.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	473,900	26.07	12,354,573.00
GOERTEK INC -A	71,400	17.42	1,243,788.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	166,500	10.65	1,773,225.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	1,330,300	10.58	14,074,574.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	49,000	31.89	1,562,610.00
IEIT SYSTEMS CO LTD-A	54,900	36.71	2,015,379.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	109,400	15.86	1,735,084.00
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	217,700	4.83	1,051,491.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	454,412	33.10	15,041,037.20
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	10,752	87.15	937,036.80
NINESTAR CORP-A	39,700	26.96	1,070,312.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	140,200	20.06	2,812,412.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	27,780	96.37	2,677,158.60
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	31,000	125.30	3,884,300.00
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD-A	51,475	44.14	2,272,106.50
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	72,200	15.48	1,117,656.00

TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	918,300	4.47	4,104,801.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	110,648	22.68	2,509,496.64
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	25,000	29.26	731,500.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	157,032	6.33	994,012.56
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	132,040	34.13	4,506,525.20
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	6,300	88.13	555,219.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	31,430	36.45	1,145,623.50
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	75,700	16.37	1,239,209.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	42,140	125.42	5,285,198.80
ZTE CORP-A	154,100	27.24	4,197,684.00
CHINA UNITED NETWORK-A	1,185,800	4.52	5,359,816.00
CGN POWER CO LTD-A	632,800	4.34	2,746,352.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	240,000	10.15	2,436,000.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	1,122,300	4.58	5,140,134.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	1,231,742	28.03	34,525,728.26
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	73,600	19.86	1,461,696.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	570,400	5.87	3,348,248.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	367,600	7.12	2,617,312.00
HUANENG POWER INTL INC-A	324,300	9.27	3,006,261.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	390,500	17.83	6,962,615.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	300,860	7.25	2,181,235.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	180,400	18.26	3,294,104.00
WINTIME ENERGY GROUP CO L-A	2,307,800	1.19	2,746,282.00
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	838,200	6.84	5,733,288.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	20,700	140.09	2,899,863.00
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	10,000	173.37	1,733,700.00
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	51,000	37.81	1,928,310.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	101,300	24.20	2,451,460.00
GALAXYCORE INC-A	100,100	12.95	1,296,295.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTO-CL A	35,556	83.15	2,956,481.40
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	62,322	24.92	1,553,064.24
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	33,200	17.73	588,636.00
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	71,200	69.30	4,934,160.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	10,100	58.45	590,345.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	144,480	14.13	2,041,502.40
JCET GROUP CO LTD-A	47,200	27.95	1,319,240.00
JINKO SOLAR CO LTD-A	351,000	8.53	2,994,030.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	385,389	17.18	6,620,983.02
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	52,600	51.21	2,693,646.00
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	189,500	14.08	2,668,160.00
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	20,900	320.04	6,688,836.00
PIOTECH INC-A	7,900	200.24	1,581,896.00

	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	358,200	12.14	4,348,548.00	
	SG MICRO CORP-A	7,897	79.46	627,495.62	
	SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A	102,200	10.66	1,089,452.00	
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	4,900	90.80	444,920.00	
	SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	5,632	137.22	772,823.04	
	TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	164,500	10.45	1,719,025.00	
	TIANSUI HUATIAN TECHNOLOG-A	201,300	8.11	1,632,543.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	29,100	23.58	686,178.00	
	TONGWEI CO LTD-A	157,700	22.14	3,491,478.00	
	TRINA SOLAR CO LTD-A	56,200	20.84	1,171,208.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	36,299	56.93	2,066,502.07	
	WILL SEMICONDUCTOR CO LTD-A	38,915	100.18	3,898,504.70	
	XINJIANG DAQO NEW ENERGY C-A	87,400	25.57	2,234,818.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	61,400	31.15	1,912,610.00	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	242,622	9.90	2,401,957.80	
	CHINA VANKE CO LTD -A	424,956	8.02	3,408,147.12	
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	498,187	3.34	1,663,944.58	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	357,000	10.29	3,673,530.00	
	SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	160,740	10.55	1,695,807.00	
	YOUNGOR FASHION CO LTD-A	106,400	7.91	841,624.00	
	オフショア元 小計	122,594,531		1,615,029,104.65	(34,643,343,312)
サウジアラビア リヤル	ADES HOLDING CO	302,942	19.22	5,822,545.24	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	1,887,884	28.30	53,427,117.20	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	101,795	39.20	3,990,364.00	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	171,941	109.20	18,775,957.20	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	202,755	29.60	6,001,548.00	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	957,273	43.90	42,024,284.70	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	26,867	131.20	3,524,950.40	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	670,110	74.50	49,923,195.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	370,931	21.00	7,789,551.00	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	362,675	8.09	2,934,040.75	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	158,529	36.10	5,722,896.90	
	SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES	20,515	274.00	5,621,110.00	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	23,810	208.00	4,952,480.00	
	JARIR MARKETING CO	613,605	13.02	7,989,137.10	
	NAHDI MEDICAL CO	18,802	131.40	2,470,582.80	
	ALMARAI CO	144,974	52.80	7,654,627.20	
	SAVOLA	136,987	42.00	5,753,454.00	
	DALLAH HEALTHCARE CO	17,729	164.40	2,914,647.60	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	56,083	289.00	16,207,987.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	60,419	112.80	6,815,263.20	

	AL RAJHI BANK	1,400,532	78.90	110,501,974.80	
	ALINMA BANK	966,573	31.30	30,253,734.90	
	ARAB NATIONAL BANK	745,501	20.28	15,118,760.28	
	BANK AL-JAZIRA	358,107	15.68	5,615,117.76	
	BANK ALBILAD	488,480	33.00	16,119,840.00	
	BANQUE SAUDI FRANSI	476,548	35.05	16,703,007.40	
	RIYAD BANK	1,010,630	25.05	25,316,281.50	
	SAUDI AWWAL BANK	702,713	38.40	26,984,179.20	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	335,413	12.82	4,299,994.66	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	2,077,231	35.45	73,637,838.95	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	29,391	246.80	7,253,698.80	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	71,290	224.40	15,997,476.00	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	40,167	135.60	5,446,645.20	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	16,778	282.20	4,734,751.60	
	ELM CO	18,948	815.20	15,446,409.60	
	ETIHAD ETISALAT CO	246,942	49.75	12,285,364.50	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	228,789	11.52	2,635,649.28	
	SAUDI TELECOM CO	1,481,185	36.35	53,841,074.75	
	ACWA POWER CO	101,717	382.20	38,876,237.40	
	POWER & WATER UTILITY CO FOR	34,137	59.40	2,027,737.80	
	SAUDI ELECTRICITY CO	540,535	16.60	8,972,881.00	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	274,619	11.84	3,251,488.96	
	サウジアラビアリアル 小計	17,952,852		755,635,883.63 (31,449,565,476)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	754,696	163.60	123,468,265.60	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	884,882	48.54	42,952,172.28	
	SASA POLYESTER SANAYI	755,799	46.28	34,978,377.72	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	715,526	60.45	43,253,546.70	
	KOC HOLDING AS	575,490	217.00	124,881,330.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	1,407,472	48.40	68,121,644.80	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	116,686	205.30	23,955,635.80	
	TURK HAVA YOLLARI AO	399,830	305.50	122,148,065.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	41,470	1,016.00	42,133,520.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	53,584	299.25	16,035,012.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	323,604	500.50	161,963,802.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	67,796	795.00	53,897,820.00	
	AKBANK T.A.S.	2,296,731	61.15	140,445,100.65	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	1,124,192	94.75	106,517,192.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	4,925,110	16.08	79,195,768.80	
	YAPI VE KREDI BANKASI	1,948,324	32.06	62,463,267.44	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	650,401	98.95	64,357,178.95	
		17,041,593		1,310,767,699.74	

トルコリラ 小計				(6,333,105,218)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	40,905	26.70	1,092,163.50	
	MYTILINEOS S.A.	96,764	36.96	3,576,397.44	
	OPAP SA	103,580	15.00	1,553,700.00	
	FF GROUP	5,889	—	—	
	JUMBO SA	66,836	26.90	1,797,888.40	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	1,184,493	1.59	1,887,489.59	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	1,907,754	2.07	3,966,220.56	
	NATIONAL BANK OF GREECE	647,914	8.02	5,200,157.76	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	680,120	3.78	2,574,254.20	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	175,833	13.80	2,426,495.40	
	PUBLIC POWER CORP	111,882	11.15	1,247,484.30	
ユーロ 小計		5,021,970		25,322,251.15 (4,296,932,797)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	422,627	15.00	6,339,405.00	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	1,857,028	4.29	7,983,363.37	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	5,078,546	1.70	8,658,920.93	
	INDUSTRIES QATAR	832,122	11.93	9,927,215.46	
	COMMERCIAL BANK PSQC	2,356,646	3.92	9,238,052.32	
	DUKHAN BANK	1,104,320	3.55	3,925,857.60	
	MASRAF AL RAYAN	3,510,349	2.33	8,179,113.17	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	555,729	10.11	5,618,420.19	
	QATAR ISLAMIC BANK	1,199,936	17.68	21,214,868.48	
	QATAR NATIONAL BANK	3,128,940	13.67	42,772,609.80	
	QOOREDOO QPSC	397,674	9.53	3,789,833.22	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	266,231	15.10	4,020,088.10	
	BARWA REAL ESTATE CO	3,105,300	2.86	8,890,473.90	
カタールリアル 小計		23,815,448		140,558,221.54 (6,018,703,046)	
合 計		4,074,027,305		826,744,306,024 (826,744,306,024)	

(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
メキシコ ペソ	投資証券	OPERADORA DE SITIS MEX- A-1	648,200	12,004,664.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	701,263	48,387,147.00	
		TRUST FIBRA UNO	1,759,200	43,258,728.00	
メキシコペソ合計			3,108,663	103,650,539.00 (899,852,519)	
				899,852,519	

合計		(899,852,519)	
----	--	---------------	--

(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 45銘柄	100.00%	—	2.81%
香港ドル	株式 157銘柄	100.00%	—	20.12%
マレーシアリングット	株式 32銘柄	100.00%	—	1.40%
タイバーツ	株式 32銘柄	100.00%	—	1.37%
フィリピンペソ	株式 13銘柄	100.00%	—	0.54%
インドネシアルピア	株式 21銘柄	100.00%	—	1.59%
メキシコペソ	株式 21銘柄	95.26%	—	2.19%
	投資証券 3銘柄	—	4.74%	0.11%
ブラジルレアル	株式 48銘柄	100.00%	—	4.54%
チリペソ	株式 12銘柄	100.00%	—	0.47%
韓国ウォン	株式 98銘柄	100.00%	—	11.87%
ニュー台湾ドル	株式 88銘柄	100.00%	—	18.50%
インドルピー	株式 146銘柄	100.00%	—	18.53%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.00%	—	0.16%
クウェートディナール	株式 6銘柄	100.00%	—	0.76%
コロンビアペソ	株式 3銘柄	100.00%	—	0.12%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.00%	—	0.24%
アラブディルハム	株式 10銘柄	100.00%	—	1.03%
ポーランドズロチ	株式 13銘柄	100.00%	—	0.94%
南アフリカランド	株式 32銘柄	100.00%	—	2.72%
オフショア元	株式 407銘柄	100.00%	—	4.19%
サウジアラビアリヤル	株式 42銘柄	100.00%	—	3.80%
トルコリラ	株式 17銘柄	100.00%	—	0.77%
ユーロ	株式 11銘柄	100.00%	—	0.52%
カタールリアル	株式 13銘柄	100.00%	—	0.73%

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。

日本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 6月 8日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,489,169,471

[2024年 6月 8日現在]

株式	189,594,883,400
投資証券	859,475,700
派生商品評価勘定	13,673,500
未収入金	3,203,400
未収配当金	1,047,175,060
未収利息	6,137
差入委託証拠金	117,482,844
流動資産合計	195,125,069,512
資産合計	195,125,069,512
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	69,150
前受金	24,720,000
未払金	2,194,249,635
流動負債合計	2,219,038,785
負債合計	2,219,038,785
純資産の部	
元本等	
元本	97,349,602,879
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	95,556,427,848
元本等合計	192,906,030,727
純資産合計	192,906,030,727
負債純資産合計	195,125,069,512

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。

（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 6月 8日現在]
1. 期首	2023年12月 9日
期首元本額	55,898,037,572円
期中追加設定元本額	62,305,620,455円
期中一部解約元本額	20,854,055,148円
元本の内訳	
MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信	1,421,679,947円
eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）	95,184,451,080円
つみたて全世界株式	710,416,915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）	33,054,937円
合計	97,349,602,879円
2. 受益権の総数	97,349,602,879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12月 9日 至 2024年 6月 8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

区分	自 2023年12月 9日 至 2024年 6月 8日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	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。 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 6月 8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 6月 8日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	6,678,807,244
投資証券	42,349,559
合計	6,636,457,685

(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 6月 8日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,270,510,000	—	2,284,160,000	13,650,000
合計		2,270,510,000	—	2,284,160,000	13,650,000

（注）時価の算定方法

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

（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 6月 8日現在]
1口当たり純資産額	1.9816円
(1万口当たり純資産額)	(19,816円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

	銘 柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1605	I N P E X	303,300	2,324.00	704,869,200	
1801	大成建設	53,400	6,016.00	321,254,400	
1802	大林組	208,500	1,811.00	377,593,500	
1812	鹿島建設	135,800	2,663.00	361,635,400	
1925	大和ハウス工業	180,000	4,130.00	743,400,000	
1928	積水ハウス	191,600	3,635.00	696,466,000	
2267	ヤクルト本社	82,400	2,846.50	234,551,600	
2269	明治ホールディングス	75,400	3,533.00	266,388,200	
2502	アサヒグループホールディングス	154,700	5,824.00	900,972,800	
2503	麒麟ホールディングス	249,500	2,215.00	552,642,500	
2587	サントリー食品インターナショナル	44,700	5,613.00	250,901,100	
2801	キッコーマン	217,900	1,833.00	399,410,700	
2802	味の素	150,700	5,816.00	876,471,200	
2897	日清食品ホールディングス	64,400	4,131.00	266,036,400	
2914	日本たばこ産業	385,400	4,561.00	1,757,809,400	
3402	東レ	445,400	776.60	345,897,640	
3407	旭化成	402,900	1,025.50	413,173,950	
4021	日産化学	40,100	4,667.00	187,146,700	
4063	信越化学工業	578,600	6,111.00	3,535,824,600	
4091	日本酸素ホールディングス	55,600	4,637.00	257,817,200	
4183	三井化学	54,800	4,692.00	257,121,600	
4188	三菱ケミカルグループ	435,400	827.00	360,075,800	
4204	積水化学工業	122,400	2,217.00	271,360,800	
4452	花王	149,600	7,028.00	1,051,388,800	
4612	日本ペイントホールディングス	304,500	1,086.50	330,839,250	
4901	富士フイルムホールディングス	359,500	3,679.00	1,322,600,500	
4911	資生堂	128,500	5,154.00	662,289,000	
6988	日東電工	46,100	12,300.00	567,030,000	
8113	ユニ・チャーム	129,600	5,224.00	677,030,400	
4151	協和キリン	86,700	2,704.50	234,480,150	
4502	武田薬品工業	508,200	4,232.00	2,150,702,400	

4503	アステラス製薬	581,200	1,590.00	924,108,000	
4507	塩野義製薬	81,000	6,301.00	510,381,000	
4519	中外製薬	215,700	4,757.00	1,026,084,900	
4523	エーザイ	81,000	6,768.00	548,208,000	
4528	小野薬品工業	120,100	2,236.50	268,603,650	
4568	第一三共	594,000	5,829.00	3,462,426,000	
4578	大塚ホールディングス	134,400	6,413.00	861,907,200	
5019	出光興産	290,700	1,052.00	305,816,400	
5020	ＥＮＥＯＳホールディングス	925,300	777.80	719,698,340	
5108	ブリヂストン	183,400	6,604.00	1,211,173,600	
5201	A G C	62,800	5,375.00	337,550,000	
5332	T O T O	45,500	3,852.00	175,266,000	
5401	日本製鉄	274,700	3,366.00	924,640,200	
5411	J F Eホールディングス	184,800	2,286.00	422,452,800	
5713	住友金属鉱山	79,400	4,866.00	386,360,400	
5802	住友電気工業	229,500	2,578.00	591,651,000	
3436	S U M C O	112,500	2,305.00	259,312,500	
6146	ディスコ	29,600	59,800.00	1,770,080,000	
6273	S M C	18,400	77,130.00	1,419,192,000	
6301	小松製作所	297,100	4,522.00	1,343,486,200	
6305	日立建機	34,500	4,120.00	142,140,000	
6326	クボタ	321,200	2,202.50	707,443,000	
6367	ダイキン工業	84,700	22,470.00	1,903,209,000	
6383	ダイフク	97,600	2,910.00	284,016,000	
6465	ホンザキ	34,900	5,530.00	192,997,000	
6586	マキタ	71,900	4,478.00	321,968,200	
7011	三菱重工業	1,029,300	1,386.50	1,427,124,450	
4062	イビデン	36,200	6,299.00	228,023,800	
6448	ブラザー工業	74,500	3,008.00	224,096,000	
6479	ミネベアミツミ	116,600	3,240.00	377,784,000	
6501	日立製作所	297,800	16,350.00	4,869,030,000	
6503	三菱電機	620,600	2,655.00	1,647,693,000	
6504	富士電機	40,800	9,215.00	375,972,000	
6506	安川電機	77,100	5,986.00	461,520,600	
6594	ニデック	134,000	6,996.00	937,464,000	
6645	オムロン	56,300	5,165.00	290,789,500	
6701	日本電気	78,900	12,100.00	954,690,000	
6702	富士通	565,400	2,432.00	1,375,052,800	
6723	ルネサスエレクトロニクス	480,600	2,960.00	1,422,576,000	
6724	セイコーエプソン	92,700	2,481.50	230,035,050	
6752	パナソニック ホールディングス	748,800	1,335.50	1,000,022,400	
6758	ソニーグループ	401,000	13,425.00	5,383,425,000	

6762	T D K	124,900	8,355.00	1,043,539,500	
6841	横河電機	73,300	3,935.00	288,435,500	
6857	アドバンテスト	246,000	5,292.00	1,301,832,000	
6861	キーエンス	62,500	69,640.00	4,352,500,000	
6869	シスメックス	161,700	2,620.00	423,654,000	
6920	レーザーテック	25,700	36,200.00	930,340,000	
6954	ファナック	306,000	4,329.00	1,324,674,000	
6963	ローム	105,900	2,020.50	213,970,950	
6965	浜松ホトニクス	45,100	4,686.00	211,338,600	
6971	京セラ	412,300	1,811.50	746,881,450	
6981	村田製作所	553,500	3,048.00	1,687,068,000	
7276	小糸製作所	64,300	2,137.50	137,441,250	
7735	S C R E E Nホールディングス	26,100	14,865.00	387,976,500	
7751	キャノン	321,300	4,582.00	1,472,196,600	
7752	リコー	176,200	1,454.00	256,194,800	
8035	東京エレクトロン	151,500	34,460.00	5,220,690,000	
6201	豊田自動織機	47,100	13,860.00	652,806,000	
6902	デンソー	607,300	2,474.00	1,502,460,200	
7201	日産自動車	753,300	531.70	400,529,610	
7202	いすゞ自動車	187,300	1,984.00	371,603,200	
7203	トヨタ自動車	3,405,800	3,219.00	10,963,270,200	
7259	アイシン	47,300	5,654.00	267,434,200	
7261	マツダ	182,600	1,530.00	279,378,000	
7267	本田技研工業	1,441,300	1,667.50	2,403,367,750	
7269	スズキ	504,700	1,858.50	937,984,950	
7270	S U B A R U	193,700	3,367.00	652,187,900	
7272	ヤマハ発動機	286,800	1,499.00	429,913,200	
7309	シマノ	24,500	26,190.00	641,655,000	
4543	テルモ	430,900	2,702.00	1,164,291,800	
7701	島津製作所	76,100	4,066.00	309,422,600	
7733	オリンパス	370,700	2,643.50	979,945,450	
7741	H O Y A	112,700	19,030.00	2,144,681,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	192,500	3,026.00	582,505,000	
7911	T O P P A Nホールディングス	73,900	4,110.00	303,729,000	
7912	大日本印刷	66,800	4,905.00	327,654,000	
7936	アシックス	51,800	9,371.00	485,417,800	
7974	任天堂	333,700	8,755.00	2,921,543,500	
9501	東京電力ホールディングス	490,300	926.10	454,066,830	
9502	中部電力	206,900	2,008.50	415,558,650	
9503	関西電力	226,100	2,799.00	632,853,900	
9531	東京瓦斯	115,700	3,482.00	402,867,400	
9532	大阪瓦斯	118,500	3,511.00	416,053,500	

9005	東急	160,500	1,809.00	290,344,500	
9009	京成電鉄	41,500	5,473.00	227,129,500	
9020	東日本旅客鉄道	291,500	2,713.00	790,839,500	
9021	西日本旅客鉄道	141,100	3,153.00	444,888,300	
9022	東海旅客鉄道	248,100	3,471.00	861,155,100	
9041	近鉄グループホールディングス	58,200	3,360.00	195,552,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	73,500	4,106.00	301,791,000	
9064	ヤマトホールディングス	81,000	1,749.50	141,709,500	
9143	S Gホールディングス	102,800	1,485.00	152,658,000	
9147	N I P P O N E X P R E S Sホール ディン	23,300	7,577.00	176,544,100	
9101	日本郵船	147,500	5,050.00	744,875,000	
9104	商船三井	110,500	5,209.00	575,594,500	
9107	川崎汽船	126,200	2,467.00	311,335,400	
9201	日本航空	46,300	2,618.00	121,213,400	
9202	A N Aホールディングス	51,300	2,981.50	152,950,950	
3626	T I S	68,300	2,981.00	203,602,300	
3659	ネクソン	107,900	2,778.00	299,746,200	
4307	野村総合研究所	121,200	4,158.00	503,949,600	
4684	オービック	20,800	20,200.00	420,160,000	
4689	L I N E ヤフー	858,400	377.70	324,217,680	
4704	トレンドマイクロ	43,000	7,098.00	305,214,000	
4716	日本オラクル	12,400	11,420.00	141,608,000	
4768	大塚商会	73,200	2,863.00	209,571,600	
9432	日本電信電話	9,596,600	150.00	1,439,490,000	
9433	K D D I	480,700	4,263.00	2,049,224,100	
9434	ソフトバンク	916,500	1,946.00	1,783,509,000	
9435	光通信	5,800	27,915.00	161,907,000	
9602	東宝	35,900	5,120.00	183,808,000	
9613	N T Tデータグループ	202,700	2,359.50	478,270,650	
9697	カプコン	111,300	3,000.00	333,900,000	
9719	S C S K	50,200	3,063.00	153,762,600	
9766	コナミグループ	32,300	11,240.00	363,052,000	
9984	ソフトバンクグループ	330,500	9,496.00	3,138,428,000	
3038	神戸物産	48,300	3,471.00	167,649,300	
8001	伊藤忠商事	381,700	7,352.00	2,806,258,400	
8002	丸紅	457,600	2,961.50	1,355,182,400	
8015	豊田通商	68,200	9,172.00	625,530,400	
8031	三井物産	413,200	7,685.00	3,175,442,000	
8053	住友商事	333,900	4,020.00	1,342,278,000	
8058	三菱商事	1,073,700	3,247.00	3,486,303,900	
2702	日本マクドナルドホールディングス	27,800	6,430.00	178,754,000	
3064	M o n o t a R O	80,500	1,663.00	133,871,500	

3088	マツキヨココカラ＆カンパニー	110,200	2,145.00	236,379,000	
3092	Z O Z O	43,400	3,752.00	162,836,800	
3382	セブン＆アイ・ホールディングス	718,800	2,054.00	1,476,415,200	
7532	パン・パシフィック・インターナショナルホ	122,300	3,919.00	479,293,700	
7550	ゼンショーホールディングス	31,000	6,229.00	193,099,000	
8267	イオン	210,000	3,522.00	739,620,000	
9843	ニトリホールディングス	25,700	17,265.00	443,710,500	
9983	ファーストリテイリング	56,200	41,080.00	2,308,696,000	
5831	しずおかフィナンシャルグループ	140,900	1,539.50	216,915,550	
7182	ゆうちょ銀行	464,700	1,513.00	703,091,100	
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	337,500	897.80	303,007,500	
8306	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	3,566,100	1,622.50	5,785,997,250	
8308	りそなホールディングス	677,200	1,026.00	694,807,200	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	210,400	3,602.00	757,860,800	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	401,900	10,185.00	4,093,351,500	
8331	千葉銀行	170,200	1,400.00	238,280,000	
8411	みずほフィナンシャルグループ	774,700	3,108.00	2,407,767,600	
8473	S B Iホールディングス	87,300	4,113.00	359,064,900	
8601	大和証券グループ本社	428,400	1,308.00	560,347,200	
8604	野村ホールディングス	965,200	971.50	937,691,800	
7181	かんぽ生命保険	61,500	2,911.50	179,057,250	
8630	S O M P Oホールディングス	286,300	3,330.00	953,379,000	
8725	M S & A Dインシュアランスグループホール	413,200	3,137.00	1,296,208,400	
8750	第一生命ホールディングス	290,700	4,020.00	1,168,614,000	
8766	東京海上ホールディングス	603,500	5,442.00	3,284,247,000	
8795	T & Dホールディングス	157,200	2,728.00	428,841,600	
8591	オリックス	370,700	3,440.00	1,275,208,000	
8593	三菱ＨＣキャピタル	259,100	1,023.50	265,188,850	
8697	日本取引所グループ	159,300	3,812.00	607,251,600	
1878	大東建託	18,800	16,810.00	316,028,000	
3003	ヒューリック	123,300	1,483.50	182,915,550	
3231	野村不動産ホールディングス	35,300	4,103.00	144,835,900	
8801	三井不動産	857,500	1,505.50	1,290,966,250	
8802	三菱地所	361,500	2,635.50	952,733,250	
8830	住友不動産	91,700	4,899.00	449,238,300	
2413	エムスリー	141,800	1,610.50	228,368,900	
4324	電通グループ	65,100	4,034.00	262,613,400	
4661	オリエンタルランド	350,400	4,576.00	1,603,430,400	
4755	楽天グループ	481,800	850.00	409,530,000	
6098	リクルートホールディングス	476,900	7,749.00	3,695,498,100	

6178	日本郵政	669,300	1,489.00	996,587,700	
9735	セコム	67,400	9,645.00	650,073,000	
合 計		63,327,000		189,594,883,400	

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
投資証券	日本プロロジスリート投資法人	729	179,771,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人	1,287	180,051,300	
	日本ビルファンド投資法人	492	286,344,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	411	213,309,000	
合計		2,919	859,475,700	

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】

【ＭＡＸＩＳ全世界株式（オール・カントリー）上場投信】

【純資産額計算書】

2024年 6月28日現在

（単位：円）

資産総額	56,275,371,822
負債総額	417,143,574
純資産総額（ - ）	55,858,228,248
発行済口数	2,632,100口
1口当たり純資産価額（ / ）	21,222

（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 6月28日現在

（単位：円）

資産総額	6,145,520,015,574
負債総額	448,774,492
純資産総額（ - ）	6,145,071,241,082
発行済口数	814,172,629,847口
1口当たり純資産価額（ / ）	7.5476
（10,000口当たり）	（75,476）

新興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 6月28日現在

（単位：円）

資産総額	903,890,352,891
負債総額	529,665,199
純資産総額（ - ）	903,360,687,692
発行済口数	217,317,391,828口
1口当たり純資産価額（ / ）	4.1569
（10,000口当たり）	（41,569）

日本株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年 6月28日現在

（単位：円）

資産総額	201,739,486,810
負債総額	279,415,952

純資産総額（ - ）	201,460,070,858
発行済口数	99,590,716,227口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.0229
（ 10,000口当たり ）	（ 20,229 ）

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ます。

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、信託約款の規定のほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額等

2024年6月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近５年間における資本金の額の増減はありません。

（２）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

・投資運用の意思決定機構

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 6月28日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本 数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	825	36,626,583
追加型公社債投資信託	16	1,559,147
単位型株式投資信託	95	421,610
単位型公社債投資信託	47	98,304
合 計	983	38,705,644

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 年金資産	2,468,195 千円	2,250,427 千円
	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（2024年3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 (2024年3月末現在)	事業の内容
三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616 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。
みずほ証券株式会社	125,167 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。
野村證券株式会社	10,000 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。
バークレイズ証券株式会社	38,945 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。
ＢＮＰパリバ証券株式会社	102,025 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。
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	5,905 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、解約の取扱い等を行います。

3【資本関係】

該当ありません。（2024年6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
-------	------

2024年 3月 7日	有価証券届出書
2024年 3月 7日	有価証券報告書

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8月14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

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ＭＡＸＩＳ全世界株式（オール・カントリー）上場投信の2023年12月9日から2024年6月8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、ＭＡＸＩＳ全世界株式（オール・カントリー）上場投信の2024年6月8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。

監査人は、経営者に対して、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

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。